

Scotiabank Inverlat

BANCO LÍDER EN LAS AMÉRICAS

Scotiabank[®]

Scotiabank Indicadores Financieros	2021		2020		
	T2	T1	T4	T3	T2
ROE (Utilidad neta del trimestre anualizada / Capital contable promedio)	13.8	11.4	7.9	2.6	1.4
ROA (Utilidad neta del trimestre anualizada / Activo total promedio)	1.2	1.0	0.7	0.2	0.1
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.3	3.2	2.8	2.2	2.2
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.8	3.0	3.0	3.0	2.8
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.78	3.57	3.05	2.62	2.58
Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre)	107.8	116.1	134.8	143.8	125.0
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	*17.67	16.83	15.94	15.91	15.14
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	*15.11	14.39	13.91	13.85	13.44
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	78.1	69.1	64.0	76.5	65.9

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank Información Financiera	3 meses				6 meses		
	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%	30 jun 2020	30 jun 2021	A/A Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)							
Ingresos por intereses	12,581	10,968	10,970	-13%	25,303	21,938	-13%
Gastos por intereses	(6,162)	(4,658)	(4,897)	21%	(12,926)	(9,555)	26%
Margen Financiero	6,419	6,310	6,073	-5%	12,377	12,383	0%
Comisiones	885	1,084	1,196	35%	1,915	2,280	19%
Intermediación	438	204	377	-14%	1,180	581	-51%
OI OE	388	465	575	48%	883	1,040	18%
Ingresos no Financieros	1,711	1,753	2,148	26%	3,978	3,901	-2%
Total Ingresos	8,130	8,063	8,221	1%	16,355	16,284	0%
Gastos de Administración y Promoción	(4,488)	(4,805)	(4,659)	-4%	(9,080)	(9,464)	-4%
PTPP	3,642	3,258	3,562	-2%	7,275	6,820	-6%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(3,057)	(1,349)	(912)	70%	(5,060)	(2,261)	55%
Resultado de la Operación	585	1,909	2,650	>+100%	2,215	4,559	>+100%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	1	(1)	1	0%	1	-	-100%
Utilidad antes de Impuestos a la Utilidad	586	1,908	2,651	>+100%	2,216	4,559	>+100%
Impuestos a la Utilidad	(392)	(296)	(627)	-60%	(638)	(923)	-45%
Utilidad después de Impuestos a la Utilidad	194	1,612	2,024	>+100%	1,578	3,636	>+100%

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

En el segundo trimestre de 2021, la utilidad neta consolidada de Scotiabank Inverlat, S.A. de C.V. (Scotiabank), se ubicó en \$2,024 millones, un incremento de \$1,830 millones respecto al mismo periodo del año pasado, debido principalmente a la creación de reservas voluntarias en 2020 y menores requerimientos de reservas en cartera de menudeo y comercial en el segundo trimestre de 2021.

Respecto al trimestre anterior, la utilidad neta mostró un incremento de \$412 millones o 26%, impulsada por una menor estimación preventiva para riesgos crediticios, mayores resultados por intermediación principalmente a una menor pérdida en valuación de swaps de cobertura, así como una reducción de gastos de operación principalmente por servicios profesionales; compensada parcialmente por mayores impuestos a la utilidad.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio 2021 se ubicó en \$3,636 millones un incremento anual de \$2,058 millones o 130%; debido principalmente a la creación de reservas voluntarias en 2020 y menores requerimientos de reservas en cartera de menudeo y comercial en 2021; compensados parcialmente por mayores gastos por servicios profesionales e IVA (ambos en gastos de operación), así como mayores impuestos a la utilidad.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%	30 jun 2020	30 jun 2021	A/A Δ%
Comisiones de Crédito	72	154	186	>+100%	180	340	89%
Manejo de cuenta	78	66	72	-8%	161	138	-14%
Tarjeta de Crédito y Débito	369	414	444	20%	819	858	5%
Actividades fiduciarias	53	48	88	66%	102	136	33%
Servicios de banca electrónica	112	120	138	23%	231	258	12%
Compraventa de valores	11	14	13	18%	25	27	8%
Cartas de crédito sin refinanciamiento	54	42	52	-4%	98	94	-4%
Otras	136	226	203	49%	299	429	43%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	885	1,084	1,196	35%	1,915	2,280	19%

Scotiabank Otros Ingresos/Egresos de la Operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%	30 jun 2020	30 jun 2021	A/A Δ%
Otras Recuperaciones	-	-	6	0%	3	6	100%
Gastos por Adquisición de Cartera de Crédito	(3)	(2)	-	100%	(10)	(2)	80%
Castigos y Quebrantos	(61)	(195)	(87)	-43%	(199)	(282)	-42%
Resultado neto por Venta de Bienes Adjudicados	12	55	33	>+100%	38	88	>+100%
Intereses por Préstamos a Empleados	1	1	-	-100%	2	1	-50%
Ingresos por Arrendamiento	21	19	19	-10%	42	38	-10%
Otras partidas de los Ingresos/Egresos de la operación	541	587	604	12%	1,130	1,191	5%
Pérdida por Cesión de Cartera de Crédito	(123)	-	-	100%	(123)	-	100%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	388	465	575	48%	883	1,040	18%

Scotiabank Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%	30 jun 2020	30 jun 2021	A/A Δ%
Gastos de Personal	(92)	(103)	(86)	7%	(167)	(189)	-13%
Gastos de Operación	(4,396)	(4,702)	(4,573)	-4%	(8,913)	(9,275)	-4%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,488)	(4,805)	(4,659)	-4%	(9,080)	(9,464)	-4%

En el segundo trimestre de 2021, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$912 millones, una disminución de \$2,145 millones o 70% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a la creación de reservas voluntarias registradas en 2020, así como menores requerimientos en cartera de consumo, automotriz, hipotecaria, comercial, y tarjeta de crédito, en 2021.

Respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra una disminución de \$437 millones o 32%, debido principalmente a menores requerimientos en cartera de consumo, comercial, hipotecaria, automotriz y tarjeta de crédito; compensado parcialmente por una menor liberación de reservas adicionales.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de junio 2021, ascendió a \$2,261 millones, una disminución anual de \$2,799 millones o 55%, debido principalmente a la creación de reservas voluntarias registradas en 2020; así como menores requerimientos en cartera comercial, tarjeta de crédito, consumo y automotriz, en 2021.

Scotiabank Impuestos	3 meses				6 meses		
	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%	30 jun 2020	30 jun 2021	A/A Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)							
Impuesto a la Utilidad Causado	(220)	(456)	(247)	-12%	(1,399)	(703)	50%
Impuesto a la Utilidad Diferido	(172)	160	(380)	>-100%	761	(220)	>-100%
Total de Impuestos a la Utilidad	(392)	(296)	(627)	-60%	(638)	(923)	-45%

En el segundo trimestre de 2021, se registró un impuesto neto a cargo por \$627 millones, un incremento de \$235 millones o 60% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre anterior, el total de impuestos netos incrementó en \$331 millones o 112%, principalmente por una mayor utilidad del periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2021 ascendieron a \$923 millones, un incremento anual de \$285 millones, principalmente a una mayor utilidad del periodo.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%
Disponibilidades, Valores y Derivados	195,736	214,496	248,321	27%
Cartera Vigente	431,937	408,907	395,794	-8%
Cartera Vencida	11,424	15,159	15,533	36%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(14,280)	(17,602)	(16,741)	-17%
Otros Activos	31,090	35,978	41,413	33%
Activo Total	655,907	656,938	684,320	4%
Depósitos	417,452	410,719	437,347	5%
Préstamos bancarios	71,053	62,421	56,310	-21%
Obligaciones Subordinadas	9,046	9,094	9,049	0%
Otros Pasivos	104,157	117,365	121,959	17%
Capital	54,199	57,339	59,655	10%
Total Pasivo y Capital	655,907	656,938	684,320	4%

Al 30 de junio de 2021, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$684,320 millones, un incremento de \$28,413 millones o 4% respecto al cierre de junio de 2020. El incremento anual se debió a un mayor volumen en inversiones en valores gubernamentales, principalmente en títulos de negociación y disponibles para la venta; un incremento en deudores por liquidación de operaciones (Otros activos) y deudores por reporto (Disponibilidades, Valores y Derivados), así como mayores disponibilidades (depósitos en Banco de México); compensados parcialmente por menores volúmenes de cartera de crédito vigente y derivados con fines de negociación (Disponibilidades, Valores y Derivados).

Respecto al cierre del trimestre anterior, los activos totales incrementaron \$27,382 millones o 4%, debido principalmente a un incremento en disponibilidades (depósitos en Banco de México), mayores volúmenes de inversiones en valores gubernamentales en títulos de negociación y deudores por liquidación de operaciones (Otros Activos); compensados parcialmente por menores volúmenes de cartera de crédito vigente.

El total del pasivo ascendió a \$624,665 millones al 30 de junio de 2021, un incremento de \$22,957 millones o 4% respecto al año pasado, debido principalmente a mayores volúmenes en depósitos de clientes, así como valores asignados por liquidar y acreedores por reporto (ambos en Otros Pasivos); compensados parcialmente por un menor volumen en mercado de dinero (Depósitos), préstamos bancarios de largo y corto plazo y derivados (Otros Pasivos).

Respecto al trimestre anterior, el pasivo total incrementó \$25,066 millones o 4%, debido principalmente a mayores volúmenes en depósitos de clientes y valores asignados por liquidar (Otros Pasivos); compensados parcialmente por un menor volumen en acreedores por reporto (Otros Pasivos) y préstamos bancarios de corto plazo.

Scotiabank – Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	41,881	36,196	35,532	-15%
Créditos a la Vivienda	140,237	145,833	149,082	6%
Total Préstamos de Menudeo	182,118	182,029	184,614	1%
Actividad Empresarial o Comercial	201,821	186,316	176,490	-13%
Entidades Financieras	35,152	27,583	23,203	-34%
Entidades Gubernamentales	12,846	12,979	11,487	-11%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	249,819	226,878	211,180	-15%
Total Cartera Vigente	431,937	408,907	395,794	-8%

La cartera vigente de préstamos de menudeo incrementó \$2,496 millones respecto al año pasado y \$2,585 millones o 1% respecto al trimestre anterior. Ambos incrementos se debieron a mayores volúmenes en cartera de vivienda; compensado parcialmente con menores volúmenes en tarjeta de crédito y otros préstamos personales.

El total de préstamos vigentes con entidades comerciales, financieras y gubernamentales mostró una disminución anual de \$38,639 millones o 15% y trimestral de \$15,698 millones o 7%. Ambas disminuciones se debieron principalmente a menores volúmenes en créditos comerciales y entidades financieras.

Scotiabank – Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%
Cartera Vencida	11,424	15,159	15,533	36%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(14,280)	(17,602)	(16,741)	-17%
Cartera Vencida Neta	(2,856)	(2,443)	(1,208)	58%
Cartera Vencida Bruta a Cartera Total	2.58%	3.57%	3.78%	120 pb

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	189,425	198,075	223,677	18%
Público en General	145,815	170,878	174,924	20%
Mercado de Dinero	41,915	8,079	4,801	-89%
Total Depósitos a Plazo	187,730	178,957	179,725	-4%
Títulos de Crédito Emitidos	39,699	33,111	33,336	-16%
Cuenta global de captación sin movimientos	598	576	609	2%
Total de Depósitos	417,452	410,719	437,347	5%

Al 30 de junio de 2021, el total de depósitos se ubica en \$437,347 millones, un incremento de \$19,895 millones o 5% respecto al año pasado. Los depósitos a la vista y ahorro aumentaron \$34,252 millones o 18% y los depósitos a plazo mostraron una disminución de \$8,005 millones o 4%.

Respecto al trimestre anterior, el total de depósitos aumentó \$26,628 millones o 6%, debido principalmente a un incremento en los depósitos a la vista y ahorro.

Los títulos de crédito emitidos mostraron una disminución anual de \$6,363 millones o 16%, debido principalmente al vencimiento de certificados bursátiles. Respecto al trimestre anterior, permanecen sin cambios significativos.

Scotiabank
Composición de Inversiones en Valores
(millones de pesos al 30 de junio de 2021 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Títulos para negociar	68,514	-	13	-	68,527
Sin restricción:	-	-	13	-	13
Restringidos:	68,514	-	-	-	68,514
<i>En operaciones de reporto</i>	51,877	-	-	-	51,877
<i>Préstamos de valores</i>	341	-	-	-	341
<i>Otros</i>	16,296	-	-	-	16,296
Títulos disponibles para la venta	52,910	14,496	-	1,474	68,880
Sin restricción:	50,661	14,496	-	1,474	66,631
Restringidos:	2,249	-	-	-	2,249
<i>En operaciones de reporto</i>	-	-	-	-	-
<i>Otros</i>	2,249	-	-	-	2,249
Títulos conservados a vencimiento	5,093	-	-	-	5,093
Sin restricción	5,093	-	-	-	5,093
Total	126,517	14,496	13	1,474	142,500

Scotiabank
Inversiones en Valores no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-21295	11,938,410,522	4.15%	28	11,906

Scotiabank
Derivados y operaciones de cobertura
(millones de pesos al 30 de junio de 2021; valor razonable)

	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Con fines de Negociación	1,476	1,325	-	-	521	262	302	390	12,641	13,101	-	-	14,940	15,078
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	4,780	5,121	-	-	4,780	5,121

Scotiabank
Montos nacionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2021)

	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	2,594	2,729	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN					-	-	118	118				
Divisas USD	-	-	-	-	4	4	276	276	-	-	-	-
Posición JPY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	5	5	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	483	254	446	111	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	2,352	2,352	-	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	1	1	22,091	22,002	288,378	292,013	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	196	195	1,310	1,774	-	-
CLF Chilena	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Euros									25			
Pesos Colombianos									177,500			
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	45,045	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	408	5	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-

Scotiabank Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos al 30 de junio de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	137,582	38,908	176,490
Créditos a entidades financieras	23,196	7	23,203
Créditos a entidades gubernamentales	11,487	-	11,487
Créditos al consumo	35,532	-	35,532
Créditos a la vivienda	149,052	30	149,082
Total	356,849	38,945	395,794

Scotiabank Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos al 30 de junio de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	5,775	137	5,912
Créditos a entidades financieras	129	-	129
Créditos al consumo	2,155	-	2,155
Créditos a la vivienda	7,275	62	7,337
Total	15,334	199	15,533

Scotiabank
Variaciones de Cartera Vencida
(millones de pesos)

Saldo al 31 de marzo de 2021	15,159
Traspaso de Cartera Vigente a Vencida	2,346
Recuperaciones	(97)
Quitas y Castigos	(1,870)
Fluctuación Tipo de Cambio	(5)
Saldo al 30 de junio de 2021	15,533

Scotiabank
Estimaciones preventivas para riesgos crediticios
(millones de pesos)

Saldo al 31 de marzo de 2021	17,602
Más: Creación de reservas	1,028
Menos: Liberaciones	-
Cancelaciones	-
Adjudicaciones y otros	11
Castigos y quitas	1,859
Comercial	131
Hipotecario	16
Consumo	1,712
Castigos y aplicaciones por programa de apoyo	-
Desliz cambiario	19
Saldo al 30 de junio de 2021	16,741

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

	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021
Cartera Vigente			
Metropolitano	59.2%	57.4%	58.4%
Noroeste – Centro	10.8%	12.1%	12.0%
Norte	15.9%	15.8%	15.3%
Bajío	8.4%	8.7%	8.5%
Sur	5.7%	6.0%	5.8%
Cartera Vencida			
Metropolitano	36.5%	41.3%	41.7%
Noroeste – Centro	23.2%	18.8%	20.9%
Norte	10.8%	10.6%	9.5%
Bajío	9.1%	9.5%	9.1%
Sur	20.4%	19.8%	18.8%

Scotiabank
Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	10,005	18.94%
2	7,322	13.86%
3	6,270	11.87%
4	5,652	10.70%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		23,597

Scotiabank
Calificación de la Cartera Crediticia
Al 30 de junio de 2021
(millones de pesos)

	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	Reservas Preventivas Necesarias			Total Reservas Preventivas
			No Revolventes	Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	312,369	873	101	397	244	1,615
Riesgo A2	63,137	652	32	187	14	885
Riesgo B1	16,263	209	47	65	12	333
Riesgo B2	11,242	119	48	40	54	261
Riesgo B3	11,530	248	17	44	49	358
Riesgo C1	6,565	222	25	93	52	392
Riesgo C2	3,437	50	32	165	194	441
Riesgo D	7,133	841	54	383	1,070	2,348
Riesgo E	8,187	3,055	1,253	938	1,086	6,332
Total	439,863	6,269	1,609	2,312	2,775	12,965
Exceso						3,776
Reservas Constituidas						16,741

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$ -
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	64
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	306
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	<u>3,406</u>
Total	\$ 3,776

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

Scotiabank			
Terminación anticipada de los programas hipotecarios			
Cetes especiales			
(millones de pesos)			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	521	07-jul-22
B4 220804	21,792	3	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,473	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	15,196,430	1,997	

Scotiabank			
Tasas Pagadas en Captación Tradicional			
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)			
	Pesos	Tasa Promedio Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	1.97%	0.04%	-
Depósitos a plazo	3.91%	0.00%	-

Scotiabank						
Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos						
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)						
Vencimiento	Préstamos		Financiamiento		Otros	Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	6,193	8,489	2,934	17,616
Largo	-	1,118	22,500	7,061	-	30,679
Total	-	1,118	28,693	15,550	2,934	48,295
Tasa Promedio	0.00%	4.05%	5.69%	4.51%	4.78%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	5,110	-	27	536	8	5,681
Largo	-	-	-	343	1,991	2,334
Total	5,110	-	27	879	1,999	8,015
Tasa Promedio	0.18%	0.00%	2.36%	0.87%	0.91%	
Total Préstamos Interbancarios	5,110	1,118	28,720	16,429	4,933	56,310

Scotiabank no cuenta con créditos o financiamientos específicos que representen más del 10% de los pasivos que se muestran en sus estados financieros al 30 de junio de 2021.

Scotiabank Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 jun 2020	31 mar 2021	30 jun 2021
Depósitos a la Vista	50.3%	52.6%	55.5%
Metropolitano	26.8%	23.8%	25.1%
Noroeste – Centro	7.2%	10.4%	11.2%
Norte	6.5%	7.4%	8.3%
Bajío	4.8%	5.3%	5.3%
Sur	5.0%	5.7%	5.6%
Depósitos Ventanilla	38.6%	45.3%	43.3%
Metropolitano	16.5%	20.4%	20.2%
Noroeste - Centro	5.2%	5.4%	5.6%
Norte	6.4%	9.4%	8.5%
Bajío	4.0%	4.7%	4.3%
Sur	6.5%	5.4%	4.7%
Total de Captación del Público	88.9%	97.9%	98.8%
Fondeo Profesional	11.1%	2.1%	1.2%

Scotiabank Impuestos Diferidos (millones de pesos al 30 de junio de 2021)	
Pérdida de arrastre fiscal	-
Provisión por perdidas de crédito	4,998
Compensación diferida	(1,044)
Ingresos diferidos	553
Instalaciones y equipos / depreciación	661
Beneficios a los empleados	364
Provisiones	351
Otros	268
Efecto Neto en Diferido	6,151

Al 30 de junio de 2021, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank Resultados por Intermediación (millones de pesos al 30 de junio de 2021)		
	Resultados del periodo por Valuación	Resultados del periodo por Compra - Venta
Inversiones en valores	(8)	232
Operaciones con instrumentos financieros derivados de negociación y cobertura	(746)	364
Divisas y otros	(184)	923
Total	(938)	1,519

Emisión de Certificados Bursátiles

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

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

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

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

**Programa autorizado por la CNBV en septiembre de 2015

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 9-19	1,403,500	25-jul-19	22-jul-21	728	TIE28	140,350,000
BONO SCOTIAB 12-19	514,100	22-nov-19	22-nov-21	731	MSFDVTHY INDEX	51,410,000
BONO SCOTIAB 13-19	663,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	66,320,000
BONO SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB 06-20	6,515,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	651,591,000
BONO SCOTIAB 07-20	7,956,100	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	795,610,000
BONO SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
BONO SCOTIAB 09-20	633,800	28-dic-20	27-dic-21	364	USDMXN	63,380,000
BONO SCOTIAB 01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	23,884,500
BONO SCOTIAB 02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLF)	21,284,500
BONO SCOTIAB 03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	184,522,000
BONO SCOTIAB 04-21	102,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
BONO SCOTIAB 05-21	4,948,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	494,850,000
BONO SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2021						\$2,795,267,000

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 30 de junio de 2021)		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	10,877
2	Resultado de ejercicios anteriores	39,149
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	9,628
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	59,654
7	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)	-
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)	917
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	6,435
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-

J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	6,045
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	390
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común	7,352
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	52,302
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,579
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,579
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el renglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,579
	Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios	
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,579
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	55,881
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	4,629
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	2,067
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	6,696
	Capital de nivel 2: ajustes regulatorios	
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-

57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	6,696
59	Capital total (TC = T1 + T2)	62,577
60	Activos ponderados por riesgo totales	414,135
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	12.63%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	13.49%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.11%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.73%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	5.63%
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
72	Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)	No aplica
73	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
74	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
75	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	2,067
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	2,067
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

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

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

46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental ni en el capital básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57	Suma de los renglones 52 a 56.
58	Renglón 51, menos renglón 57.
59	Renglón 45, más renglón 58.
60	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61	Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62	Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63	Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64	Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67.
65	Reportar 2.5%
66	Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
67	La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68	Renglón 61 menos 7%.
69	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75	El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
77	1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank
Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Disponibilidades	54,565
BG2	Cuentas de Margen	2,674
BG3	Inversiones en valores	142,500
BG4	Deudores por reporto	29,430
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Derivados	19,720
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	76
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	394,586
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	25,377
BG11	Bienes adjudicados (neto)	109
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	1,582
BG13	Inversiones permanentes	3,307
BG14	Activos de larga duración disponibles para la venta	22
BG15	Impuestos y PTU diferidos (neto)	6,239
BG16	Otros activos	5,996
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	437,593
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	56,310
	Valores asignados por liquidar	20,149
BG19	Acreedores por reporto	51,886
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	323
BG22	Derivados	20,199
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	10
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	29,482
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	9,049
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	-
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,528
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	10,877
BG30	Capital ganado	48,777
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	277,164
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	405,026
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	53,003

BG37	Colaterales recibidos por la entidad	38,513
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	323
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	135,674
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	866
BG41	Otras cuentas de registro	1,251,596

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 30 de junio de 2021)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	-	
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	917	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$917
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	2,067	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$2,067
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	6,045	BG 16 Activos Intangibles \$2,905 más Gastos de Instalación \$3,140

21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	390	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 390
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	3,579	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,579
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	4,629	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,629
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
CAPITAL CONTABLE				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	10,877	BG 29 Capital Social \$10,404 más Prima en Venta de Acciones \$473
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	39,149	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$39,149
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	5	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$5
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	9,623	BG 30 Reservas de Capital \$7,060 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$81) más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$992) más Resultado Neto \$3,636
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
CUENTAS DE ORDEN				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	

	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador	
44	Reservas pendientes de constituir	12	-
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	- Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-
48	Derogado		

Scotiabank

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

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

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

Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 30 de junio de 2021)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	32,476	2,598
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,788	143
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	1,521	122
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	32	3
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	1,502	120
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	787	63
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	50	4
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	-	-
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	3	-
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%)	638	51
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,609	369
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	1	-
Grupo III (ponderados al 50%)	222	18
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,049	244
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	392	31
Grupo V (ponderados al 50%)	34	3
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 50%)	29,326	2,346

Grupo VI (ponderados al 75%)	18,864	1,509
Grupo VI (ponderados al 100%)	98,233	7,859
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	239	19
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	9,674	774
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	574	46
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	8,119	650
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	18	1
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	152,466	12,197
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	655	52
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	270	22
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	5,278	422
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,641	291
Grupo IX (ponderados al 100%)	14,805	1,184
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,007	241
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	20	2

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	21,845	1,748
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses		
	29,103	

Categoría Capitalización

Al 30 de junio del 2021, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10% (temporalmente este se ubica en 9.85%, por lo que también se cumple con ese criterio), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

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

Scotiabank Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 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 30 de junio de 2021 fue de \$7.99 MM y su promedio durante el segundo trimestre de 2021 fue de \$9.93 MM mismo que corresponde a un 0.025% del capital neto (\$62,586 MM a junio 2021). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2021 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre junio 2021	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	736,412	751,034
Mercado de Dinero	48,052	56,701
Tipo de cambio		
Cash	119	92
Derivados	127,161	119,852
Capitales		
Derivados	13,700	14,062

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre junio 2021	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	7.49	10.28
Tipo de cambio	1.98	2.77
Capitales	0.00	0.14
VaR Global	7.99	9.93

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 segundo trimestre de 2021 muestra una pérdida máxima de \$171.38 MM. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado “Error de diciembre” y Mexico 1997 por el efecto de la “crisis del Rublo” y la crisis financiera asiática.

Asimismo, mensualmente se realizan pruebas de “backtesting” para comparar las pérdidas y ganancias teóricas y reales con el valor en riesgo observado y, en consecuencia, en su caso calibrar los modelos utilizados. El nivel de eficiencia del modelo se basa en el enfoque establecido por el BIS. Respecto de las pruebas de backtesting, durante el segundo trimestre de 2021, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)²	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	83,862	70,076
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	128,499	125,160

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el segundo trimestre de 2021 de 167.69%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos.

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

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

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

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

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

² Cifras previas al cierre de junio 2021.

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(531)	(564)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(624)	(581)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Títulos Disponibles para la venta	68,880	67,541
Derivados de Cobertura	53,251	54,385

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 junio 2021 y el promedio del segundo trimestre del 2021 fueron \$1,732 MM y \$1,676, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Condiciones del diferimiento.

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

Elegibilidad de clientes.

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

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

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

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

Por lo tanto, las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa inicial para algún portafolio, por lo que se trata de reservas genéricas que se aplican acorde con las necesidades particulares de cada portafolio. El consumo de dichas reservas comenzó durante el primer trimestre y continuó durante el segundo trimestre de 2021; por lo tanto, el monto total de reservas adicionales al cierre de junio 2021 asciende a \$3,393.

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

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 30 de junio 2021)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.4%	3.2%
Consumo	4.5%	11.0%
Cartera Comercial	1.0%	4.7%
Total	1.0%	4.7%

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

Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 30 de junio 2021)	EI ²	PI	SP
Hipotecas	149,082	1.71%	18.90%
Consumo	51,384	5.75%	72.35%
Cartera Comercial	253,160	2.55%	43.31%

*1/ EI calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.
2/ Incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter compañía.*

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

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

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

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

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

Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de junio 2021 y en promedio durante el segundo trimestre de 2021, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.09% y 0.11% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

Metodología general

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

Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

Evaluación de riesgo operacional

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

Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

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

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de abril - junio 2021, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$72.8 MM, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2021 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$223.7 MM, donde \$21.0 MM corresponden a riesgo operacional y \$202.7 MM 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: marzo 2021 - junio 2021

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez³

(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES		
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	125,160.11
SALIDAS DE EFECTIVO		
2 Financiamiento minorista no garantizado	143,645.91	10,799.25
3 Financiamiento estable	71,306.80	3,565.34
4 Financiamiento menos estable	72,339.11	7,233.91
5 Financiamiento mayorista no garantizado	209,075.30	75,148.39
6 Depósitos operacionales	82,379.03	19,278.39
7 Depósitos no operacionales	125,585.03	54,758.75
8 Deuda no garantizada	1,111.25	1,111.25
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	569.16
10 Requerimientos adicionales:	284,660.20	24,176.78
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	9,812.94	5,294.78
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	274,847.26	18,882.01
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	19.02	19.02
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	-	-
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	110,712.61
ENTRADAS DE EFECTIVO		
17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	38,030.07	292.90
18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	36,046.08	21,929.88
19 Otras entradas de efectivo	13,743.64	13,743.64
20 TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	87,819.79	35,966.42
		Importe ajustado
21 TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	125,160.11
22 TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	74,746.19
23 COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	167.69⁴

- (a) *Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.
92 días naturales*
- (b) *Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL) y la evolución de sus principales componentes.*

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

⁴ Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

- **Durante junio 2021, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁵**

- o Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$43,975 MM y depósitos a plazo tradicionales por \$42,503 MM, 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 \$1,615 MM y \$1,732 MM respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$19,401 MM.
- o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$14,263 MM y por operaciones de call money de \$12,315 MM y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,156 MM.
- o Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de \$128,499 MM en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$82,128 MM en títulos de deuda de nivel 1, \$35,244 MM en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIIE, 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 \$7,057 MM y \$4,070 MM en títulos de nivel 2A.

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

Cierre de junio 2021: 181% – cierre de marzo 2021: 150% (incremento: 31%) El coeficiente de cobertura de liquidez aumentó 31% respecto de marzo 2021, esto debido principalmente a:

- o El fondeo tradicional del banco creció en \$25,516 MM, sin embargo, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$11,447 MM, debido a vencimientos en las emisiones de papel de la tesorería.
- o En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$12,335 MM.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un incremento de \$24,757 MM.

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

Evolución de Activos Líquidos T2-2021			
	Abril	Mayo	Junio
Efectivo	5%	5%	5%
Reservas en el Banco Central	21%	20%	27%
Nivel 1	71%	72%	64%
Nivel 2 ^a	3%	4%	4%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

⁵ Salidas y entradas ponderadas para los próximos 30 días considerando los factores definidos en las Disposiciones de Carácter General sobre los requerimientos de Liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple.

⁶ Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

(e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Abril	Mayo	Junio
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	43%	43%	45%
Depósitos a plazo			
Del público en general	36%	36%	35%
Mercado de dinero	2%	2%	1%
Títulos de crédito emitidos	7%	7%	7%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	5%	5%	5%
De largo plazo	7%	7%	7%
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 a las políticas establecidas.

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)	
Exposición Potencial Futura (Junio 2021)	
Con contrato de compensación	1,935
Sin contrato de compensación	6,428
Posibles llamadas de margen (Junio 2021)	
Colateral en Tránsito	61
Downgrade (Junio 2021)	
Baja calificación 3 niveles	1,732

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

Scotiabank Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	736,411.80
Tipo de cambio	127,136.66
Capitales	13,699.75
Total	877,248.21

(g) *El descalce en divisas;*

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

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

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

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

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

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

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Para tener un control sobre el descalce generado por la naturaleza del balance entre activos y pasivos, Scotiabank establece límites para sus brechas de liquidez en diferentes plazos. Asimismo, el banco monitorea las brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días; las brechas incorporan posiciones activas y pasivas del balance, así como posiciones fuera del mismo. Los resultados al cierre de junio 2021 y el promedio del segundo trimestre de 2021 son:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ⁸	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	83,862	70,076
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	128,499	125,160

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

II. Información cualitativa

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

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

⁷ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

⁸ Cifras previas al cierre de junio 2021.

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:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el segundo trimestre de 2021, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del segundo trimestre 2021, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 10).

Posiciones en Acciones

Al cierre de junio de 2021 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$13.09 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.08 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ELEMENT-*	29,999	0.41	0.40	0.01
Scotiabank	Pública	1-LALA-B	120,000	1.97	1.94	0.03
Scotiabank	Pública	1-SITES-B-1	82,691	1.52	1.55	(0.03)
Scotiabank	Pública	1A-BP-N	6,000	3.16	3.24	(0.08)
Scotiabank	Pública	1I-OIH-*	100	0.44	0.42	0.02
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,554	3.42	3.42	-
Scotiabank	Pública	1-GFINBUR-O	110,187	2.17	2.20	(0.03)
Total			350,531	13.09	13.17	(0.08)

Al cierre del segundo trimestre del año 2021, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$4.68 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1ABPN	2,599	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1GMEXICOB	244,063	0.43	(0.09)	0.34
Scotiabank	Pública	1APBRN	36,074	0.26	(0.05)	0.21
Scotiabank	Pública	1BACHOCOB	15,923	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	52,857	0.32	(0.09)	0.23
Scotiabank	Pública	1GFINBURO	974,640	0.73	(0.07)	0.66
Scotiabank	Pública	1ISHV*	11,605	0.25	(0.05)	0.20
Scotiabank	Pública	1CHDRAUIB	792,159	0.79	(0.11)	0.68
Scotiabank	Pública	1IOIH*	800	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	1,801,311	0.51	(0.07)	0.44
Scotiabank	Pública	1KWEB*	711	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	65,698	0.16	-	0.16
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	301,842	0.42	(0.06)	0.36
Scotiabank	Pública	1ALFAA	692,939	0.15	(0.08)	0.07
Scotiabank	Pública	1BIMBOA	170,110	0.06	(0.08)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1AMXL	1,445,000	0.30	(0.17)	0.13
Scotiabank	Pública	1CEMEXCPO	80,476	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1LIVEPOLC1	170,094	0.03	(0.25)	(0.22)
Scotiabank	Pública	1AC*	121,751	0.19	(0.01)	0.18
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	76,298	0.20	-	0.20
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	114,775	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1IEWZ*	8,300	0.24	-	0.24
Scotiabank	Pública	1GCARSOA1	72,128	0.07	(0.04)	0.03
Scotiabank	Pública	1ITWM*	5,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1BRZU*	3,300	0.43	(0.06)	0.37
Scotiabank	Pública	1AFSLY*	2,700	0.27	-	0.27
Scotiabank	Pública	41BSMXB	208,269	0.05	(0.08)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1WALMEX*	32,000	0.03	-	0.03
Total			7,503,422	6.07	(1.39)	4.68

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

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

Al 30 de junio de 2021, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$3.97 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$2.92 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.05 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización					
Por Riesgo General de Mercado	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
	13.12	-	13.12	22.23%	2.92
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	13.12	-	13.12	8.00%	1.05
Índices accionarios	-	-	-	4.00%	-
Requerimiento por riesgos	-	-	-	4.00%	-
			Total Requerimiento de capital		3.97

Anexo 1-O Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	RUBRO	Mar-21	Jun-21
	Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	608,515	637,034
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(8,006)	(7,353)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	600,509	629,681
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados		
4	Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	4,100	3,094
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	2,891	2,894
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)	(6,909)	(4,916)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)		
9	Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)		
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	82	1,072
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	30,890	29,430
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(30,660)	(29,430)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	-
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	230	-
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	270,063	277,164
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(194,813)	(198,560)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	75,250	78,604
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	52,812	55,881
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	676,071	709,357
	Coeficiente de apalancamiento		
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	7.81%	7.88%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-21	Jun-21
1	Activos totales	658,404	686,183
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	(337)	(390)
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	(19,147)	(18,648)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(30,430)	(29,430)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	75,250	78,604
7	Otros ajustes	(7,669)	(6,962)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	676,071	709,357

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-21	Jun-21
1	Activos totales	658,404	686,183
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(19,229)	(19,719)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(30,660)	(29,430)
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	608,515	637,034

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

CONCEPTO/PERIODO	Mar-21	Jun-21	Variación
Capital Básico ^{1/}	52,812	55,881	5.81%
Activos Ajustados ^{2/}	676,071	709,357	4.92%
Razón de Apalancamiento ^{3/}	7.81%	7.88%	0.07%

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 marzo 2021 a junio de 2021.

El indicador se ubicó en 7.88%, 7pb superior respecto al trimestre anterior, debido principalmente a la mejora en el Capital de Nivel 1 por \$3,069 millones (+44 pb); compensada por el incremento de las exposiciones totales por \$33,286 millones (-37 pb).

El Capital de Nivel 1 mostró un incremento trimestral de \$3,069 millones (+44pb) derivado del resultado neto del periodo \$2,024 millones (+30 pb) y menores deducciones de impuestos \$723 millones (+11 pb).

La variación de -37 pb en las exposiciones totales, se debe principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$29,172 millones (-32 pb).

TABLA I.2

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

REFERENCIA	EXPLICACIÓN
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	<p>Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) <i>recibidas</i>, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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. <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	<p>Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.</p> <p>En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.</p>
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

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

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

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

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

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

Fecha de pago

23 de abril de 2013

Importe

\$ 165 millones

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 30 de junio del 2021, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$ 101,448 millones de pesos.
- Disponibilidades en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$56,156 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 30 de junio de 2021, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

Scotiabank	Posición	Posición
<i>(millones de pesos)</i>	(Cierre) ⁹	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	83,862	70,076

⁹ Cifras previas al cierre de junio 2021.

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable			
Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés	Europea	Caps, Floors:	<ul style="list-style-type: none"> Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets. $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$
		Floor:	<ul style="list-style-type: none"> Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet. $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
	Opciones	Binaria	<p>La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:</p> <ul style="list-style-type: none"> Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap). Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).
	IRS		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 que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.	
	Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.	
Forward	Forward OTC	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.	

Instrumentos a Valor Razonable

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

Instrumentos valuados a costo

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

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

i. Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

- Sujetos de Crédito

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

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

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- Idoneidad del Cliente

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

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

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

ii. Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de diciembre 2020 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el cuarto trimestre de 2020 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

Al cierre de junio de 2021 y promedio del segundo trimestre 2021 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹⁰	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	128,499	125,160

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

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

¹⁰ Cifras previas al cierre de junio 2021.

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	83,862	82,130	82,130	82,130
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(1,732)	(1,732)	(1,732)

Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Junio 30 2021:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(48,438.00)	278,244.00	130,312.00	243,240.00	(36,380.00)	(41,892.00)	525,086.00
CCS	11.00	217.00	315.00	1,107.00	187.00	(5.00)	1,832.00
Caps&Floors	(37.00)	(44.00)	1,387.00	(214.00)	1.00	-	1,093.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total Derivatives	(48,464.00)	278,417.00	132,014.00	244,133.00	(36,192.00)	(41,897.00)	528,011.00

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (6.69) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (13.39) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (33.47) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.53	(260.40)	50.00	(26.40)	100.00	(52.80)	200.00	(105.60)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.02)	(0.09)	0.10	-	0.40	(0.01)	1.00	(0.02)
a FX %	Forwards	(3.25)	(66.94)	0.10	(6.69)	0.20	(13.39)	0.50	(33.47)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					(33.09)		(66.20)		(139.09)

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 30 de junio de 2021 (la sensibilidad de las opciones es Back to Back, es decir el riesgo esta cerrado).

	Delta	Vega	Gamma
Options BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options MEXXLF.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

Análisis de Stress

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

	Escenarios a la Baja		
	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options MEXXLF.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options MEXXLF.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	-
Poco Probable	-
Muy poco Probable	-

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

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
C67381	CC Swap	28/05/2021	Buy	A	usd	497,985,269	mxn	20,914,963	usd	
C67384	CC Swap	28/05/2021	Buy	A	usd	20,914,963	usd	497,985,269	mxn	
C67473	CC Swap	29/06/2021	Buy	A	usd	3,574,800,000	mxn	180,000,000	usd	
C67474	CC Swap	29/06/2021	Buy	A	usd	180,000,000	usd	3,574,800,000	mxn	
MN5451	Term Deposit	29/04/2021	Buy	A	mxn	170,500,000	mxn	170,500,000	mxn	
MNF348	Term Deposit	20/06/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
P12525	Cap	12/04/2021	Sell	A	mxn					43,000,000
P12616	Cap	03/05/2021	Sell	A	mxn					850,975
P13164	Cap	20/05/2021	Sell	A	mxn					187,160
P13165	Cap	05/05/2021	Sell	A	mxn					263,437
P13376	Cap	12/04/2021	Buy	A	mxn					43,000,000
P13403	Cap	12/04/2021	Sell	A	mxn					43,000,000
P13478	Cap	27/04/2021	Sell	A	mxn					500,000,000
P13501	Cap	27/04/2021	Buy	A	mxn					500,000,000
P15207	Cap	26/04/2021	Buy	A	mxn					15,000,000
P15208	Cap	26/04/2021	Sell	A	mxn					15,000,000
P16856	Cap	17/05/2021	Sell	A	mxn					37,877,730
P16857	Cap	17/05/2021	Sell	A	mxn					37,877,730
P16858	Cap	17/05/2021	Buy	A	mxn					37,877,730
P16889	Cap	24/05/2021	Sell	A	mxn					15,000,000
P16890	Cap	24/05/2021	Sell	A	mxn					8,000,000
P16891	Cap	24/05/2021	Sell	A	mxn					8,000,000
P16892	Cap	10/06/2021	Sell	A	mxn					30,000,000
P16899	Cap	21/06/2021	Sell	A	mxn					20,000,000
P16953	Cap	14/06/2021	Buy	A	mxn					100,000,000
P16954	Cap	14/06/2021	Sell	A	mxn					100,000,000
P16955	Floor	14/06/2021	Buy	A	mxn					100,000,000
P16956	Floor	14/06/2021	Sell	A	mxn					100,000,000
P16957	Cap	14/06/2021	Sell	A	mxn					20,000,000
P17050	Cap	22/06/2021	Buy	A	mxn					216,666,667
P17051	Cap	22/06/2021	Sell	A	mxn					216,666,667
P17067	Cap	03/06/2021	Sell	A	mxn					20,000,000
P17068	Cap	03/06/2021	Buy	A	mxn					20,000,000
P17175	Cap	31/05/2021	Buy	A	mxn					1,389,294,154
P17176	Cap	31/05/2021	Sell	A	mxn					1,389,294,154
SAP932	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	24,000,000	mxn	24,000,000	mxn	
SAP955	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	24,000,000	mxn	24,000,000	mxn	
SAQ703	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	5,168,624	mxn	5,168,624	mxn	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SAQ710	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	5,168,624	mxn	5,168,624	mxn	
SAR120	SC Swap	14/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SAR123	SC Swap	14/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SAU416	SC Swap	10/04/2021	Buy	A	mxn	6,639,655	mxn	6,639,655	mxn	
SAU494	SC Swap	10/04/2021	Buy	A	mxn	6,639,655	mxn	6,639,655	mxn	
SAY578	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	2,832,744	mxn	2,832,744	mxn	
SAY583	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,379,871	mxn	3,379,871	mxn	
SAY586	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,581,570	mxn	3,581,570	mxn	
SAY642	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	2,832,744	mxn	2,832,744	mxn	
SAY645	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,581,570	mxn	3,581,570	mxn	
SAY646	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,379,871	mxn	3,379,871	mxn	
SBA929	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	2,990,103	mxn	2,990,103	mxn	
SBA993	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	2,990,103	mxn	2,990,103	mxn	
SCB245	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	13,000,000	mxn	13,000,000	mxn	
SCB461	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	13,000,000	mxn	13,000,000	mxn	
SCD643	SC Swap	03/04/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SCD679	SC Swap	03/04/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SCE500	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	7,401,553	mxn	7,401,553	mxn	
SCE511	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	7,401,553	mxn	7,401,553	mxn	
SCE578	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	80,000,000	mxn	80,000,000	mxn	
SCE634	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	80,000,000	mxn	80,000,000	mxn	
SCF397	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	350,000,000	mxn	350,000,000	mxn	
SCG780	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	4,388,779	mxn	4,388,779	mxn	
SCG802	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	4,388,779	mxn	4,388,779	mxn	
SCI498	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,100,216	mxn	3,100,216	mxn	
SCI525	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,100,216	mxn	3,100,216	mxn	
SCK588	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,540,140	mxn	3,540,140	mxn	
SCK606	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,540,140	mxn	3,540,140	mxn	
SCL999	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	1,140,000,000	mxn	1,140,000,000	mxn	
SCM313	SC Swap	21/04/2021	Buy	A	mxn	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	mxn	
SCM601	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SCM725	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,190,090	mxn	3,190,090	mxn	
SCM774	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	3,190,090	mxn	3,190,090	mxn	
SCN930	SC Swap	10/05/2021	Buy	A	mxn	320,000,000	mxn	320,000,000	mxn	
SCO877	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SCQ681	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	5,379,222	mxn	5,379,222	mxn	
SCR105	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	5,379,222	mxn	5,379,222	mxn	
SCS088	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,000,000	mxn	3,000,000	mxn	
SCS106	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	3,000,000	mxn	3,000,000	mxn	
SCV090	SC Swap	27/04/2021	Buy	A	mxn	438,000,000	mxn	438,000,000	mxn	
SCV791	SC Swap	04/05/2021	Buy	A	mxn	445,000,000	mxn	445,000,000	mxn	
SCW753	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	20,000,000,000	mxn	20,000,000,000	mxn	
SCW755	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	20,000,000,000	mxn	20,000,000,000	mxn	
SCW759	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	435,000,000	mxn	435,000,000	mxn	
SCY056	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY112	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY252	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY259	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY482	SC Swap	10/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY538	SC Swap	10/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY666	SC Swap	13/04/2021	Buy	A	usd	7,300,000	usd	7,300,000	usd	
SCY701	SC Swap	13/04/2021	Buy	A	usd	7,300,000	usd	7,300,000	usd	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SCY809	SC Swap	14/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY837	SC Swap	14/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY923	SC Swap	13/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY941	SC Swap	13/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCY996	SC Swap	15/04/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SCZ016	SC Swap	15/04/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SCZ079	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCZ113	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SCZ244	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SCZ245	SC Swap	17/05/2021	Buy	A	mxn	8,400,000	mxn	8,400,000	mxn	
SCZ260	SC Swap	16/04/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SCZ267	SC Swap	17/05/2021	Buy	A	mxn	8,400,000	mxn	8,400,000	mxn	
SCZ867	SC Swap	22/04/2021	Buy	A	mxn	1,500,000	mxn	1,500,000	mxn	
SCZ877	SC Swap	21/05/2021	Buy	A	mxn	1,500,000	mxn	1,500,000	mxn	
SCZ890	SC Swap	21/05/2021	Buy	A	mxn	1,500,000	mxn	1,500,000	mxn	
SCZ895	SC Swap	22/04/2021	Buy	A	mxn	1,500,000	mxn	1,500,000	mxn	
SDA635	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	usd	680,582	usd	680,582	usd	
SDA636	SC Swap	07/05/2021	Buy	A	usd	680,582	usd	680,582	usd	
SDC920	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	mxn	
SDD602	SC Swap	26/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDE179	SC Swap	04/05/2021	Buy	A	mxn	500,000,000	mxn	500,000,000	mxn	
SDE396	SC Swap	09/04/2021	Buy	A	usd	5,000,000	usd	5,000,000	usd	
SDE435	SC Swap	09/04/2021	Buy	A	usd	5,000,000	usd	5,000,000	usd	
SDF583	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	20,000,000,000	mxn	20,000,000,000	mxn	
SDF638	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	20,000,000,000	mxn	20,000,000,000	mxn	
SDG680	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	2,650,000,000	mxn	2,650,000,000	mxn	
SDS131	SC Swap	25/06/2021	Buy	A	usd	8,360,000	usd	8,360,000	usd	
SDS151	SC Swap	28/05/2021	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SDS218	SC Swap	28/06/2021	Buy	A	mxn	8,209,652	mxn	8,209,652	mxn	
SDS246	SC Swap	28/06/2021	Buy	A	mxn	8,209,652	mxn	8,209,652	mxn	
SDS493	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	usd	2,000,000	usd	2,000,000	usd	
SDS545	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	usd	2,000,000	usd	2,000,000	usd	
SDS739	SC Swap	31/05/2021	Buy	A	mxn	225,000,000	mxn	225,000,000	mxn	
SDS835	SC Swap	07/06/2021	Buy	A	mxn	220,000,000	mxn	220,000,000	mxn	
SDS883	SC Swap	16/06/2021	Buy	A	mxn	900,000,000	mxn	900,000,000	mxn	
SDT074	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDT075	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	885,000,000	mxn	885,000,000	mxn	
SDT113	SC Swap	22/06/2021	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SDT117	SC Swap	22/06/2021	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SDT142	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	mxn	
SDT147	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	mxn	
SDT161	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	mxn	
SDT163	SC Swap	24/06/2021	Buy	A	mxn	350,000,000	mxn	350,000,000	mxn	
SDT273	SC Swap	24/06/2021	Buy	A	mxn	1,568,000,000	mxn	1,568,000,000	mxn	
SDT293	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	95,000,000	mxn	95,000,000	mxn	
SDT304	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	95,000,000	mxn	95,000,000	mxn	
SDT305	SC Swap	18/06/2021	Buy	A	mxn	700,000,000	mxn	700,000,000	mxn	
SDT317	SC Swap	18/06/2021	Buy	A	mxn	700,000,000	mxn	700,000,000	mxn	
SDT363	SC Swap	11/06/2021	Buy	A	mxn	162,638,433	mxn	162,638,433	mxn	
SDT583	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDT595	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDT640	SC Swap	10/06/2021	Buy	A	usd	814,496	usd	814,496	usd	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDT680	SC Swap	10/06/2021	Buy	A	usd	814,496	usd	814,496	usd	
SDT744	SC Swap	02/06/2021	Buy	A	mxn	240,000,000	mxn	240,000,000	mxn	
SDT902	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	2,813,780	mxn	2,813,780	mxn	
SDT907	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	2,813,780	mxn	2,813,780	mxn	
SDT946	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	120,000,000	mxn	120,000,000	mxn	
SDT999	SC Swap	18/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDU005	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SDU012	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	4,000,000	mxn	4,000,000	mxn	
SDU035	SC Swap	03/06/2021	Buy	A	mxn	180,000,000	mxn	180,000,000	mxn	
SDU081	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	114,053	mxn	114,053	mxn	
SDU092	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	114,053	mxn	114,053	mxn	
SDU436	SC Swap	04/06/2021	Buy	A	mxn	240,000,000	mxn	240,000,000	mxn	
SDU519	SC Swap	07/06/2021	Buy	A	mxn	600,000,000	mxn	600,000,000	mxn	
SDU570	SC Swap	07/06/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDU576	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU584	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU606	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU618	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU637	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU689	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU715	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU724	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU745	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU763	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	10,000,000	mxn	10,000,000	mxn	
SDU786	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDU801	SC Swap	02/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDU833	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDU847	SC Swap	03/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDU858	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	8,400,000	mxn	8,400,000	mxn	
SDU884	SC Swap	24/05/2021	Buy	A	mxn	8,400,000	mxn	8,400,000	mxn	
SDV116	SC Swap	05/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDV196	SC Swap	05/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDV245	SC Swap	10/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDV302	SC Swap	09/06/2021	Buy	A	mxn	210,000,000	mxn	210,000,000	mxn	
SDV322	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	9,992,000	mxn	9,992,000	mxn	
SDV327	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	1,854,500	mxn	1,854,500	mxn	
SDV360	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	6,821,500	mxn	6,821,500	mxn	
SDV405	SC Swap	09/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDV415	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDV582	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	8,925,110	mxn	8,925,110	mxn	
SDV598	SC Swap	11/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDV641	SC Swap	09/06/2021	Buy	A	mxn	260,000,000	mxn	260,000,000	mxn	
SDV645	SC Swap	17/06/2021	Buy	A	mxn	40,000,000	mxn	40,000,000	mxn	
SDV699	SC Swap	28/05/2021	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SDV707	SC Swap	28/05/2021	Buy	A	mxn	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	mxn	
SDV840	SC Swap	09/06/2021	Buy	A	mxn	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	mxn	
SDV860	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDV912	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDV930	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	8,925,110	mxn	8,925,110	mxn	
SDV974	SC Swap	29/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW014	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW049	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDW083	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	420,000,000	mxn	420,000,000	mxn	
SDW110	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	335,000,000	mxn	335,000,000	mxn	
SDW149	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	415,000,000	mxn	415,000,000	mxn	
SDW251	SC Swap	15/06/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDW289	SC Swap	15/06/2021	Buy	A	mxn	600,000,000	mxn	600,000,000	mxn	
SDW361	SC Swap	16/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW380	SC Swap	16/06/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDW409	SC Swap	16/06/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDW545	SC Swap	14/06/2021	Buy	A	mxn	20,000,000	mxn	20,000,000	mxn	
SDW548	SC Swap	15/06/2021	Buy	A	mxn	27,500,000	mxn	27,500,000	mxn	
SDW578	SC Swap	16/06/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDW583	SC Swap	15/06/2021	Buy	A	mxn	27,500,000	mxn	27,500,000	mxn	
SDW588	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW607	SC Swap	17/06/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SDW610	SC Swap	20/06/2021	Buy	A	mxn	28,312,701	mxn	28,312,701	mxn	
SDW618	SC Swap	20/06/2021	Buy	A	mxn	2,500,000	mxn	2,500,000	mxn	
SDW621	SC Swap	20/06/2021	Buy	A	mxn	28,312,701	mxn	28,312,701	mxn	
SDW630	SC Swap	20/06/2021	Buy	A	mxn	2,500,000	mxn	2,500,000	mxn	
SDW633	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	20,000,000	mxn	20,000,000	mxn	
SDW642	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	20,000,000	mxn	20,000,000	mxn	
SDW662	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SDW686	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SDW691	SC Swap	28/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW699	SC Swap	28/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW709	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	370,000,000	mxn	370,000,000	mxn	
SDW711	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	2,349,000	mxn	2,349,000	mxn	
SDW729	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	2,349,000	mxn	2,349,000	mxn	
SDW742	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	1,800,000	mxn	1,800,000	mxn	
SDW749	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	1,800,000	mxn	1,800,000	mxn	
SDW784	SC Swap	26/05/2021	Buy	A	mxn	410,000,000	mxn	410,000,000	mxn	
SDW813	SC Swap	29/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW818	SC Swap	29/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW917	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SDW931	SC Swap	04/06/2021	Buy	A	mxn	4,316,238	mxn	4,316,238	mxn	
SDW933	SC Swap	21/06/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SDW938	SC Swap	04/06/2021	Buy	A	mxn	4,316,238	mxn	4,316,238	mxn	
SDW993	SC Swap	25/06/2021	Buy	A	usd	8,360,000	usd	8,360,000	usd	
SDX004	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	9,992,000	mxn	9,992,000	mxn	
SDX039	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	1,854,500	mxn	1,854,500	mxn	
SDX142	SC Swap	28/06/2021	Buy	A	mxn	255,000,000	mxn	255,000,000	mxn	
SDX158	SC Swap	30/06/2021	Buy	A	mxn	325,000,000	mxn	325,000,000	mxn	
SDX234	SC Swap	01/06/2021	Buy	A	mxn	6,821,500	mxn	6,821,500	mxn	
SDX445	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	34,200,000	mxn	34,200,000	mxn	
SDX446	SC Swap	23/06/2021	Buy	A	mxn	34,200,000	mxn	34,200,000	mxn	
SU4870	SC Swap	27/04/2021	Buy	A	mxn	110,000,000	mxn	110,000,000	mxn	
SU5051	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU5108	SC Swap	30/04/2021	Buy	A	mxn	43,127,657	mxn	43,127,657	mxn	
SU5310	SC Swap	05/05/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU5408	SC Swap	01/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU5477	SC Swap	01/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU5485	SC Swap	01/04/2021	Buy	A	mxn	300,000,000	mxn	300,000,000	mxn	
SU5493	SC Swap	01/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU5517	SC Swap	05/05/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU5543	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU5552	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU5622	SC Swap	05/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU5631	SC Swap	05/04/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SU5660	SC Swap	05/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU5669	SC Swap	05/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU5976	SC Swap	14/04/2021	Buy	A	mxn	190,000,000	mxn	190,000,000	mxn	
SU5985	SC Swap	14/04/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SU5994	SC Swap	14/04/2021	Buy	A	mxn	190,000,000	mxn	190,000,000	mxn	
SU6013	SC Swap	15/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU6020	SC Swap	15/04/2021	Buy	A	mxn	760,000,000	mxn	760,000,000	mxn	
SU6318	SC Swap	14/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU6414	SC Swap	09/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU6514	SC Swap	22/04/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SU6584	SC Swap	15/04/2021	Buy	A	mxn	170,000,000	mxn	170,000,000	mxn	
SU6587	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU6591	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SU6599	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU6610	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU6620	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU6649	SC Swap	23/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU6689	SC Swap	30/04/2021	Buy	A	usd	700,000	usd	700,000	usd	
SU6731	SC Swap	28/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU6741	SC Swap	28/04/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SU6780	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SU6798	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU6805	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU7011	SC Swap	06/05/2021	Buy	A	mxn	75,000,000	mxn	75,000,000	mxn	
SU7039	SC Swap	10/05/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SU7057	SC Swap	13/05/2021	Buy	A	mxn	11,290,000	mxn	11,290,000	mxn	
SU7184	SC Swap	12/05/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SU7326	SC Swap	28/04/2021	Buy	A	usd	2,000,000	usd	2,000,000	usd	
SU7409	SC Swap	07/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU7413	SC Swap	19/05/2021	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SU7453	SC Swap	21/05/2021	Buy	A	mxn	400,000,000	mxn	400,000,000	mxn	
SU7475	SC Swap	21/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU9192	SC Swap	05/04/2021	Buy	A	mxn	30,000,000	mxn	30,000,000	mxn	
SU9215	SC Swap	14/04/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SU9237	SC Swap	19/04/2021	Buy	A	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SU9587	SC Swap	30/04/2021	Buy	A	usd	700,000	usd	700,000	usd	
SU9590	SC Swap	13/05/2021	Buy	A	mxn	11,290,000	mxn	11,290,000	mxn	
SU9724	SC Swap	28/04/2021	Buy	A	usd	2,000,000	usd	2,000,000	usd	
SV3946	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	170,500,000	mxn	170,500,000	mxn	
SV4006	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	170,500,000	mxn	170,500,000	mxn	
SV4066	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	170,500,000	mxn	170,500,000	mxn	
SW3276	SC Swap	29/04/2021	Buy	A	mxn	293,319,196	mxn	293,319,196	mxn	
SY1315	SC Swap	09/04/2021	Buy	A	mxn	200,000,000	mxn	200,000,000	mxn	
SY2400	SC Swap	20/04/2021	Buy	A	mxn	1,460,000,000	mxn	1,460,000,000	mxn	
SY2425	SC Swap	20/04/2021	Buy	A	mxn	190,000,000	mxn	190,000,000	mxn	
SY3318	SC Swap	27/04/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SY3378	SC Swap	27/04/2021	Buy	A	mxn	150,000,000	mxn	150,000,000	mxn	
SY3941	SC Swap	30/04/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SY4118	SC Swap	30/04/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SY8420	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SY8427	SC Swap	20/05/2021	Buy	A	mxn	15,000,000	mxn	15,000,000	mxn	
SY9539	SC Swap	18/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SZ5667	SC Swap	18/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	
SZ5669	SC Swap	18/05/2021	Buy	A	mxn	100,000,000	mxn	100,000,000	mxn	

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2065511	FX	25,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065513	FX	25,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065515	FX	25,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065517	FX	25,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065531	FX	25,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065533	FX	25,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065535	FX	25,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2065537	FX	25,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066105	FX	70,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066107	FX	70,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066108	FX	70,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066110	FX	70,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066111	FX	70,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066113	FX	70,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066114	FX	70,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066116	FX	70,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066123	FX	70,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066125	FX	70,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066126	FX	70,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066128	FX	70,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066129	FX	70,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066131	FX	70,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066132	FX	70,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066134	FX	70,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066180	FX	150,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066182	FX	150,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066201	FX	150,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066203	FX	150,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066667	FX	25,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066669	FX	25,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066683	FX	25,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066685	FX	25,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066774	FX	100,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2066776	FX	100,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069113	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069115	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069116	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069118	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069122	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069124	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069125	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069127	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069148	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069150	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069151	FX	29,271	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069152	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069154	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069155	FX	29,271	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069272	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069274	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069275	FX	15,837	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069276	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069278	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069279	FX	15,837	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069288	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069290	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069291	FX	15,837	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069292	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069294	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069295	FX	15,837	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069413	FX	250,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069415	FX	250,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069416	FX	250,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069418	FX	250,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069419	FX	250,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069421	FX	250,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069422	FX	250,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069424	FX	250,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069425	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069427	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069428	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069430	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069431	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069433	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069434	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069436	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069437	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069439	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069440	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069442	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069443	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069445	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069446	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069447	FX	250,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069448	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069449	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069451	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069491	FX	250,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069493	FX	250,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069494	FX	250,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069496	FX	250,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069497	FX	250,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069499	FX	250,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069500	FX	250,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069502	FX	250,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069503	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069505	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069506	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069508	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069509	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069511	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069512	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069514	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069515	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2069517	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069518	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069520	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069521	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069523	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069524	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069525	FX	250,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069526	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069527	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069529	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069923	FX	400,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069925	FX	400,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069926	FX	43,064	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069927	FX	400,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069929	FX	400,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069930	FX	43,064	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069931	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069933	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069934	FX	43,064	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069959	FX	400,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069961	FX	400,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069962	FX	43,064	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069963	FX	400,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069965	FX	400,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2069966	FX	43,064	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071513	FX	200,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071515	FX	200,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071516	FX	25,917	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071517	FX	200,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071519	FX	200,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071520	FX	25,917	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071521	FX	200,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071523	FX	200,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071524	FX	25,917	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071525	FX	200,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071527	FX	200,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071528	FX	25,917	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071529	FX	200,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071531	FX	200,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071532	FX	25,917	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071533	FX	200,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071535	FX	200,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071536	FX	25,917	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071537	FX	200,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071539	FX	200,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071540	FX	25,917	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071541	FX	200,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071543	FX	200,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071544	FX	25,917	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071545	FX	200,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071547	FX	200,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071548	FX	25,917	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2071549	FX	200,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071551	FX	200,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071552	FX	25,917	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071553	FX	200,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071555	FX	200,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071556	FX	25,917	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071557	FX	200,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071559	FX	200,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071560	FX	25,917	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071561	FX	200,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071563	FX	200,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071564	FX	25,917	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071621	FX	200,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071623	FX	200,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071624	FX	25,917	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071625	FX	200,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071627	FX	200,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071628	FX	25,917	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071629	FX	200,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071631	FX	200,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071632	FX	25,917	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071633	FX	200,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071635	FX	200,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071636	FX	25,917	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071637	FX	200,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071639	FX	200,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071640	FX	25,917	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071641	FX	200,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071643	FX	200,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071644	FX	25,917	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071645	FX	200,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071647	FX	200,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071648	FX	25,917	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071649	FX	200,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071651	FX	200,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071652	FX	25,917	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071653	FX	200,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071655	FX	200,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071656	FX	25,917	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071657	FX	200,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071659	FX	200,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071660	FX	25,917	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071661	FX	200,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071663	FX	200,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071664	FX	25,917	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071665	FX	200,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071667	FX	200,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071668	FX	25,917	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071669	FX	200,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071671	FX	200,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071672	FX	25,917	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071914	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2071916	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071926	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071928	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071938	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071940	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071950	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2071952	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072025	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072027	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072028	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072030	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072031	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072033	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072055	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072057	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072058	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072060	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072061	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072063	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072097	FX	1,050,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072099	FX	1,050,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072100	FX	1,050,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072102	FX	1,050,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072133	FX	70,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072135	FX	70,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072145	FX	70,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072147	FX	70,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072157	FX	700,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072159	FX	700,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072160	FX	1,425,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072162	FX	1,425,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072163	FX	1,125,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072165	FX	1,125,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072166	FX	700,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072168	FX	700,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072169	FX	1,425,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072171	FX	1,425,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072172	FX	1,125,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072174	FX	1,125,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072187	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072189	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072190	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072192	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072193	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072195	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072217	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072219	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072220	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072222	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072223	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072225	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072287	FX	300,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2072289	FX	300,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072290	FX	31,304	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072291	FX	300,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072293	FX	300,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072294	FX	31,304	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072295	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072297	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072298	FX	31,304	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072735	FX	300,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072737	FX	300,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072738	FX	31,304	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072739	FX	300,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072741	FX	300,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072742	FX	31,304	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072743	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072745	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2072746	FX	31,304	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073639	FX	300,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073641	FX	300,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073642	FX	42,500	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073643	FX	300,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073645	FX	300,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073646	FX	42,500	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073647	FX	300,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073649	FX	300,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073650	FX	42,500	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073651	FX	300,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073653	FX	300,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073654	FX	42,500	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073655	FX	300,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073657	FX	300,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073658	FX	42,500	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073659	FX	300,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073661	FX	300,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073662	FX	42,500	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073663	FX	300,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073665	FX	300,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073666	FX	42,500	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073667	FX	300,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073669	FX	300,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073670	FX	42,500	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073671	FX	300,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073673	FX	300,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073674	FX	42,500	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073675	FX	300,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073677	FX	300,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073678	FX	42,500	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073679	FX	300,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073681	FX	300,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073682	FX	42,500	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073684	FX	300,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073685	FX	300,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2073686	FX	42,500	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073687	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073689	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073690	FX	42,500	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073847	FX	250,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073849	FX	250,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073850	FX	35,833	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073851	FX	250,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073853	FX	250,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073854	FX	35,833	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073855	FX	250,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073857	FX	250,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073858	FX	35,833	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073859	FX	250,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073861	FX	250,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073862	FX	35,833	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073863	FX	250,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073865	FX	250,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073866	FX	35,833	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073867	FX	250,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073869	FX	250,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073870	FX	35,833	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073871	FX	250,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073873	FX	250,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073874	FX	35,833	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073875	FX	250,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073877	FX	250,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073878	FX	35,833	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073879	FX	250,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073881	FX	250,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073882	FX	35,833	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073883	FX	250,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073885	FX	250,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073886	FX	35,833	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073887	FX	250,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073889	FX	250,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073890	FX	35,833	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073892	FX	250,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073893	FX	250,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073894	FX	35,833	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073895	FX	250,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073897	FX	250,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2073898	FX	35,833	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074055	FX	300,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074057	FX	300,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074058	FX	42,500	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074059	FX	300,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074061	FX	300,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074062	FX	42,500	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074063	FX	300,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074065	FX	300,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074066	FX	42,500	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074067	FX	300,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074069	FX	300,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074070	FX	42,500	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074071	FX	300,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074073	FX	300,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074074	FX	42,500	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074075	FX	300,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074077	FX	300,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074078	FX	42,500	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074079	FX	300,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074081	FX	300,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074082	FX	42,500	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074083	FX	300,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074085	FX	300,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074086	FX	42,500	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074087	FX	300,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074089	FX	300,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074090	FX	42,500	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074091	FX	300,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074093	FX	300,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074094	FX	42,500	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074095	FX	300,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074097	FX	300,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074098	FX	42,500	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074100	FX	300,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074101	FX	300,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074102	FX	42,500	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074103	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074105	FX	300,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074106	FX	42,500	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074263	FX	250,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074265	FX	250,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074266	FX	35,833	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074267	FX	250,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074269	FX	250,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074270	FX	35,833	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074271	FX	250,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074273	FX	250,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074274	FX	35,833	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074275	FX	250,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074277	FX	250,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074278	FX	35,833	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074279	FX	250,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074281	FX	250,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074282	FX	35,833	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074283	FX	250,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074285	FX	250,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074286	FX	35,833	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074287	FX	250,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074289	FX	250,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074290	FX	35,833	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074291	FX	250,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074293	FX	250,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074294	FX	35,833	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074295	FX	250,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074297	FX	250,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074298	FX	35,833	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074299	FX	250,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074301	FX	250,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074302	FX	35,833	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074303	FX	250,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074305	FX	250,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074306	FX	35,833	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074308	FX	250,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074309	FX	250,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074310	FX	35,833	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074311	FX	250,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074313	FX	250,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074314	FX	35,833	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074512	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074513	FX	50,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074514	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074515	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074516	FX	50,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074517	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074533	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074534	FX	50,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074535	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074536	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074537	FX	50,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074538	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074618	FX	1,900,000	06-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074619	FX	1,900,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074620	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074621	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074622	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074636	FX	1,900,000	06-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074637	FX	1,900,000	06-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074638	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074639	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074640	FX	1,500,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074641	FX	900,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074643	FX	900,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074644	FX	45,622	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074645	FX	900,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074647	FX	900,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074648	FX	45,622	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074649	FX	900,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074651	FX	900,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074652	FX	45,622	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074673	FX	900,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074675	FX	900,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074676	FX	45,622	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074677	FX	900,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2074679	FX	900,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074680	FX	45,622	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074681	FX	900,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074683	FX	900,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074684	FX	45,622	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074754	FX	300,000	16-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074755	FX	300,000	16-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074758	FX	300,000	16-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074759	FX	300,000	16-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074926	FX	500,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074928	FX	500,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074929	FX	22,196	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074930	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074932	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074933	FX	22,196	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074958	FX	500,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074960	FX	500,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074961	FX	22,196	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074962	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074964	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074965	FX	22,196	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074966	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074968	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2074969	FX	22,196	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075016	FX	650,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075018	FX	650,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075019	FX	39,539	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075020	FX	650,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075022	FX	650,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075023	FX	39,539	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075048	FX	650,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075050	FX	650,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075051	FX	39,539	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075052	FX	650,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075054	FX	650,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075055	FX	39,539	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075056	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075058	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075059	FX	39,539	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075112	FX	300,000	07-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075113	FX	300,000	07-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075114	FX	300,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075115	FX	300,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075116	FX	300,000	07-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075117	FX	300,000	07-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075118	FX	300,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075119	FX	300,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075148	FX	65,000	07-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075149	FX	65,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075151	FX	65,000	14-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075152	FX	65,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075154	FX	65,000	21-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075155	FX	65,000	21-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075157	FX	65,000	28-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075158	FX	65,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075187	FX	65,000	07-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075188	FX	65,000	07-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075190	FX	65,000	14-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075191	FX	65,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075193	FX	65,000	21-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075194	FX	65,000	21-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075196	FX	65,000	28-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075197	FX	65,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075206	FX	60,000,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075208	FX	60,000,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075500	FX	200,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075501	FX	200,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075502	FX	10,821	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075504	FX	200,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075505	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075506	FX	10,821	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075508	FX	200,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075509	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075510	FX	10,821	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075556	FX	200,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075557	FX	200,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075558	FX	10,821	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075560	FX	200,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075561	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075562	FX	10,821	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075564	FX	200,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075565	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075566	FX	10,821	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075679	FX	300,000	09-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075680	FX	300,000	09-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075695	FX	300,000	09-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075696	FX	300,000	09-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075754	FX	50,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075755	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075757	FX	50,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075758	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075759	FX	50,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075760	FX	50,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075761	FX	50,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075763	FX	50,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075764	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075766	FX	50,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075767	FX	50,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075768	FX	50,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075769	FX	50,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075770	FX	50,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075771	FX	50,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075772	FX	50,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075773	FX	50,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075774	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075775	FX	50,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075776	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075777	FX	50,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075778	FX	50,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075779	FX	50,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075781	FX	50,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075782	FX	50,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075784	FX	50,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075785	FX	50,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075786	FX	50,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075787	FX	50,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075788	FX	50,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075790	FX	50,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075791	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075793	FX	50,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075794	FX	50,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075795	FX	50,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075796	FX	50,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075797	FX	50,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075798	FX	50,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075799	FX	50,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075800	FX	50,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075801	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075802	FX	50,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075803	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075804	FX	50,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075805	FX	50,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075806	FX	50,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075812	FX	25,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075813	FX	25,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075814	FX	1,510	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075816	FX	25,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075817	FX	25,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075818	FX	1,510	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075820	FX	25,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075821	FX	25,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075822	FX	1,510	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075836	FX	25,000	13-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075837	FX	25,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075838	FX	1,510	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075840	FX	25,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075841	FX	25,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075842	FX	1,510	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075844	FX	25,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075845	FX	25,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075846	FX	1,510	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075922	FX	6,500	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075924	FX	6,500	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075925	FX	20,500	15-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075927	FX	20,500	15-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075928	FX	6,500	22-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2075930	FX	6,500	22-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075931	FX	11,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075933	FX	11,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075934	FX	11,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075936	FX	11,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075937	FX	11,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075939	FX	11,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075940	FX	11,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075942	FX	11,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075943	FX	11,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075945	FX	11,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075976	FX	6,500	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075978	FX	6,500	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075979	FX	20,500	15-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075981	FX	20,500	15-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075982	FX	6,500	22-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075984	FX	6,500	22-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075985	FX	11,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075987	FX	11,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075988	FX	11,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075990	FX	11,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075991	FX	11,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075993	FX	11,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075994	FX	11,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075996	FX	11,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075997	FX	11,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2075999	FX	11,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076003	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076004	FX	500,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076005	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076006	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076007	FX	500,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076008	FX	500,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076030	FX	50,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076031	FX	50,000	05-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076032	FX	50,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076033	FX	50,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076034	FX	50,000	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076035	FX	50,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076036	FX	50,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076038	FX	50,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076039	FX	50,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076041	FX	50,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076063	FX	50,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076064	FX	50,000	05-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076065	FX	50,000	05-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076066	FX	50,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076067	FX	50,000	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076068	FX	50,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076069	FX	50,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076071	FX	50,000	19-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076072	FX	50,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076074	FX	50,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076211	FX	100,000	30-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076212	FX	100,000	30-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076213	FX	100,000	30-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076214	FX	100,000	30-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076215	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076216	FX	100,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076217	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076218	FX	100,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076229	FX	200,000	30-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076230	FX	200,000	30-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076231	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076233	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076234	FX	100,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076236	FX	100,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076243	FX	200,000	30-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076244	FX	200,000	30-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076274	FX	150,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076275	FX	150,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076276	FX	6,553	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076278	FX	150,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076279	FX	150,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076280	FX	6,553	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076282	FX	150,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076283	FX	150,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076284	FX	6,553	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076286	FX	150,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076287	FX	150,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076288	FX	6,553	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076290	FX	150,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076291	FX	150,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076292	FX	6,553	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076294	FX	150,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076295	FX	150,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076296	FX	6,553	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076298	FX	150,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076299	FX	150,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076300	FX	6,553	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076302	FX	150,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076303	FX	150,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076304	FX	6,553	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076306	FX	150,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076307	FX	150,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076308	FX	6,553	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076310	FX	150,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076311	FX	150,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076312	FX	6,553	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076326	FX	150,000	06-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076327	FX	150,000	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076328	FX	6,553	06-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076330	FX	150,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076331	FX	150,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076332	FX	6,553	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076334	FX	150,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076335	FX	150,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076336	FX	6,553	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076338	FX	150,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076339	FX	150,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076340	FX	6,553	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076342	FX	150,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076343	FX	150,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076344	FX	6,553	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076346	FX	150,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076347	FX	150,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076348	FX	6,553	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076350	FX	150,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076351	FX	150,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076352	FX	6,553	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076354	FX	150,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076355	FX	150,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076356	FX	6,553	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076358	FX	150,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076359	FX	150,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076360	FX	6,553	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076362	FX	150,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076363	FX	150,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076364	FX	6,553	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076374	FX	50,000	08-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076375	FX	50,000	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076383	FX	50,000	08-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076384	FX	50,000	08-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076385	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076387	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076388	FX	100,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076390	FX	100,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076397	FX	500,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076398	FX	500,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076399	FX	500,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076400	FX	500,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076404	FX	500,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076405	FX	500,000	09-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076406	FX	500,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076407	FX	500,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076408	FX	500,000	09-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076409	FX	500,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076411	FX	100,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076412	FX	100,000	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076413	FX	5,641	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076415	FX	100,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076416	FX	100,000	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076417	FX	5,641	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076419	FX	100,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076420	FX	100,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076421	FX	5,641	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076427	FX	100,000	12-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076428	FX	100,000	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076429	FX	5,641	12-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076431	FX	100,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076432	FX	100,000	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076433	FX	5,641	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076435	FX	100,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076436	FX	100,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076437	FX	5,641	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076466	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076468	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076469	FX	29,271	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076470	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076472	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076473	FX	29,271	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076500	FX	2,000,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076502	FX	2,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076513	FX	300,000	30-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076514	FX	300,000	30-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076515	FX	300,000	30-abr-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076516	FX	300,000	30-abr-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076532	FX	1,500,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076546	FX	100,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076550	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076554	FX	100,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076570	FX	100,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076805	FX	500,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076915	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076917	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076918	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076920	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076921	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076923	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076924	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076926	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076927	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076929	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076930	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076931	FX	250,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076932	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076933	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076934	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076935	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076936	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076937	FX	250,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076938	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076939	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076941	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076942	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076944	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077050	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077052	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077053	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077055	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077056	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077058	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077059	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077061	FX	250,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077062	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077064	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077065	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077066	FX	250,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077067	FX	250,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077068	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077069	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077070	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077071	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077072	FX	250,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077073	FX	250,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077074	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077076	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077077	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077079	FX	250,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077090	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077092	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077093	FX	2,817	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077094	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077096	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077097	FX	2,817	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077099	FX	50,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077100	FX	50,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077101	FX	2,817	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077225	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077227	FX	50,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077228	FX	2,817	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077229	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077231	FX	50,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077232	FX	2,817	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077234	FX	50,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077235	FX	50,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077236	FX	2,817	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077257	FX	400,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077259	FX	400,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077260	FX	400,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077262	FX	400,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077263	FX	400,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077265	FX	400,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077266	FX	400,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077268	FX	400,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077269	FX	400,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077271	FX	400,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077272	FX	400,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077274	FX	400,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077275	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077277	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077278	FX	3,147	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077279	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077281	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077282	FX	3,147	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077283	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077285	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077286	FX	3,147	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077299	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077301	FX	50,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077302	FX	3,147	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077303	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077305	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077306	FX	3,147	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077307	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077309	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077310	FX	3,147	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077323	FX	50,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077324	FX	50,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077325	FX	50,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077326	FX	50,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077328	FX	50,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077377	FX	50,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077378	FX	50,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077379	FX	50,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077380	FX	50,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077382	FX	50,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077404	FX	250,000	14-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077405	FX	250,000	14-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077406	FX	250,000	14-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077407	FX	250,000	21-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077408	FX	250,000	21-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077409	FX	250,000	21-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077410	FX	250,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077411	FX	250,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077412	FX	250,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077413	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077414	FX	250,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077415	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077416	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077417	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077418	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077420	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077421	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077422	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077423	FX	250,000	25-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077424	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077431	FX	250,000	14-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077432	FX	250,000	14-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077433	FX	250,000	14-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077434	FX	250,000	21-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077435	FX	250,000	21-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077436	FX	250,000	21-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077437	FX	250,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077438	FX	250,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077439	FX	250,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077440	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077441	FX	250,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077442	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077443	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077444	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077445	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077447	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077448	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077449	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077450	FX	250,000	25-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077451	FX	250,000	25-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077463	FX	100,000	28-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077464	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077465	FX	3,865	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077467	FX	100,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077468	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077469	FX	3,865	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077470	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077472	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077473	FX	3,865	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077487	FX	100,000	28-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077488	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077489	FX	3,865	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077491	FX	100,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077492	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077493	FX	3,865	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077494	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077496	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077497	FX	3,865	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077506	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077508	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077509	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077511	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077512	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077514	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077524	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077526	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077527	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077529	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077530	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077532	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077542	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077544	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077545	FX	6,250	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077546	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077548	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077549	FX	6,250	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077550	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077552	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077553	FX	6,250	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077566	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077568	FX	100,000	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077569	FX	6,250	28-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077570	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077572	FX	100,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077573	FX	6,250	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077574	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077576	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077577	FX	6,250	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077614	FX	50,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077616	FX	50,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077617	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077619	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077620	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077622	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077623	FX	50,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077625	FX	50,000	14-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077626	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077628	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077629	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077631	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077668	FX	36,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077670	FX	36,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077671	FX	36,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077673	FX	36,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077674	FX	36,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077676	FX	36,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077677	FX	36,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077679	FX	36,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077680	FX	36,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077682	FX	36,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077683	FX	36,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077685	FX	36,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077686	FX	36,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077688	FX	36,000	13-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077689	FX	36,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077691	FX	36,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077692	FX	36,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077694	FX	36,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077695	FX	36,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077697	FX	36,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077698	FX	36,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077700	FX	36,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077701	FX	36,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077703	FX	36,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077705	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077707	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077708	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077710	FX	200,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077765	FX	10,200	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077767	FX	10,200	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077768	FX	10,200	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077770	FX	10,200	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077771	FX	10,200	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077773	FX	10,200	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077774	FX	10,200	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077776	FX	10,200	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077777	FX	10,200	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077779	FX	10,200	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077792	FX	10,200	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077794	FX	10,200	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077795	FX	10,200	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077797	FX	10,200	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077798	FX	10,200	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077800	FX	10,200	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077801	FX	10,200	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077803	FX	10,200	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077804	FX	10,200	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077806	FX	10,200	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077859	FX	135,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077861	FX	135,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077862	FX	135,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077864	FX	135,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077865	FX	135,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077867	FX	135,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077868	FX	100,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077870	FX	100,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077871	FX	100,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077873	FX	100,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077874	FX	100,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077876	FX	100,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077886	FX	35,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077888	FX	35,000	13-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077889	FX	35,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077891	FX	35,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077892	FX	35,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077894	FX	35,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077895	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077897	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077898	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077900	FX	200,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077901	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077902	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077903	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077904	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077905	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077906	FX	1,000,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077934	FX	100,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077936	FX	100,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077937	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077939	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077943	FX	100,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2077945	FX	100,000	29-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077946	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077948	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077953	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077955	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077956	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077958	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077959	FX	40,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077961	FX	40,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077962	FX	40,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077963	FX	40,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077964	FX	40,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077965	FX	40,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077967	FX	40,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077968	FX	40,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077970	FX	40,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077971	FX	40,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077973	FX	40,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077974	FX	40,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077976	FX	40,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077977	FX	40,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077979	FX	40,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077980	FX	40,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077982	FX	40,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077984	FX	40,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077985	FX	40,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077986	FX	40,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077988	FX	40,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077989	FX	40,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077991	FX	40,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077992	FX	40,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077993	FX	40,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077994	FX	40,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077995	FX	40,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077997	FX	40,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2077998	FX	40,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078000	FX	40,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078001	FX	40,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078003	FX	40,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078004	FX	40,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078006	FX	40,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078007	FX	40,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078009	FX	40,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078010	FX	40,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078012	FX	40,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078014	FX	40,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078015	FX	40,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078016	FX	40,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078018	FX	40,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078107	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078109	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078110	FX	4,525	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078111	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078113	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078114	FX	4,525	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078115	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078117	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078118	FX	4,525	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078120	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078121	FX	50,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078122	FX	4,525	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078151	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078153	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078154	FX	4,525	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078155	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078157	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078158	FX	4,525	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078159	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078161	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078162	FX	4,525	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078164	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078165	FX	50,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078166	FX	4,525	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078200	FX	2,000,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078202	FX	2,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078209	FX	65,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078210	FX	65,000	03-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078211	FX	65,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078212	FX	65,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078214	FX	65,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078215	FX	65,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078217	FX	65,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078218	FX	65,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078220	FX	65,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078221	FX	65,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078223	FX	65,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078224	FX	65,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078226	FX	65,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078227	FX	65,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078229	FX	65,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078231	FX	65,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078232	FX	65,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078233	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078235	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078248	FX	65,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078249	FX	65,000	03-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078250	FX	65,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078251	FX	65,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078253	FX	65,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078254	FX	65,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078256	FX	65,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078257	FX	65,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078259	FX	65,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078260	FX	65,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078262	FX	65,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078263	FX	65,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078265	FX	65,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078266	FX	65,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078268	FX	65,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078270	FX	65,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078271	FX	65,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078272	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078274	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078288	FX	65,000	05-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078289	FX	65,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078290	FX	3,906	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078292	FX	65,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078293	FX	65,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078294	FX	3,906	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078295	FX	65,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078297	FX	65,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078298	FX	3,906	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078299	FX	65,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078301	FX	65,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078302	FX	3,906	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078303	FX	65,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078305	FX	65,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078306	FX	3,906	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078307	FX	65,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078309	FX	65,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078310	FX	3,906	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078312	FX	65,000	16-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078313	FX	65,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078314	FX	3,906	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078316	FX	65,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078317	FX	65,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078318	FX	3,906	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078319	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078321	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078322	FX	3,906	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078323	FX	65,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078325	FX	65,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078326	FX	3,906	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078344	FX	65,000	05-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078345	FX	65,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078346	FX	3,906	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078348	FX	65,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078349	FX	65,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078350	FX	3,906	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078351	FX	65,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078353	FX	65,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078354	FX	3,906	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078355	FX	65,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078357	FX	65,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078358	FX	3,906	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078359	FX	65,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078361	FX	65,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078362	FX	3,906	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078363	FX	65,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078365	FX	65,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078366	FX	3,906	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078368	FX	65,000	16-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078369	FX	65,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078370	FX	3,906	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078372	FX	65,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078373	FX	65,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078374	FX	3,906	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078375	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078377	FX	65,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078378	FX	3,906	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078379	FX	65,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078381	FX	65,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078382	FX	3,906	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078402	FX	30,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078405	FX	30,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078415	FX	30,000	20-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078418	FX	30,000	10-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078425	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078427	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078428	FX	4,966	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078429	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078431	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078432	FX	4,966	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078433	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078435	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078436	FX	4,966	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078438	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078439	FX	50,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078440	FX	4,966	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078469	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078471	FX	50,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078472	FX	4,966	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078473	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078475	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078476	FX	4,966	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078477	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078479	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078480	FX	4,966	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078482	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078483	FX	50,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078484	FX	4,966	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078516	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078518	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078612	FX	200,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078613	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078614	FX	10,952	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078616	FX	200,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078617	FX	200,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078618	FX	10,952	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078620	FX	200,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078621	FX	200,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078622	FX	10,952	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078623	FX	200,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078625	FX	200,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078626	FX	10,952	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078628	FX	200,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078629	FX	200,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078630	FX	10,952	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078632	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078633	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078634	FX	10,952	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078635	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078637	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078638	FX	10,952	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078640	FX	200,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078641	FX	200,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078642	FX	10,952	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078644	FX	200,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078645	FX	200,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078646	FX	10,952	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078647	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078649	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078650	FX	10,952	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078704	FX	200,000	27-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078705	FX	200,000	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078706	FX	10,952	27-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078708	FX	200,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078709	FX	200,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078710	FX	10,952	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078712	FX	200,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078713	FX	200,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078714	FX	10,952	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078715	FX	200,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078717	FX	200,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078718	FX	10,952	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078720	FX	200,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078721	FX	200,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078722	FX	10,952	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078724	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078725	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078726	FX	10,952	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078727	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078729	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078730	FX	10,952	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078732	FX	200,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078733	FX	200,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078734	FX	10,952	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078736	FX	200,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078737	FX	200,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078738	FX	10,952	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078739	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078741	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078742	FX	10,952	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078795	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078797	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078798	FX	100,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078800	FX	100,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078810	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078812	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078813	FX	100,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078815	FX	100,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078817	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078818	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078819	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078820	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078821	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078822	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078823	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078824	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078825	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078826	FX	100,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078827	FX	100,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078828	FX	100,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078830	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078834	FX	100,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078849	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078850	FX	250,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078851	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078852	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078853	FX	250,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078854	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078855	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078856	FX	250,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078857	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078858	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078859	FX	250,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078860	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078861	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078862	FX	250,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078863	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078864	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078865	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078866	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078868	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078869	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078873	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078874	FX	250,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078875	FX	250,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078876	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078877	FX	250,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078878	FX	250,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078879	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2078880	FX	250,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078881	FX	250,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078882	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078883	FX	250,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078884	FX	250,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078885	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078886	FX	250,000	04-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078887	FX	250,000	04-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078888	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078889	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078890	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078892	FX	250,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078893	FX	250,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078981	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078982	FX	100,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078983	FX	100,000	27-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2078984	FX	100,000	27-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079001	FX	100,000	30-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079002	FX	100,000	30-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079003	FX	100,000	30-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079004	FX	100,000	30-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079005	FX	100,000	27-may-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079006	FX	100,000	27-may-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079007	FX	100,000	27-may-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079008	FX	100,000	27-may-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079081	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079083	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079086	FX	100,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079087	FX	100,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079097	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079099	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079102	FX	100,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079103	FX	100,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079113	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079115	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079117	FX	100,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079125	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079127	FX	100,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079129	FX	100,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079137	FX	1,000,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079138	FX	1,000,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079139	FX	1,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079140	FX	1,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079141	FX	1,000,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079142	FX	1,000,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079143	FX	1,000,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079144	FX	1,000,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079145	FX	1,000,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079146	FX	1,000,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079147	FX	1,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079148	FX	1,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079149	FX	1,000,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2079150	FX	1,000,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079151	FX	1,000,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079152	FX	1,000,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079154	FX	50,000	05-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079155	FX	50,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079157	FX	50,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079158	FX	50,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079159	FX	50,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079161	FX	50,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079162	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079164	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079165	FX	50,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079167	FX	50,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079168	FX	50,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079170	FX	50,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079171	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079172	FX	50,000	16-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079173	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079175	FX	50,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079176	FX	50,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079177	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079179	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079180	FX	50,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079182	FX	50,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079193	FX	50,000	05-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079194	FX	50,000	05-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079196	FX	50,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079197	FX	50,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079198	FX	50,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079200	FX	50,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079201	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079203	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079204	FX	50,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079206	FX	50,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079207	FX	50,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079209	FX	50,000	09-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079210	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079211	FX	50,000	16-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079212	FX	50,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079214	FX	50,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079215	FX	50,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079216	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079218	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079219	FX	50,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079221	FX	50,000	30-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079232	FX	500,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079233	FX	500,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079235	FX	500,000	23-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079236	FX	500,000	23-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079245	FX	50,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079246	FX	50,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079247	FX	50,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2079253	FX	50,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079254	FX	50,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079255	FX	50,000	24-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079261	FX	250,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079262	FX	250,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079263	FX	250,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079264	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079265	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079266	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079279	FX	250,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079280	FX	250,000	12-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079281	FX	250,000	12-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079282	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079283	FX	250,000	11-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079284	FX	250,000	11-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079350	FX	315,000	26-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079351	FX	315,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079352	FX	18,237	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079354	FX	315,000	03-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079355	FX	315,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079356	FX	18,237	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079358	FX	315,000	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079359	FX	315,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079360	FX	18,237	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079362	FX	315,000	17-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079363	FX	315,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079364	FX	18,237	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079366	FX	315,000	24-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079367	FX	315,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079368	FX	18,237	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079370	FX	315,000	28-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079371	FX	315,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079372	FX	18,237	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079374	FX	315,000	07-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079375	FX	315,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079376	FX	18,237	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079378	FX	315,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079379	FX	315,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079380	FX	18,237	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079382	FX	315,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079383	FX	315,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079384	FX	18,237	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079386	FX	315,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079387	FX	315,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079388	FX	18,237	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079494	FX	17,000	26-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079495	FX	17,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079496	FX	984	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079498	FX	17,000	03-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079499	FX	17,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079500	FX	984	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079502	FX	17,000	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2079503	FX	17,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079504	FX	984	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079506	FX	17,000	17-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079507	FX	17,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079508	FX	984	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079510	FX	17,000	24-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079511	FX	17,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079512	FX	984	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079514	FX	17,000	28-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079515	FX	17,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079516	FX	984	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079518	FX	17,000	07-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079519	FX	17,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079520	FX	984	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079522	FX	17,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079523	FX	17,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079524	FX	984	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079526	FX	17,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079527	FX	17,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079528	FX	984	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079530	FX	17,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079531	FX	17,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079532	FX	984	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079638	FX	332,000	26-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079639	FX	332,000	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079640	FX	19,221	26-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079642	FX	332,000	03-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079643	FX	332,000	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079644	FX	19,221	03-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079646	FX	332,000	10-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079647	FX	332,000	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079648	FX	19,221	10-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079650	FX	332,000	17-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079651	FX	332,000	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079652	FX	19,221	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079654	FX	332,000	24-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079655	FX	332,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079656	FX	19,221	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079658	FX	332,000	28-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079659	FX	332,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079660	FX	19,221	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079662	FX	332,000	07-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079663	FX	332,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079664	FX	19,221	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079666	FX	332,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079667	FX	332,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079668	FX	19,221	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079670	FX	332,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079671	FX	332,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079672	FX	19,221	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079674	FX	332,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079675	FX	332,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2079676	FX	19,221	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079811	FX	1,000,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079812	FX	1,000,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079813	FX	1,000,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079814	FX	500,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079815	FX	500,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079816	FX	500,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079818	FX	500,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079819	FX	500,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079821	FX	500,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079822	FX	500,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079823	FX	1,000,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079824	FX	1,000,000	11-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079825	FX	1,000,000	11-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079826	FX	500,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079827	FX	500,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079828	FX	500,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079830	FX	500,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079831	FX	500,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079833	FX	500,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079834	FX	500,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079974	FX	200,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079975	FX	200,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079976	FX	10,145	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079978	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079979	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079980	FX	10,145	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079982	FX	200,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079983	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079984	FX	10,145	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079986	FX	200,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079987	FX	200,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079988	FX	10,145	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079990	FX	200,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079991	FX	200,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079992	FX	10,145	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079994	FX	200,000	29-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079995	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2079996	FX	10,145	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080158	FX	200,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080159	FX	200,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080160	FX	10,145	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080162	FX	200,000	01-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080163	FX	200,000	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080164	FX	10,145	01-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080166	FX	200,000	08-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080167	FX	200,000	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080168	FX	10,145	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080170	FX	200,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080171	FX	200,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080172	FX	10,145	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080174	FX	200,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2080175	FX	200,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080176	FX	10,145	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080178	FX	200,000	29-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080179	FX	200,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080180	FX	10,145	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080250	FX	1,500,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080253	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080254	FX	50,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080255	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080256	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080258	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080271	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080272	FX	50,000	26-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080273	FX	50,000	26-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080274	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080276	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080289	FX	4,348	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080290	FX	4,348	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080293	FX	4,348	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080294	FX	4,348	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080307	FX	500,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080308	FX	500,000	19-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080309	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080310	FX	500,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080311	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080357	FX	500,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080358	FX	500,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080360	FX	500,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080361	FX	500,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080362	FX	500,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080363	FX	500,000	29-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080364	FX	500,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080366	FX	500,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080367	FX	500,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080369	FX	500,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080370	FX	500,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080371	FX	500,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080372	FX	500,000	29-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080373	FX	500,000	29-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080375	FX	100,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080376	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080377	FX	4,843	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080399	FX	100,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080400	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080401	FX	4,843	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080423	FX	100,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080424	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080425	FX	4,843	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080447	FX	100,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080448	FX	100,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080449	FX	4,843	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080519	FX	50,000	24-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2080520	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080522	FX	50,000	28-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080523	FX	50,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080524	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080526	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080528	FX	50,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080529	FX	50,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080531	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080533	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080535	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080549	FX	50,000	24-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080550	FX	50,000	24-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080552	FX	50,000	28-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080553	FX	50,000	28-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080554	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080556	FX	50,000	07-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080558	FX	50,000	14-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080559	FX	50,000	14-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080561	FX	50,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080563	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080565	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080578	FX	500,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080580	FX	500,000	19-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080662	FX	50,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080663	FX	50,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080664	FX	1,976	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080690	FX	50,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080691	FX	50,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080692	FX	1,976	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080729	FX	1,017,454	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080731	FX	1,017,454	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080735	FX	1,017,454	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080737	FX	1,017,454	08-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080742	FX	600,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080743	FX	600,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080744	FX	27,536	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080754	FX	600,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080755	FX	600,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080756	FX	27,536	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080767	FX	100,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080768	FX	100,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080769	FX	4,824	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080791	FX	100,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080792	FX	100,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080793	FX	4,824	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080814	FX	500,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080815	FX	500,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080816	FX	500,000	18-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080817	FX	500,000	18-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080967	FX	500,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080971	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080972	FX	500,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2080973	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081023	FX	50,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081024	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081025	FX	1,542	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081047	FX	50,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081048	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081049	FX	1,542	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081513	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081514	FX	50,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081515	FX	2,296	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081537	FX	50,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081538	FX	50,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081539	FX	2,296	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081596	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081598	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081623	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081625	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081626	FX	43,064	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081635	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081637	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081638	FX	39,539	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081639	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081641	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081642	FX	22,196	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031203465	FWD	EURMXN	04/06/2021	230,000	24.84458	(5,714,254)
2021030203423	FWD	EURMXN	04/14/2021	145,000	25.02461	(3,628,569)
2021030203538	FWD	EURMXN	04/14/2021	(102)	25.02477	2,556
2020110603564	FWD	EURMXN	04/30/2021	200,000	24.96623	(4,993,247)
2020110603544	FWD	EURMXN	04/30/2021	(100,000)	25.0481	2,504,810
2020110603550	FWD	EURMXN	04/30/2021	(100,000)	25.0481	2,504,810
2020110603566	FWD	EURMXN	05/28/2021	200,000	25.06345	(5,012,691)
2020110603546	FWD	EURMXN	05/28/2021	(100,000)	25.1442	2,514,420
2020110603551	FWD	EURMXN	05/28/2021	(100,000)	25.1442	2,514,420
2020060503354	FWD	EURUSD	06/04/2021	1,000,000	1.1385	(1,138,500)
2020060503439	FWD	EURUSD	06/04/2021	(1,000,000)	1.13864	1,138,641
2021061403267	FWD	EURUSD	06/15/2021	21,118,000	1.212	(25,595,016)
2021061403299	FWD	EURUSD	06/15/2021	1,882,000	1.212	(2,280,984)
2021061403300	FWD	EURUSD	06/15/2021	2,000,000	1.21203	(2,424,060)
2021060703104	FWD	EURMXN	06/22/2021	330,000	24.0766	(7,945,278)
2021051803470	FWD	EURMXN	06/30/2021	134,000	24.37634	(3,266,429)
2021052503491	FWD	EURMXN	06/30/2021	107,000	24.47834	(2,619,183)
2020082803203	FWD	MXNUSD	04/05/2021	(29,155,371)	22.4324	1,299,699
2020082803207	FWD	MXNUSD	04/05/2021	(103,328,790)	22.42945	4,606,837
2020082803211	FWD	MXNUSD	04/05/2021	(20,261,145)	22.42375	903,558
2020082803460	FWD	USDMXN	04/05/2021	(122,002)	22.42144	2,735,467
2020092903463	FWD	USDMXN	04/05/2021	72,489	22.88888	(1,659,197)
2020092903361	FWD	USDMXN	04/05/2021	(6,760,581)	22.59352	152,745,306
2020100903030	FWD	USDMXN	04/05/2021	150,000	21.64684	(3,247,026)
2020100903038	FWD	USDMXN	04/05/2021	(150,000)	21.671	3,250,650
2020102303695	FWD	USDMXN	04/05/2021	125,000	21.25558	(2,656,947)
2020110503348	FWD	USDMXN	04/05/2021	45,000	21.16625	(952,481)
2020110503720	FWD	USDMXN	04/05/2021	(45,000)	21.2721	957,245
2020111903629	FWD	USDMXN	04/05/2021	75,000	20.44369	(1,533,277)
2020120303193	FWD	USDMXN	04/05/2021	100,000	20.11954	(2,011,954)
2020120303076	FWD	USDMXN	04/05/2021	(100,000)	20.197	2,019,700
2021010403125	FWD	USDMXN	04/05/2021	100,000	20.06568	(2,006,568)
2021010403113	FWD	USDMXN	04/05/2021	(100,000)	19.9874	1,998,740
2021020403433	FWD	USDMXN	04/05/2021	(30,000)	20.5554	616,662
2021021203161	FWD	USDMXN	04/05/2021	(50,000)	20.04158	1,002,079
2021022503042	FWD	USDMXN	04/05/2021	550,000	20.75731	(11,416,522)
2021022503479	FWD	USDMXN	04/05/2021	(588)	20.9748	12,324
2021030103163	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.69079	(8,276,318)
2021030103170	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.68426	(122,244)
2021030103284	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.68841	(8,275,364)
2021030103361	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.69524	(122,308)
2021030203279	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,910	20.70071	(8,402,626)
2021030303248	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.94446	(8,377,786)
2021030303250	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	21.00134	(124,117)
2021030403533	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	21.13877	(6,574,159)
2021030403535	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	21.13467	(17,330)
2021030503300	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,000	21.3452	(8,644,807)
2021030503378	FWD	USDMXN	04/05/2021	910	21.32993	(19,410)
2021030803082	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	21.48667	(8,594,670)
2021030803114	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	21.47777	(126,933)
2021030803255	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,910	21.44573	(8,705,036)
2021030903295	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,820	21.28327	(6,636,548)
2021031003396	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	21.038	(6,542,818)
2021031003460	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	20.98495	(17,206)
2021031103236	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,820	20.78468	(6,481,080)
2021031203205	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.78403	(8,313,611)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031203224	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,910	20.78961	(122,866)
2021031203533	FWD	USDMXN	04/05/2021	405,000	20.7751	(8,413,916)
2021031603020	FWD	USDMXN	04/05/2021	910	20.65488	(18,796)
2021031603224	FWD	USDMXN	04/05/2021	311,000	20.61468	(6,411,165)
2021031603225	FWD	USDMXN	04/05/2021	820	20.61154	(16,901)
2021031603488	FWD	USDMXN	04/05/2021	59,120	20.60235	(1,218,015)
2021031703265	FWD	USDMXN	04/05/2021	2,169	20.7201	(44,952)
2021031703126	FWD	USDMXN	04/05/2021	(65,000)	20.73537	1,347,799
2021031703184	FWD	USDMXN	04/05/2021	(55,000)	20.74696	1,141,083
2021031803004	FWD	USDMXN	04/05/2021	(25,000)	20.57776	514,444
2021031803557	FWD	USDMXN	04/05/2021	(4,356)	20.43343	89,014
2021031803675	FWD	USDMXN	04/05/2021	(3,074)	20.50138	63,017
2021031903441	FWD	USDMXN	04/05/2021	(2,955)	20.53614	60,676
2021032203039	FWD	USDMXN	04/05/2021	(110,000)	20.67156	2,273,872
2021032203040	FWD	USDMXN	04/05/2021	(5,000)	20.66735	103,337
2021032203083	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000)	20.59505	411,901
2021032203158	FWD	USDMXN	04/05/2021	(33,000)	20.60035	679,812
2021032203173	FWD	USDMXN	04/05/2021	(1,173)	20.60574	24,172
2021032203255	FWD	USDMXN	04/05/2021	(90,000)	20.59567	1,853,610
2021032203374	FWD	USDMXN	04/05/2021	(892)	20.59805	18,378
2021032303091	FWD	USDMXN	04/05/2021	(15,000)	20.60694	309,104
2021032303194	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000)	20.72188	414,438
2021032303363	FWD	USDMXN	04/05/2021	(17,000)	20.72291	352,290
2021032303386	FWD	USDMXN	04/05/2021	(87)	20.76963	1,797
2021032303464	FWD	USDMXN	04/05/2021	(17,000)	20.78372	353,323
2021032303476	FWD	USDMXN	04/05/2021	(545)	20.79404	11,335
2021032303505	FWD	USDMXN	04/05/2021	(581,000)	20.83336	12,104,179
2021032403389	FWD	USDMXN	04/05/2021	999	20.87255	(20,851)
2021032403244	FWD	USDMXN	04/05/2021	(15,000)	20.81573	312,236
2021032503171	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.84039	(8,336,158)
2021032503243	FWD	USDMXN	04/05/2021	290,000	20.78545	(6,027,781)
2021032503249	FWD	USDMXN	04/05/2021	110,000	20.74606	(2,282,067)
2021032503090	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.79634	8,318,535
2021032503379	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.72412	8,289,648
2021032603193	FWD	USDMXN	04/05/2021	400,000	20.61272	(8,245,088)
2021032603291	FWD	USDMXN	04/05/2021	(400,000)	20.55581	8,222,322
2021032603403	FWD	USDMXN	04/05/2021	(100,000)	20.60459	2,060,459
2021032903199	FWD	USDMXN	04/05/2021	(2,500,000)	20.5963	51,490,750
2021033003440	FWD	USDMXN	04/05/2021	68,000,000	20.5613	(1,398,168,400)
2021033003384	FWD	USDMXN	04/05/2021	(425,165)	20.56755	8,744,611
2021033003468	FWD	USDMXN	04/05/2021	(405,910)	20.56173	8,346,212
2021033103037	FWD	USDMXN	04/05/2021	35,000,000	20.46135	(716,147,250)
2021033103258	FWD	USDMXN	04/05/2021	75,000,000	20.43	(1,532,250,000)
2021033103431	FWD	USDMXN	04/05/2021	6,000,000	20.46	(122,760,000)
2021033103214	FWD	USDMXN	04/05/2021	(8,410,264)	20.4512	172,000,000
2021033103238	FWD	USDMXN	04/05/2021	(11,726,652)	20.4662	240,000,000
2021033103245	FWD	USDMXN	04/05/2021	(30,000,000)	20.461	613,830,000
2021033103247	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000,000)	20.461	409,220,000
2021033103424	FWD	USDMXN	04/05/2021	(3,500,000)	20.472	71,652,000
2021033103447	FWD	USDMXN	04/05/2021	(10,000,000)	20.45	204,500,000
2021040503118	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000,000)	20.28	405,600,000
2021010603220	FWD	USDMXN	04/06/2021	100,000	19.96205	(1,996,205)
2021010603200	FWD	USDMXN	04/06/2021	(100,000)	20.0041	2,000,410
2021012003103	FWD	USDMXN	04/06/2021	398,500	19.74505	(7,868,402)
2021012003122	FWD	USDMXN	04/06/2021	80	19.74899	(1,587)
2021012003245	FWD	USDMXN	04/06/2021	56,753	19.74169	(1,120,400)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012003089	FWD	USDMXN	04/06/2021	(398,580)	19.8157	7,898,149
2021012003222	FWD	USDMXN	04/06/2021	(56,753)	19.8082	1,124,174
2021020303182	FWD	USDMXN	04/06/2021	100,000	20.36671	(2,036,671)
2021020403016	FWD	USDMXN	04/06/2021	(30,000)	20.44695	613,408
2021021003287	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000	20.16088	(1,008,044)
2021021003019	FWD	USDMXN	04/06/2021	(60,000)	20.14278	1,208,567
2021021203598	FWD	USDMXN	04/06/2021	6,500,000	20.06002	(130,390,150)
2021022503043	FWD	USDMXN	04/06/2021	40,000	20.76729	(830,692)
2021022503480	FWD	USDMXN	04/06/2021	(641)	20.98698	13,448
2021030403269	FWD	USDMXN	04/06/2021	1,000,000	20.92396	(20,923,962)
2021030903044	FWD	USDMXN	04/06/2021	20,300	21.34078	(433,218)
2021031703300	FWD	USDMXN	04/06/2021	60,000	20.5631	(1,233,786)
2021031703003	FWD	USDMXN	04/06/2021	(366,000)	20.76989	7,601,781
2021031703183	FWD	USDMXN	04/06/2021	(70,000)	20.74995	1,452,497
2021031703266	FWD	USDMXN	04/06/2021	(224)	20.71873	4,645
2021031703443	FWD	USDMXN	04/06/2021	(60,000)	20.41008	1,224,605
2021032203170	FWD	USDMXN	04/06/2021	(236,000)	20.59968	4,861,526
2021033103448	FWD	USDMXN	04/06/2021	10,000,000	20.4525	(204,525,000)
2021033103293	FWD	USDMXN	04/06/2021	(311,820)	20.43436	6,371,842
2021033103387	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103390	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103392	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103394	FWD	USDMXN	04/06/2021	(150,000)	20.45827	3,068,741
2021033103432	FWD	USDMXN	04/06/2021	(6,000,000)	20.4624	122,774,400
2021040503119	FWD	USDMXN	04/06/2021	20,000,000	20.28232	(405,646,400)
2021040503238	FWD	USDMXN	04/06/2021	(800,000)	20.26547	16,212,379
2021040603524	FWD	USDMXN	04/06/2021	6,000,000	20.19	(121,140,000)
2021040603017	FWD	USDMXN	04/06/2021	(20,000,000)	20.24	404,800,000
2020100503395	FWD	USDMXN	04/07/2021	600,000	21.7808	(13,068,479)
2020100503215	FWD	USDMXN	04/07/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503537	FWD	USDMXN	04/07/2021	900,000	21.13206	(19,018,853)
2020110503393	FWD	USDMXN	04/07/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020112703375	FWD	USDMXN	04/07/2021	200,000	20.36068	(4,072,136)
2020112703415	FWD	USDMXN	04/07/2021	(200,000)	20.36	4,072,000
2021012103086	FWD	USDMXN	04/07/2021	155,000	19.85279	(3,077,183)
2021012103136	FWD	USDMXN	04/07/2021	437	19.85711	(8,687)
2021021903477	FWD	USDMXN	04/07/2021	(100,000)	20.59515	2,059,515
2021022503039	FWD	USDMXN	04/07/2021	330,000	20.7524	(6,848,292)
2021022503564	FWD	USDMXN	04/07/2021	211	20.93136	(4,416)
2021030803162	FWD	USDMXN	04/07/2021	(300,000)	21.61788	6,485,365
2021031103075	FWD	USDMXN	04/07/2021	100,000	20.7975	(2,079,750)
2021031603271	FWD	USDMXN	04/07/2021	(385,000)	20.57252	7,920,421
2021031603416	FWD	USDMXN	04/07/2021	(2,174)	20.60575	44,798
2021031603429	FWD	USDMXN	04/07/2021	(21,339)	20.62565	440,140
2021032403057	FWD	USDMXN	04/07/2021	7,910	20.79411	(164,474)
2021032403040	FWD	USDMXN	04/07/2021	(110,000)	20.87566	2,296,323
2021032903032	FWD	USDMXN	04/07/2021	400,000	20.75076	(8,300,304)
2021032903142	FWD	USDMXN	04/07/2021	(400,000)	20.72785	8,291,139
2021040603018	FWD	USDMXN	04/07/2021	20,000,000	20.2422	(404,844,000)
2021040703032	FWD	USDMXN	04/07/2021	(25,000,000)	20.2	505,000,000
2020061703119	FWD	USDMXN	04/08/2021	(76,121)	23.13218	1,760,851
2020062403117	FWD	USDMXN	04/08/2021	(75,190)	23.39733	1,759,235
2020070603159	FWD	USDMXN	04/08/2021	(67,000)	22.97636	1,539,416
2020070603160	FWD	USDMXN	04/08/2021	(351)	22.98684	8,078
2020070603161	FWD	USDMXN	04/08/2021	(7,821)	22.96102	179,573
2020070603162	FWD	USDMXN	04/08/2021	(1,451)	22.98821	33,351

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020082503340	FWD	USDMXN	04/08/2021	34,000	22.4759	(764,181)
2020082503360	FWD	USDMXN	04/08/2021	(34,000)	22.5432	766,469
2020092903048	FWD	USDMXN	04/08/2021	2,346,055	22.73473	(53,336,927)
2020092903117	FWD	USDMXN	04/08/2021	(2,346,055)	22.73	53,325,830
2020100903354	FWD	USDMXN	04/08/2021	100,000	21.60083	(2,160,083)
2020100903358	FWD	USDMXN	04/08/2021	(100,000)	21.609	2,160,900
2020102303696	FWD	USDMXN	04/08/2021	125,000	21.26301	(2,657,876)
2020120703078	FWD	USDMXN	04/08/2021	200,000	20.0763	(4,015,261)
2020120703079	FWD	USDMXN	04/08/2021	(200,000)	20.112	4,022,400
2021011303312	FWD	USDMXN	04/08/2021	(62,786)	19.97846	1,254,373
2021011503610	FWD	USDMXN	04/08/2021	300,000	19.98126	(5,994,378)
2021011503654	FWD	USDMXN	04/08/2021	(300,000)	19.987	5,996,100
2021011903168	FWD	USDMXN	04/08/2021	15,000,000	19.83566	(297,534,840)
2021012003333	FWD	USDMXN	04/08/2021	100,000	19.73346	(1,973,346)
2021012003288	FWD	USDMXN	04/08/2021	(100,000)	19.7492	1,974,920
2021012703401	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,492)	20.37799	1,253,091
2021020303228	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,616)	20.34635	1,253,667
2021021003392	FWD	USDMXN	04/08/2021	(62,031)	20.13542	1,249,022
2021021703459	FWD	USDMXN	04/08/2021	(61,744)	20.30274	1,253,568
2021022503044	FWD	USDMXN	04/08/2021	40,000	20.77338	(830,935)
2021022503484	FWD	USDMXN	04/08/2021	(658)	20.92411	13,763
2021030103242	FWD	USDMXN	04/08/2021	300,000	20.91297	(6,273,892)
2021030303204	FWD	USDMXN	04/08/2021	(86,533)	20.95091	1,812,947
2021030303650	FWD	USDMXN	04/08/2021	(300,000)	21.02731	6,308,194
2021031003331	FWD	USDMXN	04/08/2021	(86,200)	21.03175	1,812,932
2021031703435	FWD	USDMXN	04/08/2021	200,000	20.56427	(4,112,855)
2021031703515	FWD	USDMXN	04/08/2021	500,000	20.53061	(10,265,305)
2021031903152	FWD	USDMXN	04/08/2021	150,000	20.37536	(3,056,305)
2021032403230	FWD	USDMXN	04/08/2021	(87,069)	20.81165	1,812,055
2021032403440	FWD	USDMXN	04/08/2021	(13,000)	20.91853	271,941
2021032403503	FWD	USDMXN	04/08/2021	(63,300)	20.96108	1,326,836
2021032403523	FWD	USDMXN	04/08/2021	(82,800)	20.9753	1,736,755
2021032403553	FWD	USDMXN	04/08/2021	(55,000)	20.98908	1,154,399
2021032403559	FWD	USDMXN	04/08/2021	(90,000)	20.99258	1,889,332
2021032403562	FWD	USDMXN	04/08/2021	(183,000)	20.98712	3,840,642
2021032503195	FWD	USDMXN	04/08/2021	1,407	20.77863	(29,227)
2021032503201	FWD	USDMXN	04/08/2021	875	20.77589	(18,176)
2021032503185	FWD	USDMXN	04/08/2021	(32,000)	20.77667	664,853
2021032503376	FWD	USDMXN	04/08/2021	(55,000)	20.7383	1,140,607
2021032503445	FWD	USDMXN	04/08/2021	(81)	20.72301	1,678
2021032603195	FWD	USDMXN	04/08/2021	250,000	20.6079	(5,151,976)
2021033003545	FWD	USDMXN	04/08/2021	(243,179)	20.57282	5,002,878
2021040603525	FWD	USDMXN	04/08/2021	(6,000,000)	20.1948	121,168,800
2021040603590	FWD	USDMXN	04/08/2021	(10,000,000)	20.1864	201,864,000
2021040703033	FWD	USDMXN	04/08/2021	25,000,000	20.20218	(505,054,500)
2021040803133	FWD	USDMXN	04/08/2021	4,000,000	20.10604	(80,424,168)
2021040803456	FWD	USDMXN	04/08/2021	4,000,000	20.08	(80,320,000)
2020090903342	FWD	USDMXN	04/09/2021	200,000	21.97151	(4,394,303)
2020090903314	FWD	USDMXN	04/09/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020101403402	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	21.74573	(1,087,286)
2020101403154	FWD	USDMXN	04/09/2021	(50,000)	21.796	1,089,800
2020101603052	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	21.61096	(1,080,548)
2020101603042	FWD	USDMXN	04/09/2021	(50,000)	21.6615	1,083,075
2020101903170	FWD	USDMXN	04/09/2021	100,000	21.55254	(2,155,254)
2020101903165	FWD	USDMXN	04/09/2021	(100,000)	21.5916	2,159,160
2020120403489	FWD	USDMXN	04/09/2021	250,000	20.04847	(5,012,119)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021020403206	FWD	USDMXN	04/09/2021	(250,000)	20.1456	5,036,400
2021022403615	FWD	USDMXN	04/09/2021	(40,000)	20.46313	818,525
2021030903329	FWD	USDMXN	04/09/2021	200,000	21.30291	(4,260,582)
2021031103155	FWD	USDMXN	04/09/2021	500,000	20.79091	(10,395,457)
2021031603490	FWD	USDMXN	04/09/2021	312,720	20.61119	(6,445,540)
2021031903079	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	20.46504	(1,023,252)
2021031903258	FWD	USDMXN	04/09/2021	3,919	20.54951	(80,542)
2021032403564	FWD	USDMXN	04/09/2021	(274,000)	20.98932	5,751,073
2021032503529	FWD	USDMXN	04/09/2021	(166,000)	20.66522	3,430,427
2021032503598	FWD	USDMXN	04/09/2021	(811)	20.72166	16,803
2021032603292	FWD	USDMXN	04/09/2021	50,000	20.62952	(1,031,476)
2021032603069	FWD	USDMXN	04/09/2021	(33,000)	20.59111	679,507
2021032603360	FWD	USDMXN	04/09/2021	(733)	20.60327	15,106
2021032903009	FWD	USDMXN	04/09/2021	(58,000)	20.74513	1,203,218
2021032903334	FWD	USDMXN	04/09/2021	(514)	20.64319	10,605
2021032903374	FWD	USDMXN	04/09/2021	(61,000)	20.64004	1,259,042
2021032903459	FWD	USDMXN	04/09/2021	(13,000)	20.62276	268,096
2021033003202	FWD	USDMXN	04/09/2021	(10,000)	20.62502	206,250
2021033003242	FWD	USDMXN	04/09/2021	(1,083)	20.62458	22,336
2021033003542	FWD	USDMXN	04/09/2021	(243,000)	20.56769	4,997,947
2021033003603	FWD	USDMXN	04/09/2021	(191)	20.58447	3,925
2021040803458	FWD	USDMXN	04/09/2021	2,000,000	20.08	(40,160,000)
2021040803240	FWD	USDMXN	04/09/2021	(50,000,000)	20.08	1,004,000,000
2021040803457	FWD	USDMXN	04/09/2021	(4,000,000)	20.0824	80,329,600
2020121503473	FWD	USDMXN	04/12/2021	250,000	20.2028	(5,050,699)
2020121503459	FWD	USDMXN	04/12/2021	(250,000)	20.201	5,050,250
2020121603224	FWD	USDMXN	04/12/2021	250,000	20.19713	(5,049,283)
2020121603076	FWD	USDMXN	04/12/2021	(250,000)	20.196	5,049,000
2020121703105	FWD	USDMXN	04/12/2021	250,000	20.07287	(5,018,217)
2020121703080	FWD	USDMXN	04/12/2021	(250,000)	20.075	5,018,750
2020122403065	FWD	USDMXN	04/12/2021	300,000	20.11748	(6,035,244)
2020122403067	FWD	USDMXN	04/12/2021	(300,000)	20.1222	6,036,660
2021010403415	FWD	USDMXN	04/12/2021	300,000	20.19519	(6,058,554)
2021010403039	FWD	USDMXN	04/12/2021	(300,000)	19.953	5,985,900
2021010603225	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	19.97079	(3,994,158)
2021010603128	FWD	USDMXN	04/12/2021	(200,000)	19.9865	3,997,300
2021021003300	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	20.16146	(4,032,292)
2021022203321	FWD	USDMXN	04/12/2021	(200,000)	20.7512	4,150,241
2021022603307	FWD	USDMXN	04/12/2021	(50,000)	21.02422	1,051,211
2021031003123	FWD	USDMXN	04/12/2021	200,000	21.075	(4,215,000)
2021031903081	FWD	USDMXN	04/12/2021	400,000	20.47447	(8,189,787)
2021031903259	FWD	USDMXN	04/12/2021	7,392	20.55623	(151,951)
2021032403566	FWD	USDMXN	04/12/2021	(148,000)	20.9959	3,107,393
2021032903383	FWD	USDMXN	04/12/2021	(217,000)	20.64632	4,480,251
2021032903436	FWD	USDMXN	04/12/2021	(1,097)	20.65565	22,664
2021033103093	FWD	USDMXN	04/12/2021	(273,256)	20.44848	5,587,670
2021040803241	FWD	USDMXN	04/12/2021	50,000,000	20.0867	(1,004,335,000)
2021040803550	FWD	USDMXN	04/12/2021	32,967	20.10313	(662,740)
2021041203177	FWD	USDMXN	04/12/2021	(40,000,000)	20.09	803,600,000
2021041203187	FWD	USDMXN	04/12/2021	(3,630,215)	20.109	73,000,000
2021010603221	FWD	USDMXN	04/13/2021	100,000	19.97808	(1,997,808)
2021010603201	FWD	USDMXN	04/13/2021	(100,000)	20.02	2,002,000
2021011903390	FWD	USDMXN	04/13/2021	24,700	19.82521	(489,683)
2021011903365	FWD	USDMXN	04/13/2021	(24,700)	19.893	491,360
2021021203365	FWD	USDMXN	04/13/2021	(1,000,000)	20.07734	20,077,344
2021021203366	FWD	USDMXN	04/13/2021	(287,155)	20.08157	5,766,523

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021703049	FWD	USDMXN	04/13/2021	116,000	20.4304	(2,369,926)
2021021703249	FWD	USDMXN	04/13/2021	570	20.31254	(11,578)
2021022303453	FWD	USDMXN	04/13/2021	44,000	20.64702	(908,469)
2021022403616	FWD	USDMXN	04/13/2021	(25,000)	20.46955	511,739
2021030403560	FWD	USDMXN	04/13/2021	153,489	21.16756	(3,248,981)
2021030403570	FWD	USDMXN	04/13/2021	(306,977)	21.1837	6,502,915
2021030803273	FWD	USDMXN	04/13/2021	12,600,000	21.43527	(270,084,462)
2021031203637	FWD	USDMXN	04/13/2021	21,650	20.803	(450,385)
2021031203410	FWD	USDMXN	04/13/2021	(600,000)	20.81761	12,490,566
2021031803587	FWD	USDMXN	04/13/2021	174,000	20.51303	(3,569,268)
2021031803676	FWD	USDMXN	04/13/2021	259	20.52757	(5,323)
2021033103094	FWD	USDMXN	04/13/2021	(488,000)	20.45061	9,979,898
2021033103306	FWD	USDMXN	04/13/2021	(1,237)	20.45258	25,296
2021033103512	FWD	USDMXN	04/13/2021	(48,000)	20.428	980,544
2021033103526	FWD	USDMXN	04/13/2021	(894)	20.42512	18,263
2021040603152	FWD	USDMXN	04/13/2021	15,000	20.18397	(302,760)
2021040803459	FWD	USDMXN	04/13/2021	(2,000,000)	20.0892	40,178,400
2021041203010	FWD	USDMXN	04/13/2021	2,000,000	20.09	(40,180,000)
2021041203188	FWD	USDMXN	04/13/2021	3,629,836	20.111	(73,000,000)
2021041303062	FWD	USDMXN	04/13/2021	(13,823,968)	20.11	278,000,000
2020022803577	FWD	USDMXN	04/14/2021	100,000	20.4752	(2,047,520)
2020022803527	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	21.11235	2,111,235
2020030903366	FWD	USDMXN	04/14/2021	100,000	22.0585	(2,205,850)
2020030903287	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	22.57854	2,257,854
2020061503289	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	23.22645	2,322,646
2020061503293	FWD	USDMXN	04/14/2021	(8,788)	23.0818	202,839
2020070103282	FWD	USDMXN	04/14/2021	(107,298)	23.55356	2,527,241
2020072803270	FWD	USDMXN	04/14/2021	257,747	22.65405	(5,839,014)
2020072803152	FWD	USDMXN	04/14/2021	(257,747)	22.387	5,770,182
2020100503396	FWD	USDMXN	04/14/2021	600,000	21.79891	(13,079,344)
2020100503216	FWD	USDMXN	04/14/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503538	FWD	USDMXN	04/14/2021	900,000	21.14873	(19,033,854)
2020110503394	FWD	USDMXN	04/14/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020111003505	FWD	USDMXN	04/14/2021	100,000	20.68582	(2,068,582)
2020111003397	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	20.4752	2,047,520
2020122203200	FWD	USDMXN	04/14/2021	(960,500)	20.30497	19,502,926
2021010503299	FWD	USDMXN	04/14/2021	2,500,000	20.11282	(50,282,050)
2021010503301	FWD	USDMXN	04/14/2021	32,742	20.10236	(658,199)
2021011403564	FWD	USDMXN	04/14/2021	120,000	19.9026	(2,388,312)
2021011403658	FWD	USDMXN	04/14/2021	73,682	19.91954	(1,467,714)
2021011403667	FWD	USDMXN	04/14/2021	8,383	19.91328	(166,932)
2021011403369	FWD	USDMXN	04/14/2021	(250,000)	19.896	4,974,000
2021012103406	FWD	USDMXN	04/14/2021	(47,906)	19.92085	954,330
2021012803637	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,645)	20.34972	949,222
2021020203291	FWD	USDMXN	04/14/2021	118,026	20.30654	(2,396,696)
2021020403162	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,534)	20.51573	954,677
2021021803330	FWD	USDMXN	04/14/2021	817,715	20.54162	(16,797,195)
2021021803331	FWD	USDMXN	04/14/2021	15,226	20.52159	(312,471)
2021021803246	FWD	USDMXN	04/14/2021	(46,407)	20.55318	953,814
2021021903478	FWD	USDMXN	04/14/2021	(100,000)	20.61039	2,061,039
2021022503047	FWD	USDMXN	04/14/2021	60,000	20.78495	(1,247,097)
2021022503565	FWD	USDMXN	04/14/2021	6,365	20.94802	(133,340)
2021022603245	FWD	USDMXN	04/14/2021	(60,000)	21.04502	1,262,701
2021030803163	FWD	USDMXN	04/14/2021	(300,000)	21.63407	6,490,221
2021030903613	FWD	USDMXN	04/14/2021	(9,713,585)	21.29827	206,882,560
2021031603364	FWD	USDMXN	04/14/2021	(12,000,000)	20.60443	247,253,208

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031703118	FWD	USDMXN	04/14/2021	(20,000)	20.73794	414,759
2021032603294	FWD	USDMXN	04/14/2021	50,000	20.64093	(1,032,047)
2021040503388	FWD	USDMXN	04/14/2021	200,000	20.31296	(4,062,592)
2021040603304	FWD	USDMXN	04/14/2021	66,000	20.17533	(1,331,572)
2021040603348	FWD	USDMXN	04/14/2021	250,000	20.16476	(5,041,189)
2021040603586	FWD	USDMXN	04/14/2021	5,000,000	20.20474	(101,023,705)
2021040603591	FWD	USDMXN	04/14/2021	10,000,000	20.20001	(202,000,090)
2021040603729	FWD	USDMXN	04/14/2021	15,879	20.21197	(320,941)
2021040603325	FWD	USDMXN	04/14/2021	(132,000)	20.16372	2,661,611
2021040603360	FWD	USDMXN	04/14/2021	(406)	20.17532	8,191
2021040603701	FWD	USDMXN	04/14/2021	(128,000)	20.20719	2,586,521
2021040603707	FWD	USDMXN	04/14/2021	(120,000)	20.20968	2,425,162
2021041203178	FWD	USDMXN	04/14/2021	40,000,000	20.09445	(803,778,000)
2021041303063	FWD	USDMXN	04/14/2021	13,822,456	20.1122	(278,000,000)
2021041403329	FWD	USDMXN	04/14/2021	(15,000,000)	20.03	300,450,000
2020060503007	FWD	USDMXN	04/15/2021	5,000,000	22.55849	(112,792,470)
2020060503023	FWD	USDMXN	04/15/2021	10,000,000	22.4741	(224,741,000)
2020060503006	FWD	USDMXN	04/15/2021	(15,000,000)	22.56	338,400,000
2020060803068	FWD	USDMXN	04/15/2021	3,000,000	21.52137	(64,564,122)
2020060803149	FWD	USDMXN	04/15/2021	3,000,000	22.52137	(67,564,122)
2020060803241	FWD	USDMXN	04/15/2021	(3,000,000)	22.525	67,575,000
2020072103194	FWD	USDMXN	04/15/2021	150,000	23.00414	(3,450,622)
2020072103177	FWD	USDMXN	04/15/2021	(150,000)	22.845	3,426,750
2020090103548	FWD	USDMXN	04/15/2021	34,000	22.26077	(756,866)
2020090103557	FWD	USDMXN	04/15/2021	(34,000)	22.371	760,614
2020090703026	FWD	USDMXN	04/15/2021	300,000	22.13829	(6,641,486)
2020090703028	FWD	USDMXN	04/15/2021	(300,000)	22.16	6,648,000
2020100803299	FWD	USDMXN	04/15/2021	186,000	21.88116	(4,069,896)
2020102303697	FWD	USDMXN	04/15/2021	125,000	21.28034	(2,660,043)
202011903590	FWD	USDMXN	04/15/2021	477,000	20.50491	(9,780,843)
2021011503611	FWD	USDMXN	04/15/2021	300,000	19.99825	(5,999,476)
2021011503656	FWD	USDMXN	04/15/2021	(300,000)	20.01	6,003,000
2021011903501	FWD	USDMXN	04/15/2021	50,000	19.88605	(994,303)
2021011903486	FWD	USDMXN	04/15/2021	(50,000)	19.9325	996,625
2021012003430	FWD	USDMXN	04/15/2021	100,000	19.75716	(1,975,716)
2021012003452	FWD	USDMXN	04/15/2021	(100,000)	19.775	1,977,500
2021012103510	FWD	USDMXN	04/15/2021	125,000	19.94377	(2,492,971)
2021012103474	FWD	USDMXN	04/15/2021	(125,000)	19.9743	2,496,788
2021012203327	FWD	USDMXN	04/15/2021	50,000	20.096	(1,004,800)
2021012203339	FWD	USDMXN	04/15/2021	(50,000)	20.13013	1,006,506
2021021203447	FWD	USDMXN	04/15/2021	500,000	20.05452	(10,027,262)
2021022503049	FWD	USDMXN	04/15/2021	40,000	20.79694	(831,877)
2021022503485	FWD	USDMXN	04/15/2021	(658)	20.93903	13,774
2021022503571	FWD	USDMXN	04/15/2021	(43)	20.97446	912
2021031603574	FWD	USDMXN	04/15/2021	4,283	20.6879	(88,606)
2021031703441	FWD	USDMXN	04/15/2021	6,299	20.43624	(128,726)
2021031703444	FWD	USDMXN	04/15/2021	60,000	20.43269	(1,225,961)
2021031703516	FWD	USDMXN	04/15/2021	500,000	20.50947	(10,254,735)
2021032903396	FWD	USDMXN	04/15/2021	200,000	20.66414	(4,132,827)
2021040603153	FWD	USDMXN	04/15/2021	10,000	20.18851	(201,885)
2021040703091	FWD	USDMXN	04/15/2021	(12,000)	20.1781	242,137
2021040703221	FWD	USDMXN	04/15/2021	(179)	20.20223	3,625
2021040803400	FWD	USDMXN	04/15/2021	250,000	20.12377	(5,030,943)
2021040803033	FWD	USDMXN	04/15/2021	(179,000)	20.10812	3,599,353
2021040803179	FWD	USDMXN	04/15/2021	(48,000)	20.08581	964,119
2021040803552	FWD	USDMXN	04/15/2021	(1,268)	20.10965	25,489

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041203011	FWD	USDMXN	04/15/2021	(2,000,000)	20.0946	40,189,200
2021041403330	FWD	USDMXN	04/15/2021	15,000,000	20.03218	(300,482,700)
2021041403386	FWD	MXNUSD	04/15/2021	200,000,000	20.06516	(9,967,525)
2021041503055	FWD	USDMXN	04/15/2021	2,000,000	19.97	(39,940,000)
2021041503048	FWD	USDMXN	04/15/2021	(15,000,000)	19.965	299,475,000
2020101403403	FWD	USDMXN	04/16/2021	50,000	21.76332	(1,088,166)
2020101403155	FWD	USDMXN	04/16/2021	(50,000)	21.796	1,089,800
2020101603054	FWD	USDMXN	04/16/2021	50,000	21.62839	(1,081,419)
2020101603043	FWD	USDMXN	04/16/2021	(50,000)	21.6615	1,083,075
2020101903171	FWD	USDMXN	04/16/2021	100,000	21.57011	(2,157,011)
2020101903166	FWD	USDMXN	04/16/2021	(100,000)	21.609	2,160,900
2020112403117	FWD	USDMXN	04/16/2021	444,000	20.36543	(9,042,252)
2020112403019	FWD	USDMXN	04/16/2021	(444,000)	20.3646	9,041,882
2020120403495	FWD	USDMXN	04/16/2021	250,000	20.06379	(5,015,948)
2020120403213	FWD	USDMXN	04/16/2021	(250,000)	20.1624	5,040,600
2021021703177	FWD	USDMXN	04/16/2021	(14,000)	20.34148	284,781
2021022303102	FWD	USDMXN	04/16/2021	(60,000)	20.64587	1,238,752
2021022603198	FWD	USDMXN	04/16/2021	(50,000)	21.00845	1,050,422
2021022603241	FWD	USDMXN	04/16/2021	(30,000)	21.05363	631,609
2021022603404	FWD	USDMXN	04/16/2021	(444,000)	21.057	9,349,306
2021030503208	FWD	USDMXN	04/16/2021	(15,000)	21.35872	320,381
2021040503387	FWD	USDMXN	04/16/2021	300,000	20.31748	(6,095,244)
2021040603218	FWD	USDMXN	04/16/2021	100,000	20.17428	(2,017,428)
2021040603477	FWD	USDMXN	04/16/2021	34,054	20.19068	(687,583)
2021040803484	FWD	USDMXN	04/16/2021	(84,000)	20.09557	1,688,028
2021040803553	FWD	USDMXN	04/16/2021	(225)	20.11334	4,534
2021040903007	FWD	USDMXN	04/16/2021	(242,000)	20.21144	4,891,168
2021040903236	FWD	USDMXN	04/16/2021	(471)	20.15757	9,496
2021041403407	FWD	USDMXN	04/16/2021	(100,000)	20.05938	2,005,938
2021041403411	FWD	USDMXN	04/16/2021	(100,000)	20.05948	2,005,948
2021041403415	FWD	USDMXN	04/16/2021	(100,000)	20.05936	2,005,936
2021041503049	FWD	USDMXN	04/16/2021	15,000,000	19.9672	(299,508,000)
2021041603506	FWD	USDMXN	04/16/2021	(20,000,000)	19.9	398,000,000
2021022503051	FWD	USDMXN	04/19/2021	400,000	20.81861	(8,327,446)
2021022503567	FWD	USDMXN	04/19/2021	587	20.97191	(12,320)
2021032603293	FWD	USDMXN	04/19/2021	50,000	20.65226	(1,032,613)
2021041203015	FWD	USDMXN	04/19/2021	(215,000)	20.1169	4,325,134
2021041203190	FWD	USDMXN	04/19/2021	(50,000)	20.11427	1,005,714
2021041203209	FWD	USDMXN	04/19/2021	(71,000)	20.10785	1,427,657
2021041203484	FWD	USDMXN	04/19/2021	(1,991)	20.17707	40,163
2021041503056	FWD	USDMXN	04/19/2021	(2,000,000)	19.9792	39,958,400
2021041503681	FWD	USDMXN	04/19/2021	(100,000)	19.93619	1,993,619
2021041603507	FWD	USDMXN	04/19/2021	20,000,000	19.90673	(398,134,500)
2021041903655	FWD	USDMXN	04/19/2021	1,500,000	19.83	(29,745,000)
2020073003226	FWD	USDMXN	04/20/2021	100,000	22.81	(2,281,000)
2020073003222	FWD	USDMXN	04/20/2021	(100,000)	22.84359	2,284,359
2020110603320	FWD	USDMXN	04/20/2021	1,100,000	20.99443	(23,093,868)
2020110603234	FWD	USDMXN	04/20/2021	(1,100,000)	21.0235	23,125,850
2020120803213	FWD	USDMXN	04/20/2021	100,000	20.00541	(2,000,541)
2020120803109	FWD	USDMXN	04/20/2021	(100,000)	22.81	2,281,000
2021011903269	FWD	USDMXN	04/20/2021	660,000	19.85869	(13,106,733)
2021011903392	FWD	USDMXN	04/20/2021	50	19.8663	(990)
2021022303454	FWD	USDMXN	04/20/2021	24,000	20.66216	(495,892)
2021030103225	FWD	USDMXN	04/20/2021	43,500	20.70445	(900,643)
2021031103548	FWD	USDMXN	04/20/2021	23,500	20.71983	(486,916)
2021031203456	FWD	USDMXN	04/20/2021	500,000	20.80869	(10,404,345)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031603522	FWD	USDMXN	04/20/2021	(55,000)	20.65029	1,135,766
2021031703482	FWD	USDMXN	04/20/2021	39,900	20.43454	(815,338)
2021031703535	FWD	USDMXN	04/20/2021	25,300	20.4506	(517,400)
2021032203363	FWD	USDMXN	04/20/2021	32,500	20.63613	(670,674)
2021032603295	FWD	USDMXN	04/20/2021	50,000	20.65453	(1,032,726)
2021040603154	FWD	USDMXN	04/20/2021	10,000	20.1996	(201,996)
2021040603226	FWD	USDMXN	04/20/2021	100,000	20.17714	(2,017,714)
2021041203257	FWD	USDMXN	04/20/2021	(115,000)	20.12372	2,314,228
2021041203397	FWD	USDMXN	04/20/2021	(24,000)	20.14894	483,574
2021041203493	FWD	USDMXN	04/20/2021	(1,252)	20.17795	25,260
2021041303241	FWD	USDMXN	04/20/2021	500,000	20.07117	(10,035,583)
2021041303326	FWD	USDMXN	04/20/2021	49,052	20.06984	(984,466)
2021041303443	FWD	USDMXN	04/20/2021	(22,000)	20.08635	441,900
2021041303552	FWD	USDMXN	04/20/2021	(763)	20.11664	15,345
2021041603192	FWD	USDMXN	04/20/2021	(440,000)	19.91438	8,762,327
2021041603271	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89367	596,810
2021041603273	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89331	596,799
2021041603276	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89025	596,708
2021041603280	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89007	596,702
2021041603282	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89532	596,860
2021041603284	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.8934	596,802
2021041603286	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89423	596,827
2021041603289	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89573	596,872
2021041603291	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89572	596,872
2021041603300	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89792	596,938
2021041603302	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.8966	596,898
2021041603305	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89724	596,917
2021041603309	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89741	596,922
2021041603311	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89786	596,936
2021041603315	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89748	596,924
2021041603322	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.90019	597,006
2021041603325	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89949	596,985
2021041603328	FWD	USDMXN	04/20/2021	(30,000)	19.89949	596,985
2021041903431	FWD	USDMXN	04/20/2021	(500,000)	19.82853	9,914,264
2021041903656	FWD	USDMXN	04/20/2021	(1,500,000)	19.8323	29,748,450
2021042003563	FWD	USDMXN	04/20/2021	1,000,000	19.98	(19,980,000)
2020100503397	FWD	USDMXN	04/21/2021	600,000	21.81701	(13,090,206)
2020100503217	FWD	USDMXN	04/21/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503539	FWD	USDMXN	04/21/2021	900,000	21.16537	(19,048,835)
2020110503395	FWD	USDMXN	04/21/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021011503208	FWD	USDMXN	04/21/2021	1,193,289	20.08001	(23,961,255)
2021011503097	FWD	USDMXN	04/21/2021	(1,193,289)	20.251	24,165,296
2021012003320	FWD	USDMXN	04/21/2021	927,295	19.79306	(18,354,003)
2021012003341	FWD	USDMXN	04/21/2021	92,598	19.77171	(1,830,819)
2021012003625	FWD	USDMXN	04/21/2021	292,230	19.76341	(5,775,460)
2021012003223	FWD	USDMXN	04/21/2021	(927,295)	19.9662	18,514,557
2021012003567	FWD	USDMXN	04/21/2021	(292,230)	19.9372	5,826,248
2021012103204	FWD	USDMXN	04/21/2021	733,786	19.88791	(14,593,467)
2021012103152	FWD	USDMXN	04/21/2021	(733,786)	20.0648	14,723,269
2021012603492	FWD	USDMXN	04/21/2021	91,035	20.17711	(1,836,823)
2021012703788	FWD	USDMXN	04/21/2021	155,985	20.45873	(3,191,255)
2021020403609	FWD	USDMXN	04/21/2021	2,318,141	20.55253	(47,643,669)
2021021203535	FWD	USDMXN	04/21/2021	109,315	20.091	(2,196,247)
2021021903479	FWD	USDMXN	04/21/2021	(100,000)	20.62562	2,062,562
2021030103166	FWD	USDMXN	04/21/2021	234,801	20.83428	(4,891,910)
2021030303431	FWD	USDMXN	04/21/2021	19,335	21.00983	(406,225)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031003021	FWD	USDMXN	04/21/2021	(20,000)	21.14302	422,860
2021031603028	FWD	USDMXN	04/21/2021	(50,000)	20.67885	1,033,943
2021031903082	FWD	USDMXN	04/21/2021	220,000	20.50413	(4,510,909)
2021031903260	FWD	USDMXN	04/21/2021	2,726	20.57438	(56,088)
2021040603349	FWD	USDMXN	04/21/2021	250,000	20.18038	(5,045,095)
2021041303230	FWD	USDMXN	04/21/2021	(203,000)	20.07165	4,074,546
2021041303294	FWD	USDMXN	04/21/2021	(1,056)	20.06586	21,188
2021041903258	FWD	USDMXN	04/21/2021	(25,000,000)	19.8138	495,345,000
2021041903260	FWD	USDMXN	04/21/2021	(25,000,000)	19.8127	495,317,500
2021042103033	FWD	USDMXN	04/21/2021	(25,000,000)	19.905	497,625,000
2020061003167	FWD	USDMXN	04/22/2021	(77,300)	22.76034	1,759,375
2020061103381	FWD	USDMXN	04/22/2021	(18)	23.49199	433
2020061703120	FWD	USDMXN	04/22/2021	(76,029)	23.17015	1,761,608
2020062403118	FWD	USDMXN	04/22/2021	(75,089)	23.43374	1,759,605
2020071503466	FWD	USDMXN	04/22/2021	(76,095)	23.10109	1,757,876
2020072303334	FWD	USDMXN	04/22/2021	3,600,000	23.18347	(83,460,485)
2020072303296	FWD	USDMXN	04/22/2021	(2,400,000)	23.1377	55,530,480
2020072303303	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,200,000)	23.1377	27,765,240
2020090903471	FWD	USDMXN	04/22/2021	34,000	22.04636	(749,576)
2020090903490	FWD	USDMXN	04/22/2021	(34,000)	22.1229	752,179
2020102303698	FWD	USDMXN	04/22/2021	125,000	21.29768	(2,662,210)
2020120903398	FWD	USDMXN	04/22/2021	40,000	20.24843	(809,937)
2020120903195	FWD	USDMXN	04/22/2021	(40,000)	20.1959	807,836
2021011303415	FWD	USDMXN	04/22/2021	92,800	19.99916	(1,855,922)
2021011303299	FWD	USDMXN	04/22/2021	(125,500)	20.01526	2,511,916
2021011303313	FWD	USDMXN	04/22/2021	(29,986)	20.00936	599,996
2021011503614	FWD	USDMXN	04/22/2021	300,000	20.01457	(6,004,370)
2021011503657	FWD	USDMXN	04/22/2021	(300,000)	20.029	6,008,700
2021012003334	FWD	USDMXN	04/22/2021	100,000	19.76478	(1,976,478)
2021012003302	FWD	USDMXN	04/22/2021	(100,000)	19.781	1,978,100
2021012003465	FWD	USDMXN	04/22/2021	(63,412)	19.78647	1,254,702
2021020303230	FWD	USDMXN	04/22/2021	(61,510)	20.37684	1,253,388
2021021803157	FWD	USDMXN	04/22/2021	(100,000)	20.48674	2,048,674
2021022303103	FWD	USDMXN	04/22/2021	(30,000)	20.65891	619,767
2021022403159	FWD	USDMXN	04/22/2021	(87,777)	20.63319	1,811,130
2021030303215	FWD	USDMXN	04/22/2021	(86,364)	20.99213	1,812,965
2021030403005	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,000,000)	20.9256	20,925,602
2021030503154	FWD	USDMXN	04/22/2021	(500,000)	21.31492	10,657,459
2021031003333	FWD	USDMXN	04/22/2021	(86,110)	21.06026	1,813,492
2021031703436	FWD	USDMXN	04/22/2021	200,000	20.59513	(4,119,026)
2021031703518	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.50473	(10,252,363)
2021031803415	FWD	USDMXN	04/22/2021	64,155	20.44287	(1,311,514)
2021031803622	FWD	USDMXN	04/22/2021	1,500,000	20.49531	(30,742,967)
2021031903083	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.50834	(10,254,168)
2021031903084	FWD	USDMXN	04/22/2021	23,000	20.50896	(471,706)
2021031903153	FWD	USDMXN	04/22/2021	150,000	20.40544	(3,060,817)
2021031903261	FWD	USDMXN	04/22/2021	86	20.57591	(1,771)
2021032403091	FWD	USDMXN	04/22/2021	(500,000)	20.89318	10,446,590
2021032403231	FWD	USDMXN	04/22/2021	(87,015)	20.84254	1,813,611
2021032603196	FWD	USDMXN	04/22/2021	250,000	20.63943	(5,159,857)
2021032603296	FWD	USDMXN	04/22/2021	50,000	20.65899	(1,032,950)
2021033103295	FWD	USDMXN	04/22/2021	200,000	20.48666	(4,097,332)
2021033103384	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	20.56375	(10,281,877)
2021040603155	FWD	USDMXN	04/22/2021	15,000	20.20404	(303,061)
2021040803401	FWD	USDMXN	04/22/2021	250,000	20.15449	(5,038,622)
2021041303249	FWD	USDMXN	04/22/2021	(272,000)	20.07078	5,459,251

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041303297	FWD	USDMXN	04/22/2021	(414)	20.07078	8,303
2021042003414	FWD	USDMXN	04/22/2021	300,000	19.90942	(5,972,826)
2021042003490	FWD	USDMXN	04/22/2021	6,749,563	19.9509	(134,659,855)
2021042003502	FWD	USDMXN	04/22/2021	558,642	19.9477	(11,143,623)
2021042003509	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,117,284)	19.9435	22,282,549
2021042003564	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,000,000)	19.9846	19,984,600
2021042103034	FWD	USDMXN	04/22/2021	25,000,000	19.90718	(497,679,375)
2021042203593	FWD	USDMXN	04/22/2021	500,000	19.96	(9,980,000)
2020042403333	FWD	USDMXN	04/23/2021	10,000,000	26.295	(262,950,000)
2020042403261	FWD	USDMXN	04/23/2021	(10,000,000)	26.205	262,050,000
2020090903343	FWD	USDMXN	04/23/2021	200,000	22.00834	(4,401,669)
2020090903315	FWD	USDMXN	04/23/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020091803221	FWD	USDMXN	04/23/2021	1,000,000	21.52437	(21,524,371)
2020091803192	FWD	USDMXN	04/23/2021	(1,000,000)	21.444	21,444,000
2020101403404	FWD	USDMXN	04/23/2021	50,000	21.78121	(1,089,061)
2020101403157	FWD	USDMXN	04/23/2021	(50,000)	21.796	1,089,800
2020101603053	FWD	USDMXN	04/23/2021	50,000	21.64602	(1,082,301)
2020101603047	FWD	USDMXN	04/23/2021	(50,000)	21.6615	1,083,075
2020120303404	FWD	USDMXN	04/23/2021	1,537,500	20.19818	(31,054,702)
2020120303264	FWD	USDMXN	04/23/2021	(1,537,500)	20.2079	31,069,646
2020120403505	FWD	USDMXN	04/23/2021	250,000	20.07736	(5,019,339)
2020120403221	FWD	USDMXN	04/23/2021	(250,000)	20.1792	5,044,800
2021012003339	FWD	USDMXN	04/23/2021	61,607	19.77624	(1,218,355)
2021021803640	FWD	USDMXN	04/23/2021	(70,000)	20.46087	1,432,261
2021022503052	FWD	USDMXN	04/23/2021	55,000	20.82783	(1,145,531)
2021022503568	FWD	USDMXN	04/23/2021	11,206	20.97101	(235,003)
2021030403433	FWD	USDMXN	04/23/2021	(1,000,000)	21.13524	21,135,243
2021030803181	FWD	USDMXN	04/23/2021	(25,000)	21.48609	537,152
2021030903330	FWD	USDMXN	04/23/2021	200,000	21.33459	(4,266,919)
2021030903055	FWD	USDMXN	04/23/2021	(10,000)	21.35566	213,557
2021031603492	FWD	USDMXN	04/23/2021	87,966	20.64184	(1,815,780)
2021040603059	FWD	USDMXN	04/23/2021	100,000	20.21046	(2,021,046)
2021040603219	FWD	USDMXN	04/23/2021	100,000	20.18978	(2,018,978)
2021040603491	FWD	USDMXN	04/23/2021	310,379	20.18575	(6,265,232)
2021040803435	FWD	USDMXN	04/23/2021	(30,000)	20.11406	603,422
2021041303530	FWD	USDMXN	04/23/2021	312,000	20.13515	(6,282,168)
2021041303553	FWD	USDMXN	04/23/2021	197	20.12811	(3,956)
2021041303259	FWD	USDMXN	04/23/2021	(299,000)	20.07391	6,002,098
2021041303299	FWD	USDMXN	04/23/2021	(625)	20.07314	12,548
2021041303532	FWD	USDMXN	04/23/2021	(344,000)	20.12145	6,921,778
2021041503826	FWD	USDMXN	04/23/2021	1,200,000	19.90521	(23,886,248)
2021042103617	FWD	USDMXN	04/23/2021	(100,000)	19.88795	1,988,795
2021021203391	FWD	USDMXN	04/26/2021	7,215,366	20.09034	(144,959,178)
2021022503053	FWD	USDMXN	04/26/2021	450,000	20.84844	(9,381,798)
2021022503476	FWD	USDMXN	04/26/2021	(11,253)	21.01969	236,537
2021031103599	FWD	USDMXN	04/26/2021	200,000	20.70197	(4,140,395)
2021041403007	FWD	USDMXN	04/26/2021	(100,000)	20.10833	2,010,833
2021041403427	FWD	USDMXN	04/26/2021	(134)	20.07594	2,693
2021042203594	FWD	USDMXN	04/26/2021	(500,000)	19.969	9,984,500
2021042203677	FWD	USDMXN	04/26/2021	(440,000)	19.95141	8,778,620
2020120303600	FWD	USDMXN	04/27/2021	550,000	20.1946	(11,107,028)
2020120303487	FWD	USDMXN	04/27/2021	(550,000)	20.2072	11,113,960
2021012603330	FWD	USDMXN	04/27/2021	11,000	20.20611	(222,267)
2021012603475	FWD	USDMXN	04/27/2021	227	20.19657	(4,577)
2021022603328	FWD	USDMXN	04/27/2021	(50,000)	21.05758	1,052,879
2021031103502	FWD	USDMXN	04/27/2021	(1,900,000)	20.73627	39,398,909

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031203002	FWD	USDMXN	04/27/2021	(30,898)	20.76287	641,522
2021032203386	FWD	USDMXN	04/27/2021	22,550	20.64079	(465,450)
2021032303223	FWD	USDMXN	04/27/2021	19,400	20.74513	(402,456)
2021032503236	FWD	USDMXN	04/27/2021	85,000	20.83479	(1,770,957)
2021032503628	FWD	USDMXN	04/27/2021	38,800	20.74085	(804,745)
2021032603298	FWD	USDMXN	04/27/2021	50,000	20.67015	(1,033,508)
2021032903422	FWD	USDMXN	04/27/2021	87,500	20.67069	(1,808,686)
2021040503468	FWD	USDMXN	04/27/2021	1,627,000	20.40955	(33,206,341)
2021040503487	FWD	USDMXN	04/27/2021	23	20.4005	(468)
2021040603156	FWD	USDMXN	04/27/2021	10,000	20.21507	(202,151)
2021041503821	FWD	USDMXN	04/27/2021	(859,879)	19.94532	17,150,569
2021042003043	FWD	USDMXN	04/27/2021	584,000	19.89339	(11,617,742)
2021042003296	FWD	USDMXN	04/27/2021	2,000,000	19.908	(39,815,994)
2021042003048	FWD	USDMXN	04/27/2021	(530,000)	19.88476	10,538,923
2021042003615	FWD	USDMXN	04/27/2021	(5)	19.97622	102
2021042703455	FWD	USDMXN	04/27/2021	500,000	19.97	(9,985,000)
2020070103283	FWD	USDMXN	04/28/2021	(107,319)	23.58903	2,531,540
2020100503398	FWD	USDMXN	04/28/2021	600,000	21.83512	(13,101,069)
2020100503218	FWD	USDMXN	04/28/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503540	FWD	USDMXN	04/28/2021	900,000	21.18202	(19,063,815)
2020110503397	FWD	USDMXN	04/28/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021010703254	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,268)	20.1896	954,314
2021011903535	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,000,000	19.91077	(19,910,765)
2021011903579	FWD	USDMXN	04/28/2021	115,695	19.91144	(2,303,647)
2021011903584	FWD	USDMXN	04/28/2021	2,282	19.89484	(45,393)
2021011903532	FWD	USDMXN	04/28/2021	(1,000,000)	19.86	19,860,000
2021012003152	FWD	USDMXN	04/28/2021	6,000,000	19.81673	(118,900,374)
2021012003139	FWD	USDMXN	04/28/2021	(6,000,000)	19.8599	119,159,400
2021012103273	FWD	USDMXN	04/28/2021	3,000,000	19.78489	(59,354,664)
2021012103267	FWD	USDMXN	04/28/2021	(3,000,000)	19.8387	59,516,100
2021012103407	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,704)	19.95178	951,777
2021012803643	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,439)	20.38114	946,482
2021021103370	FWD	USDMXN	04/28/2021	(47,249)	20.12253	950,766
2021021803248	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,222)	20.58257	951,377
2021021803575	FWD	USDMXN	04/28/2021	(24)	20.49131	498
2021021903445	FWD	USDMXN	04/28/2021	24	20.63959	(502)
2021021903480	FWD	USDMXN	04/28/2021	(100,000)	20.64032	2,064,032
2021022203064	FWD	USDMXN	04/28/2021	(50,000)	20.92768	1,046,384
2021022603199	FWD	USDMXN	04/28/2021	(25,000)	21.03613	525,903
2021030403319	FWD	USDMXN	04/28/2021	(45,478)	20.9022	950,584
2021030903467	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,400,000	21.32781	(29,858,937)
2021030903468	FWD	USDMXN	04/28/2021	6,841	21.31745	(145,836)
2021031203003	FWD	USDMXN	04/28/2021	(45,619)	20.76508	947,292
2021031603342	FWD	USDMXN	04/28/2021	80,088	20.63975	(1,652,996)
2021031603343	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,300,000	20.64501	(26,838,515)
2021031803547	FWD	USDMXN	04/28/2021	(46,294)	20.48414	948,303
2021032303374	FWD	USDMXN	04/28/2021	(18,000,000)	20.8041	374,473,800
2021032303376	FWD	USDMXN	04/28/2021	(242,305)	20.81223	5,042,906
2021041303273	FWD	USDMXN	04/28/2021	7,096,571	20.08586	(142,540,745)
2021042003486	FWD	USDMXN	04/28/2021	13,391,012	19.96182	(267,308,944)
2021042103683	FWD	USDMXN	04/28/2021	315,000	19.90809	(6,271,050)
2021042103739	FWD	USDMXN	04/28/2021	17,000	19.9081	(338,438)
2021042803008	FWD	USDMXN	04/28/2021	(30,000,000)	20.005	600,150,000
2020091003211	FWD	USDMXN	04/29/2021	34,000	21.85169	(742,957)
2020091003173	FWD	USDMXN	04/29/2021	(34,000)	21.9866	747,544
2020091803223	FWD	USDMXN	04/29/2021	1,000,000	21.54084	(21,540,840)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020091803197	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,000,000)	21.4586	21,458,600
2020102303699	FWD	USDMXN	04/29/2021	125,000	21.31521	(2,664,402)
2020120303408	FWD	USDMXN	04/29/2021	1,537,500	20.21324	(31,077,857)
2020120303266	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,537,500)	20.222	31,091,325
2020120903399	FWD	USDMXN	04/29/2021	40,000	20.26426	(810,570)
2020120903197	FWD	USDMXN	04/29/2021	(40,000)	20.2118	808,472
2021011503617	FWD	USDMXN	04/29/2021	300,000	20.02394	(6,007,183)
2021011503658	FWD	USDMXN	04/29/2021	(300,000)	20.034	6,010,200
2021011903502	FWD	USDMXN	04/29/2021	50,000	19.91817	(995,908)
2021011903489	FWD	USDMXN	04/29/2021	(50,000)	19.9646	998,230
2021012003335	FWD	USDMXN	04/29/2021	100,000	19.78078	(1,978,078)
2021012003304	FWD	USDMXN	04/29/2021	(100,000)	19.7969	1,979,690
2021012203293	FWD	USDMXN	04/29/2021	50,000	20.1269	(1,006,345)
2021012203340	FWD	USDMXN	04/29/2021	(50,000)	20.16096	1,008,048
2021020903228	FWD	USDMXN	04/29/2021	10,000,000	20.26592	(202,659,220)
2021022603402	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,537,500)	21.07998	32,410,469
2021031703437	FWD	USDMXN	04/29/2021	200,000	20.61057	(4,122,113)
2021031703520	FWD	USDMXN	04/29/2021	500,000	20.47386	(10,236,930)
2021031903154	FWD	USDMXN	04/29/2021	150,000	20.42081	(3,063,121)
2021032403081	FWD	USDMXN	04/29/2021	(1,000,000)	20.83508	20,835,084
2021032603197	FWD	USDMXN	04/29/2021	250,000	20.65494	(5,163,735)
2021040603070	FWD	USDMXN	04/29/2021	200,000	20.23892	(4,047,784)
2021040603157	FWD	USDMXN	04/29/2021	15,000	20.21948	(303,292)
2021040603220	FWD	USDMXN	04/29/2021	100,000	20.203	(2,020,300)
2021040603350	FWD	USDMXN	04/29/2021	250,000	20.1981	(5,049,526)
2021040803402	FWD	USDMXN	04/29/2021	250,000	20.14496	(5,036,240)
2021041503304	FWD	USDMXN	04/29/2021	200,000	19.94011	(3,988,021)
2021042003415	FWD	USDMXN	04/29/2021	(300,000)	19.92412	5,977,236
2021042703456	FWD	USDMXN	04/29/2021	(500,000)	19.9746	9,987,300
2021042703481	FWD	USDMXN	04/29/2021	(2,396,721)	20.0232	47,990,028
2021042803009	FWD	USDMXN	04/29/2021	30,000,000	20.0072	(600,216,000)
2021042903118	FWD	USDMXN	04/29/2021	(500,000)	20.09	10,045,000
2021042903148	FWD	USDMXN	04/29/2021	(40,000,000)	20.083	803,320,000
2020031203147	FWD	USDMXN	04/30/2021	100,000	23.01	(2,301,000)
2020031203129	FWD	USDMXN	04/30/2021	(100,000)	23.93158	2,393,158
2020031803356	FWD	USDMXN	04/30/2021	100,000	24.6122	(2,461,220)
2020031803393	FWD	USDMXN	04/30/2021	(100,000)	25.4	2,540,000
2020043003273	FWD	USDMXN	04/30/2021	600,000	25.09123	(15,054,737)
2020043003261	FWD	USDMXN	04/30/2021	(600,000)	25.123	15,073,800
2020081703365	FWD	USDMXN	04/30/2021	(3,500,000)	22.803	79,810,500
2020081803030	FWD	USDMXN	04/30/2021	3,500,000	22.73124	(79,559,340)
2020082703571	FWD	USDMXN	04/30/2021	1,089,236	22.59482	(24,611,087)
2020082703580	FWD	USDMXN	04/30/2021	(1,089,236)	22.6202	24,638,734
2020101403405	FWD	USDMXN	04/30/2021	50,000	21.7991	(1,089,956)
2020101403158	FWD	USDMXN	04/30/2021	(50,000)	21.796	1,089,800
2020101603055	FWD	USDMXN	04/30/2021	50,000	21.66393	(1,083,196)
2020101603049	FWD	USDMXN	04/30/2021	(50,000)	21.6615	1,083,075
2020111003508	FWD	USDMXN	04/30/2021	100,000	20.723	(2,072,300)
2020111003411	FWD	USDMXN	04/30/2021	(100,000)	24.6122	2,461,220
2020113003062	FWD	USDMXN	04/30/2021	600,000	20.3944	(12,236,640)
2020113003121	FWD	USDMXN	04/30/2021	(600,000)	20.41249	12,247,496
2020120403510	FWD	USDMXN	04/30/2021	250,000	20.09355	(5,023,388)
2020120403226	FWD	USDMXN	04/30/2021	(250,000)	20.195	5,048,750
2020121703682	FWD	USDMXN	04/30/2021	106,000	20.10397	(2,131,021)
2020121703638	FWD	USDMXN	04/30/2021	(106,000)	20.1111	2,131,777
2020121803415	FWD	USDMXN	04/30/2021	2,466,213	20.27106	(49,992,741)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021021803385	FWD	USDMXN	04/30/2021	(2,466,213)	20.274	50,000,000
2021021903169	FWD	USDMXN	04/30/2021	(29,000)	20.50461	594,634
2021022603450	FWD	USDMXN	04/30/2021	29,000	21.04101	(610,189)
2021030503409	FWD	USDMXN	04/30/2021	(200,000)	21.39274	4,278,549
2021031103529	FWD	USDMXN	04/30/2021	336,538	20.76295	(6,987,523)
2021031703489	FWD	USDMXN	04/30/2021	250,000	20.43326	(5,108,316)
2021031803487	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.44901	(8,281,849)
2021031803677	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.55906	(18,708)
2021032203167	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.71428	(8,389,285)
2021032203168	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.66227	(18,803)
2021032203174	FWD	USDMXN	04/30/2021	1,173	20.66089	(24,237)
2021032203172	FWD	USDMXN	04/30/2021	(1,173)	20.65882	24,235
2021032303119	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.69144	(8,380,034)
2021032303477	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.86842	(18,989)
2021032403202	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.83424	(8,437,867)
2021032403253	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.8759	(18,997)
2021032403378	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,000	20.90435	(8,466,263)
2021032403390	FWD	USDMXN	04/30/2021	910	20.92936	(19,045)
2021032403032	FWD	USDMXN	04/30/2021	(50,000)	20.95883	1,047,941
2021033003469	FWD	USDMXN	04/30/2021	405,910	20.61938	(8,369,613)
2021033103294	FWD	USDMXN	04/30/2021	311,820	20.48881	(6,388,821)
2021040603296	FWD	USDMXN	04/30/2021	500,000	20.20086	(10,100,429)
2021040603492	FWD	USDMXN	04/30/2021	501,393	20.20122	(10,128,758)
2021041303388	FWD	USDMXN	04/30/2021	200,000	20.08584	(4,017,168)
2021041503590	FWD	USDMXN	04/30/2021	1,750,000	19.97881	(34,962,925)
2021042203424	FWD	USDMXN	04/30/2021	29,000	19.92775	(577,905)
2021042803365	FWD	USDMXN	04/30/2021	50,000	19.95356	(997,678)
2021042903149	FWD	USDMXN	04/30/2021	40,000,000	20.0853	(803,412,000)
2021043003001	FWD	USDMXN	04/30/2021	(32,000,000)	20.055	641,760,000
2021033103544	FWD	USDMXN	05/03/2021	100,000	20.49256	(2,049,257)
2021040603003	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.29631	(8,930,376)
2021040703315	FWD	USDMXN	05/03/2021	30,000	20.23497	(607,049)
2021040803002	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.21897	(8,896,346)
2021040803205	FWD	USDMXN	05/03/2021	380,000	20.14662	(7,655,717)
2021040903159	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.20705	(8,891,104)
2021041203384	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.1517	(8,866,749)
2021041303117	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.12664	(8,855,721)
2021041303399	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.09296	(8,840,903)
2021041403405	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	20.08499	(8,837,396)
2021041403516	FWD	USDMXN	05/03/2021	(111,000)	20.10827	2,232,018
2021041403524	FWD	USDMXN	05/03/2021	(27,000)	20.12031	543,248
2021041403527	FWD	USDMXN	05/03/2021	(1,497)	20.11202	30,118
2021041503596	FWD	USDMXN	05/03/2021	380,000	19.95166	(7,581,632)
2021041503359	FWD	USDMXN	05/03/2021	(150,000)	19.95523	2,993,284
2021041503593	FWD	USDMXN	05/03/2021	(50,000)	19.95315	997,657
2021041503674	FWD	USDMXN	05/03/2021	(10,691)	19.96392	213,432
2021041503739	FWD	USDMXN	05/03/2021	(66,000)	19.99119	1,319,419
2021041503832	FWD	USDMXN	05/03/2021	(747)	19.95864	14,912
2021041603193	FWD	USDMXN	05/03/2021	440,000	19.94346	(8,775,120)
2021042203137	FWD	USDMXN	05/03/2021	(83,000)	19.9012	1,651,800
2021042203214	FWD	USDMXN	05/03/2021	(494)	19.90459	9,825
2021042603456	FWD	USDMXN	05/03/2021	(41,036)	19.85726	814,869
2021042603465	FWD	USDMXN	05/03/2021	(12,964)	19.86303	257,498
2021042903120	FWD	USDMXN	05/03/2021	500,000	20.0984	(10,049,200)
2021042903199	FWD	USDMXN	05/03/2021	10,000,000	20.0695	(200,695,000)
2021042903399	FWD	USDMXN	05/03/2021	400,000	20.04157	(8,016,628)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021042903401	FWD	USDMXN	05/03/2021	400,000	20.03975	(8,015,900)
2021043003002	FWD	USDMXN	05/03/2021	32,000,000	20.062	(641,984,000)
2021050303002	FWD	USDMXN	05/03/2021	(1,000,000)	20.19	20,190,000
2021050303047	FWD	USDMXN	05/03/2021	(30,000,000)	20.165	604,950,000
2021022403421	FWD	USDMXN	05/04/2021	100,000	20.56455	(2,056,456)
2021022503054	FWD	USDMXN	05/04/2021	50,000	20.88616	(1,044,308)
2021022503569	FWD	USDMXN	05/04/2021	6,774	21.01794	(142,372)
2021031003159	FWD	USDMXN	05/04/2021	2,800,000	21.17662	(59,294,530)
2021031003164	FWD	USDMXN	05/04/2021	(1,000,000)	21.17705	21,177,053
2021031103547	FWD	USDMXN	05/04/2021	50,000	20.75124	(1,037,562)
2021031703359	FWD	USDMXN	05/04/2021	(35,000)	20.54133	718,947
2021032203365	FWD	USDMXN	05/04/2021	18,000	20.66682	(372,003)
2021040503239	FWD	USDMXN	05/04/2021	800,000	20.32894	(16,263,150)
2021040603221	FWD	USDMXN	05/04/2021	100,000	20.21389	(2,021,390)
2021040603244	FWD	USDMXN	05/04/2021	21,100	20.2241	(426,729)
2021040603478	FWD	USDMXN	05/04/2021	79,401	20.23048	(1,606,322)
2021040803551	FWD	USDMXN	05/04/2021	(32,967)	20.15024	664,293
2021041503392	FWD	USDMXN	05/04/2021	300,000	19.94986	(5,984,957)
2021041503557	FWD	USDMXN	05/04/2021	50,000	19.97313	(998,657)
2021041503329	FWD	USDMXN	05/04/2021	(270,000)	19.9592	5,388,983
2021041503676	FWD	USDMXN	05/04/2021	(855)	19.96636	17,073
2021042103336	FWD	USDMXN	05/04/2021	(77,000)	19.90272	1,532,509
2021042103615	FWD	USDMXN	05/04/2021	(249)	19.9103	4,954
2021042203017	FWD	USDMXN	05/04/2021	(24,000)	19.88852	477,324
2021042203140	FWD	USDMXN	05/04/2021	(124,000)	19.8954	2,467,029
2021042203215	FWD	USDMXN	05/04/2021	(5,976)	19.90599	118,966
2021042703230	FWD	USDMXN	05/04/2021	(57,000)	19.99264	1,139,580
2021042703517	FWD	USDMXN	05/04/2021	(204)	20.02551	4,085
2021042703518	FWD	USDMXN	05/04/2021	(296)	20.0205	5,926
2021043003362	FWD	USDMXN	05/04/2021	(1,500,000)	20.19	30,285,000
2021050303003	FWD	USDMXN	05/04/2021	1,000,000	20.1921	(20,192,100)
2021050303048	FWD	USDMXN	05/04/2021	30,000,000	20.1673	(605,019,000)
2021050403351	FWD	USDMXN	05/04/2021	(10,000,000)	20.177	201,770,000
2020082803190	FWD	MXNUSD	05/05/2021	(23,894,227)	22.51177	1,061,410
2020082803197	FWD	MXNUSD	05/05/2021	(103,328,790)	22.51438	4,589,458
2020082803200	FWD	MXNUSD	05/05/2021	(74,173,419)	22.51434	3,294,497
2020082803459	FWD	USDMXN	05/05/2021	(127,041)	22.50285	2,858,787
2020092903458	FWD	USDMXN	05/05/2021	95,578	22.97012	(2,195,435)
2020092903394	FWD	USDMXN	05/05/2021	(8,913,903)	22.59352	201,396,436
2020100503484	FWD	USDMXN	05/05/2021	600,000	21.85429	(13,112,575)
2020100503219	FWD	USDMXN	05/05/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110303265	FWD	USDMXN	05/05/2021	50,000,000	21.64259	(1,082,129,500)
2020110303277	FWD	USDMXN	05/05/2021	(50,000,000)	21.6474	1,082,370,000
2020110503541	FWD	USDMXN	05/05/2021	900,000	21.19866	(19,078,796)
2020110503400	FWD	USDMXN	05/05/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020111903542	FWD	USDMXN	05/05/2021	200,000	20.50552	(4,101,103)
2020111903531	FWD	USDMXN	05/05/2021	(200,000)	20.511	4,102,200
2020112703381	FWD	USDMXN	05/05/2021	200,000	20.42637	(4,085,274)
2020112703418	FWD	USDMXN	05/05/2021	(200,000)	20.4285	4,085,700
2020120303192	FWD	USDMXN	05/05/2021	250,000	20.20696	(5,051,740)
2020120303047	FWD	USDMXN	05/05/2021	(250,000)	20.2525	5,063,125
2021020403363	FWD	USDMXN	05/05/2021	(100,000)	20.62627	2,062,627
2021022503055	FWD	USDMXN	05/05/2021	340,000	20.89145	(7,103,092)
2021022503477	FWD	USDMXN	05/05/2021	(12,445)	21.03345	261,751
2021040803351	FWD	USDMXN	05/05/2021	250,000	20.14507	(5,036,268)
2021041503332	FWD	USDMXN	05/05/2021	(270,000)	19.96087	5,389,434

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041503677	FWD	USDMXN	05/05/2021	(828)	19.96823	16,532
2021042003435	FWD	USDMXN	05/05/2021	(66,000)	19.9699	1,318,013
2021042003608	FWD	USDMXN	05/05/2021	(1,008)	19.99445	20,155
2021042103685	FWD	USDMXN	05/05/2021	315,000	19.92397	(6,276,050)
2021042103741	FWD	USDMXN	05/05/2021	17,000	19.92399	(338,708)
2021042203144	FWD	USDMXN	05/05/2021	(163,000)	19.8998	3,243,667
2021042203216	FWD	USDMXN	05/05/2021	(893)	19.90889	17,785
2021043003363	FWD	USDMXN	05/05/2021	1,500,000	20.1921	(30,288,150)
2021050503214	FWD	USDMXN	05/05/2021	(1,500,000)	20.25	30,375,000
2020062403119	FWD	USDMXN	05/06/2021	(80,242)	23.47061	1,883,333
2020070603156	FWD	USDMXN	05/06/2021	(81,649)	23.05412	1,882,337
2020082503341	FWD	USDMXN	05/06/2021	34,000	22.55189	(766,764)
2020082503361	FWD	USDMXN	05/06/2021	(34,000)	22.6192	769,053
2020102303700	FWD	USDMXN	05/06/2021	125,000	21.33326	(2,666,658)
2021011503619	FWD	USDMXN	05/06/2021	300,000	20.04392	(6,013,175)
2021011503675	FWD	USDMXN	05/06/2021	(300,000)	20.057	6,017,100
2021022503698	FWD	USDMXN	05/06/2021	(70,000)	20.97954	1,468,568
2021030303213	FWD	USDMXN	05/06/2021	(15,727)	21.02142	330,593
2021031003022	FWD	USDMXN	05/06/2021	(25,000)	21.18159	529,540
2021031703302	FWD	USDMXN	05/06/2021	95,000	20.61309	(1,958,244)
2021031703447	FWD	USDMXN	05/06/2021	1,042	20.4812	(21,334)
2021031903165	FWD	USDMXN	05/06/2021	100,000	20.41638	(2,041,638)
2021033003373	FWD	USDMXN	05/06/2021	150,000	20.63389	(3,095,083)
2021033103129	FWD	USDMXN	05/06/2021	300,000	20.51199	(6,153,598)
2021033103388	FWD	USDMXN	05/06/2021	150,000	20.52597	(3,078,896)
2021040803276	FWD	USDMXN	05/06/2021	1,000,000	20.21745	(20,217,453)
2021040803405	FWD	USDMXN	05/06/2021	250,000	20.19546	(5,048,865)
2021041303305	FWD	USDMXN	05/06/2021	250,000	20.11353	(5,028,383)
2021041503148	FWD	USDMXN	05/06/2021	200,000	20.00176	(4,000,353)
2021041503202	FWD	USDMXN	05/06/2021	100,000	20.03545	(2,003,546)
2021041503668	FWD	USDMXN	05/06/2021	90,481	19.9706	(1,806,968)
2021041503360	FWD	USDMXN	05/06/2021	(150,000)	19.96394	2,994,591
2021041903739	FWD	USDMXN	05/06/2021	150,000	19.86438	(2,979,658)
2021041903403	FWD	USDMXN	05/06/2021	(113,000)	19.86319	2,244,540
2021041903651	FWD	USDMXN	05/06/2021	(286)	19.85294	5,670
2021042003477	FWD	USDMXN	05/06/2021	250,000	19.82744	(4,956,860)
2021042003686	FWD	USDMXN	05/06/2021	100,000	19.98985	(1,998,985)
2021042003015	FWD	USDMXN	05/06/2021	(38,000)	19.8886	755,767
2021042003325	FWD	USDMXN	05/06/2021	(86,000)	19.90629	1,711,941
2021042003609	FWD	USDMXN	05/06/2021	(1,355)	19.99533	27,102
2021042203148	FWD	USDMXN	05/06/2021	(204,000)	19.9018	4,059,968
2021042203218	FWD	USDMXN	05/06/2021	(615)	19.91094	12,242
2021042903400	FWD	USDMXN	05/06/2021	(400,000)	20.04773	8,019,091
2021050403352	FWD	USDMXN	05/06/2021	10,000,000	20.1814	(201,814,000)
2020090903344	FWD	USDMXN	05/07/2021	200,000	22.04517	(4,409,033)
2020090903319	FWD	USDMXN	05/07/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020092903050	FWD	USDMXN	05/07/2021	2,213,542	22.79805	(50,464,435)
2020092903120	FWD	USDMXN	05/07/2021	(2,213,542)	22.81	50,490,893
2020110503064	FWD	USDMXN	05/07/2021	6,000,000	21.12798	(126,767,874)
2020110503214	FWD	USDMXN	05/07/2021	25,000	21.14546	(528,637)
2020110503012	FWD	USDMXN	05/07/2021	(25,000)	21.211	530,275
2020110503046	FWD	USDMXN	05/07/2021	(6,000,000)	21.1675	127,005,000
2020112003295	FWD	USDMXN	05/07/2021	50,000	20.50583	(1,025,292)
2020112003308	FWD	USDMXN	05/07/2021	(50,000)	20.5511	1,027,555
2020112403116	FWD	USDMXN	05/07/2021	237,000	20.41463	(4,838,267)
2020112403020	FWD	USDMXN	05/07/2021	(236,800)	20.4143	4,834,106

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020112503509	FWD	USDMXN	05/07/2021	(200)	20.31282	4,063
2020123003156	FWD	USDMXN	05/07/2021	250,000	20.13544	(5,033,860)
2020123003084	FWD	USDMXN	05/07/2021	(250,000)	20.2936	5,073,400
2021030103030	FWD	USDMXN	05/07/2021	(50,000)	20.78912	1,039,456
2021030503518	FWD	USDMXN	05/07/2021	(20,000)	21.40678	428,136
2021031603493	FWD	USDMXN	05/07/2021	501,491	20.67304	(10,367,337)
2021031703488	FWD	USDMXN	05/07/2021	250,000	20.44876	(5,112,190)
2021031703528	FWD	USDMXN	05/07/2021	500,000	20.45711	(10,228,554)
2021031703360	FWD	USDMXN	05/07/2021	(20,000)	20.54332	410,866
2021040603493	FWD	USDMXN	05/07/2021	142,646	20.21652	(2,883,806)
2021041303389	FWD	USDMXN	05/07/2021	200,000	20.10113	(4,020,226)
2021041503827	FWD	USDMXN	05/07/2021	940,000	19.93648	(18,740,295)
2021041503591	FWD	USDMXN	05/07/2021	(302,000)	19.97835	6,033,461
2021041503678	FWD	USDMXN	05/07/2021	(593)	19.9723	11,842
2021042003676	FWD	USDMXN	05/07/2021	100,000	19.99889	(1,999,889)
2021042003687	FWD	USDMXN	05/07/2021	(100,000)	19.991	1,999,100
2021042203154	FWD	USDMXN	05/07/2021	(59,000)	19.8998	1,174,088
2021042203219	FWD	USDMXN	05/07/2021	(866)	19.90992	17,249
2021042203223	FWD	USDMXN	05/07/2021	(168,000)	19.9082	3,344,578
2021042203232	FWD	USDMXN	05/07/2021	(561)	19.90518	11,171
2021042803366	FWD	USDMXN	05/07/2021	(50,000)	19.96809	998,404
2021050703292	FWD	USDMXN	05/07/2021	95,000,000	19.885	(1,889,075,000)
2021050703314	FWD	USDMXN	05/07/2021	(100,000,000)	19.88	1,988,000,000
2021030903331	FWD	USDMXN	05/10/2021	200,000	21.37311	(4,274,622)
2021040703215	FWD	USDMXN	05/10/2021	350,000	20.27466	(7,096,130)
2021041303298	FWD	USDMXN	05/10/2021	3,263	20.11543	(65,638)
2021041303400	FWD	USDMXN	05/10/2021	66,000	20.15025	(1,329,917)
2021041303406	FWD	USDMXN	05/10/2021	(3,063)	20.09855	61,564
2021041503592	FWD	USDMXN	05/10/2021	(302,000)	19.98483	6,035,420
2021041503679	FWD	USDMXN	05/10/2021	(518)	19.97931	10,345
2021042203304	FWD	USDMXN	05/10/2021	(59,000)	19.96909	1,178,176
2021042203394	FWD	USDMXN	05/10/2021	(636)	19.96321	12,694
2021042303482	FWD	USDMXN	05/10/2021	1,500,000	19.87373	(29,810,600)
2021042303100	FWD	USDMXN	05/10/2021	(138,000)	19.90876	2,747,409
2021042303315	FWD	USDMXN	05/10/2021	(1,075)	19.88153	21,371
2021050503215	FWD	USDMXN	05/10/2021	1,500,000	20.2605	(30,390,750)
2021050703269	FWD	USDMXN	05/10/2021	50,322,061	19.872	(1,000,000,000)
2021050703289	FWD	USDMXN	05/10/2021	50,000,000	19.88	(994,000,000)
2021050703293	FWD	USDMXN	05/10/2021	(95,000,000)	19.89145	1,889,687,750
2021051003083	FWD	USDMXN	05/10/2021	43,000,000	19.897	(855,571,000)
2021051003127	FWD	USDMXN	05/10/2021	55,000,000	19.885	(1,093,675,000)
2021051003172	FWD	USDMXN	05/10/2021	(100,000,000)	19.88	1,988,000,000
2021051003413	FWD	USDMXN	05/10/2021	(1,500,000)	19.92	29,880,000
2021010603381	FWD	USDMXN	05/11/2021	1,400,000	19.89831	(27,857,633)
2021010603346	FWD	USDMXN	05/11/2021	(1,400,000)	19.9215	27,890,100
2021021703054	FWD	USDMXN	05/11/2021	49,000	20.49327	(1,004,170)
2021021703250	FWD	USDMXN	05/11/2021	831	20.37163	(16,928)
2021031603559	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000	20.73827	(1,036,913)
2021031703291	FWD	USDMXN	05/11/2021	(40,000)	20.65534	826,214
2021032503237	FWD	USDMXN	05/11/2021	25,000	20.86657	(521,664)
2021032603297	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000	20.70172	(1,035,086)
2021040603222	FWD	USDMXN	05/11/2021	100,000	20.22918	(2,022,918)
2021040803565	FWD	USDMXN	05/11/2021	22,000	20.16771	(443,690)
2021040803579	FWD	USDMXN	05/11/2021	28,750	20.17278	(579,967)
2021040903290	FWD	USDMXN	05/11/2021	65,900	20.2358	(1,333,539)
2021041203207	FWD	USDMXN	05/11/2021	19,450	20.16143	(392,140)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041503556	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000	19.98863	(999,432)
2021042303030	FWD	USDMXN	05/11/2021	(285,000)	19.86679	5,662,035
2021042303104	FWD	USDMXN	05/11/2021	(117,000)	19.91506	2,330,062
2021042303316	FWD	USDMXN	05/11/2021	(1,084)	19.88368	21,560
2021042303409	FWD	USDMXN	05/11/2021	(86,000)	19.86943	1,708,771
2021042303444	FWD	USDMXN	05/11/2021	(632)	19.87603	12,570
2021042603265	FWD	USDMXN	05/11/2021	(50,000)	19.87368	993,684
2021042603469	FWD	USDMXN	05/11/2021	(952)	19.8806	18,916
2021050703315	FWD	USDMXN	05/11/2021	100,000,000	19.8882	(1,988,820,000)
2021050703270	FWD	USDMXN	05/11/2021	(50,316,427)	19.87423	1,000,000,000
2021050703290	FWD	USDMXN	05/11/2021	(50,000,000)	19.88215	994,107,500
2021050703312	FWD	USDMXN	05/11/2021	(382,000)	19.90902	7,605,246
2021051003086	FWD	USDMXN	05/11/2021	100,000,000	19.895	(1,989,500,000)
2021051003414	FWD	USDMXN	05/11/2021	1,500,000	19.9221	(29,883,150)
2021051003084	FWD	USDMXN	05/11/2021	(43,000,000)	19.89928	855,668,825
2021051003128	FWD	USDMXN	05/11/2021	(55,000,000)	19.8872	1,093,796,000
2021051003419	FWD	USDMXN	05/11/2021	(1,000,000)	19.92	19,920,000
2021051103101	FWD	USDMXN	05/11/2021	90,000,000	19.85	(1,786,500,000)
2021051103241	FWD	USDMXN	05/11/2021	(100,000,000)	19.85	1,985,000,000
2020060803201	FWD	USDMXN	05/12/2021	(2,158)	22.52439	48,612
2020060803220	FWD	USDMXN	05/12/2021	(110,000)	22.6054	2,486,594
2020061503290	FWD	USDMXN	05/12/2021	(100,000)	23.30207	2,330,207
2020061503296	FWD	USDMXN	05/12/2021	(8,873)	23.15779	205,480
2020062203124	FWD	USDMXN	05/12/2021	1,439	23.31715	(33,561)
2020062203116	FWD	USDMXN	05/12/2021	(110,000)	23.35089	2,568,598
2020070103284	FWD	USDMXN	05/12/2021	(107,320)	23.62483	2,535,411
2020070603256	FWD	USDMXN	05/12/2021	(396)	23.10585	9,149
2020070603257	FWD	USDMXN	05/12/2021	(109,342)	23.10269	2,526,092
2020071303148	FWD	USDMXN	05/12/2021	(109,131)	23.23306	2,535,443
2020100503485	FWD	USDMXN	05/12/2021	600,000	21.87228	(13,123,369)
2020100503220	FWD	USDMXN	05/12/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503542	FWD	USDMXN	05/12/2021	900,000	21.21551	(19,093,963)
2020110503401	FWD	USDMXN	05/12/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020121703108	FWD	USDMXN	05/12/2021	250,000	20.129	(5,032,249)
2020121703082	FWD	USDMXN	05/12/2021	(250,000)	20.132	5,033,000
2020122403068	FWD	USDMXN	05/12/2021	500,000	20.20076	(10,100,380)
2020122403071	FWD	USDMXN	05/12/2021	(500,000)	20.2084	10,104,200
2021010403418	FWD	USDMXN	05/12/2021	500,000	20.26936	(10,134,678)
2021010403044	FWD	USDMXN	05/12/2021	(500,000)	20.034	10,017,000
2021012803642	FWD	USDMXN	05/12/2021	(43,036)	20.41255	878,478
2021020403163	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,938)	20.57615	883,494
2021020403364	FWD	USDMXN	05/12/2021	(100,000)	20.64176	2,064,176
2021031203004	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,271)	20.79569	879,063
2021031803548	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,948)	20.51481	881,074
2021032503408	FWD	USDMXN	05/12/2021	(42,357)	20.82918	882,254
2021040803352	FWD	USDMXN	05/12/2021	250,000	20.16038	(5,040,095)
2021041503828	FWD	USDMXN	05/12/2021	4,940,000	19.94751	(98,540,680)
2021041903738	FWD	USDMXN	05/12/2021	350,000	19.87612	(6,956,642)
2021042103684	FWD	USDMXN	05/12/2021	315,000	19.93959	(6,280,972)
2021042103742	FWD	USDMXN	05/12/2021	17,000	19.93963	(338,974)
2021042603297	FWD	USDMXN	05/12/2021	(244,000)	19.88402	4,851,700
2021042603471	FWD	USDMXN	05/12/2021	(741)	19.88277	14,726
2021042603492	FWD	USDMXN	05/12/2021	(127,000)	19.88752	2,525,714
2021042603524	FWD	USDMXN	05/12/2021	(119)	19.89499	2,372
2021042603558	FWD	USDMXN	05/12/2021	(37,000)	19.90305	736,413
2021042603567	FWD	USDMXN	05/12/2021	(103)	19.90989	2,042

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021042703086	FWD	USDMXN	05/12/2021	(43,000)	20.02729	861,173
2021042703516	FWD	USDMXN	05/12/2021	(908)	20.04289	18,202
2021050303342	FWD	USDMXN	05/12/2021	(20,000)	20.21106	404,221
2021050303435	FWD	USDMXN	05/12/2021	(604)	20.18884	12,190
2021051003173	FWD	USDMXN	05/12/2021	100,000,000	19.8841	(1,988,410,000)
2021051003087	FWD	USDMXN	05/12/2021	(100,000,000)	19.89725	1,989,725,000
2021051003132	FWD	USDMXN	05/12/2021	(112,158)	22.602	2,535,000
2021051003133	FWD	USDMXN	05/12/2021	(22,182)	18.87	0
2021051103139	FWD	USDMXN	05/12/2021	50,000,000	19.848	(992,400,000)
2021051103142	FWD	USDMXN	05/12/2021	50,000,000	19.848	(992,400,000)
2021051103186	FWD	USDMXN	05/12/2021	40,000,000	19.855	(794,200,000)
2021051103201	FWD	USDMXN	05/12/2021	50,000,000	19.852	(992,600,000)
2021051103102	FWD	USDMXN	05/12/2021	(90,000,000)	19.85217	1,786,695,300
2021051103243	FWD	USDMXN	05/12/2021	(100,000,000)	19.85	1,985,000,000
2021051203170	FWD	USDMXN	05/12/2021	(30,000,000)	20.11	603,300,000
2020090103549	FWD	USDMXN	05/13/2021	34,000	22.33462	(759,377)
2020090103559	FWD	USDMXN	05/13/2021	(34,000)	22.4451	763,133
2020102303701	FWD	USDMXN	05/13/2021	125,000	21.35131	(2,668,913)
2021011503620	FWD	USDMXN	05/13/2021	300,000	20.05479	(6,016,437)
2021011503667	FWD	USDMXN	05/13/2021	(300,000)	20.068	6,020,400
2021021703057	FWD	USDMXN	05/13/2021	101,000	20.47459	(2,067,934)
2021021703251	FWD	USDMXN	05/13/2021	63	20.37191	(1,293)
2021031903166	FWD	USDMXN	05/13/2021	100,000	20.43197	(2,043,197)
2021033003372	FWD	USDMXN	05/13/2021	150,000	20.6496	(3,097,440)
2021033103391	FWD	USDMXN	05/13/2021	150,000	20.5416	(3,081,240)
2021041303306	FWD	USDMXN	05/13/2021	250,000	20.13376	(5,033,440)
2021041503147	FWD	USDMXN	05/13/2021	200,000	20.01723	(4,003,445)
2021041603508	FWD	USDMXN	05/13/2021	250,000	19.94304	(4,985,760)
2021042003677	FWD	USDMXN	05/13/2021	100,000	20.01216	(2,001,216)
2021042603428	FWD	USDMXN	05/13/2021	(412,000)	19.88999	8,194,678
2021042603472	FWD	USDMXN	05/13/2021	(1,146)	19.88452	22,782
2021042803026	FWD	USDMXN	05/13/2021	(35,000)	20.0353	701,235
2021042803149	FWD	USDMXN	05/13/2021	(25,000)	19.99303	499,826
2021042803361	FWD	USDMXN	05/13/2021	(2,874)	19.98021	57,431
2021042903402	FWD	USDMXN	05/13/2021	(400,000)	20.06076	8,024,305
2021042903709	FWD	USDMXN	05/13/2021	(102,000)	20.06346	2,046,473
2021050403036	FWD	USDMXN	05/13/2021	(52,350)	20.25202	1,060,193
2021050603505	FWD	USDMXN	05/13/2021	250,000	20.12908	(5,032,270)
2021051003420	FWD	USDMXN	05/13/2021	1,000,000	19.9242	(19,924,200)
2021051103237	FWD	USDMXN	05/13/2021	30,000,000	19.89	(596,700,000)
2021051103242	FWD	USDMXN	05/13/2021	100,000,000	19.8541	(1,985,410,000)
2021051103140	FWD	USDMXN	05/13/2021	(50,000,000)	19.8502	992,510,000
2021051103143	FWD	USDMXN	05/13/2021	(50,000,000)	19.8502	992,510,000
2021051103187	FWD	USDMXN	05/13/2021	(40,000,000)	19.8572	794,288,000
2021051103202	FWD	USDMXN	05/13/2021	(50,000,000)	19.8542	992,710,000
2021051103300	FWD	USDMXN	05/13/2021	(4,000,000)	19.9108	79,643,200
2021051203171	FWD	USDMXN	05/13/2021	30,000,000	20.11228	(603,368,400)
2021051203318	FWD	USDMXN	05/13/2021	(10,000,000)	20.11173	201,117,310
2021051303028	FWD	USDMXN	05/13/2021	50,000,000	20.138	(1,006,900,000)
2021051303030	FWD	USDMXN	05/13/2021	50,000,000	20.138	(1,006,900,000)
2021051303041	FWD	USDMXN	05/13/2021	(150,000,000)	20.14	3,021,000,000
2021051303295	FWD	USDMXN	05/13/2021	(1,000,000)	20	20,000,000
2020022803578	FWD	USDMXN	05/14/2021	100,000	20.4752	(2,047,520)
2020022803528	FWD	USDMXN	05/14/2021	(100,000)	21.2013	2,120,130
2020030903371	FWD	USDMXN	05/14/2021	100,000	22.0587	(2,205,870)
2020030903288	FWD	USDMXN	05/14/2021	(100,000)	22.64169	2,264,169

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020110503215	FWD	USDMXN	05/14/2021	25,000	21.16224	(529,056)
2020110503014	FWD	USDMXN	05/14/2021	(25,000)	21.211	530,275
2020111003511	FWD	USDMXN	05/14/2021	100,000	20.75562	(2,075,562)
2020111003398	FWD	USDMXN	05/14/2021	(100,000)	20.4752	2,047,520
2020112003298	FWD	USDMXN	05/14/2021	50,000	20.52266	(1,026,133)
2020112003309	FWD	USDMXN	05/14/2021	(50,000)	20.5511	1,027,555
2020120303412	FWD	USDMXN	05/14/2021	980,100	20.24688	(19,843,965)
2020120303268	FWD	USDMXN	05/14/2021	(980,100)	20.2554	19,852,318
2020123003157	FWD	USDMXN	05/14/2021	250,000	20.15175	(5,037,937)
2020123003143	FWD	USDMXN	05/14/2021	(250,000)	20.3084	5,077,100
2021010403367	FWD	USDMXN	05/14/2021	300,000	20.24131	(6,072,392)
2021010403370	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.265	6,079,500
2021011903503	FWD	USDMXN	05/14/2021	50,000	19.95281	(997,641)
2021011903490	FWD	USDMXN	05/14/2021	(50,000)	19.9992	999,960
2021020503117	FWD	USDMXN	05/14/2021	300,000	20.37318	(6,111,956)
2021020503002	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.63304	6,189,912
2021021803360	FWD	USDMXN	05/14/2021	(300,000)	20.60512	6,181,536
2021031003013	FWD	USDMXN	05/14/2021	(30,000)	21.22495	636,749
2021031603221	FWD	USDMXN	05/14/2021	350,000	20.69832	(7,244,411)
2021031603494	FWD	USDMXN	05/14/2021	193,937	20.68865	(4,012,290)
2021031703529	FWD	USDMXN	05/14/2021	500,000	20.59882	(10,299,412)
2021040603494	FWD	USDMXN	05/14/2021	184,657	20.23194	(3,735,977)
2021041303390	FWD	USDMXN	05/14/2021	200,000	20.11633	(4,023,267)
2021041503361	FWD	USDMXN	05/14/2021	1,000,000	19.9631	(19,963,099)
2021042903006	FWD	USDMXN	05/14/2021	(172,000)	20.06432	3,451,063
2021042903139	FWD	USDMXN	05/14/2021	(29,000)	20.09307	582,699
2021042903403	FWD	USDMXN	05/14/2021	(396)	20.06404	7,936
2021042903407	FWD	USDMXN	05/14/2021	(162,000)	20.0765	3,252,393
2021042903662	FWD	USDMXN	05/14/2021	(598)	20.07391	12,004
2021042903710	FWD	USDMXN	05/14/2021	(339,000)	20.06566	6,802,260
2021043003116	FWD	USDMXN	05/14/2021	(165,000)	20.18619	3,330,722
2021043003119	FWD	USDMXN	05/14/2021	(670)	20.18155	13,519
2021050603451	FWD	USDMXN	05/14/2021	17	20.13327	(346)
2021050603412	FWD	USDMXN	05/14/2021	(1,232,000)	20.1348	24,806,070
2021050703112	FWD	USDMXN	05/14/2021	1,000,000	19.91109	(19,911,089)
2021050703319	FWD	USDMXN	05/14/2021	15,000	19.91642	(298,747)
2021051103244	FWD	USDMXN	05/14/2021	100,000,000	19.8541	(1,985,410,000)
2021051103238	FWD	USDMXN	05/14/2021	(30,000,000)	19.89223	596,766,750
2021051303016	FWD	USDMXN	05/14/2021	70,000,000	20.134	(1,409,380,000)
2021051303022	FWD	USDMXN	05/14/2021	75,000,000	20.134	(1,510,050,000)
2021051303024	FWD	USDMXN	05/14/2021	75,000,000	20.134	(1,510,050,000)
2021051303029	FWD	USDMXN	05/14/2021	(50,000,000)	20.1403	1,007,015,000
2021051303031	FWD	USDMXN	05/14/2021	(50,000,000)	20.1403	1,007,015,000
2021051303045	FWD	USDMXN	05/14/2021	(100,000,000)	20.14	2,014,000,000
2021051303303	FWD	USDMXN	05/14/2021	(500,000)	20	10,000,000
2020090903015	FWD	USDMXN	05/17/2021	500,000	22.32451	(11,162,255)
2020090903006	FWD	USDMXN	05/17/2021	(500,000)	22.3705	11,185,250
2020100803300	FWD	USDMXN	05/17/2021	204,000	21.96353	(4,480,561)
2020111903589	FWD	USDMXN	05/17/2021	403,000	20.5823	(8,294,668)
2021011403353	FWD	USDMXN	05/17/2021	250,000	19.96869	(4,992,172)
2021011403372	FWD	USDMXN	05/17/2021	(250,000)	19.972	4,993,000
2021021803329	FWD	USDMXN	05/17/2021	2,682,285	20.61079	(55,284,003)
2021030203533	FWD	USDMXN	05/17/2021	1,104,500	20.77293	(22,943,694)
2021031103068	FWD	USDMXN	05/17/2021	(40,000)	20.87007	834,803
2021040603629	FWD	USDMXN	05/17/2021	(4,770,000)	20.27945	96,732,991
2021040603630	FWD	USDMXN	05/17/2021	(4,576)	20.26876	92,740

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041303232	FWD	USDMXN	05/17/2021	(14,600,000)	20.12961	293,892,277
2021041303293	FWD	USDMXN	05/17/2021	(50,895)	20.1216	1,024,095
2021041403186	FWD	USDMXN	05/17/2021	250,000	20.14129	(5,035,322)
2021041403387	FWD	MXNUSD	05/17/2021	(200,000,000)	20.13598	9,932,469
2021041403438	FWD	USDMXN	05/17/2021	(2,696)	20.12874	54,277
2021042003491	FWD	USDMXN	05/17/2021	(6,749,563)	20.00571	135,029,821
2021042903711	FWD	USDMXN	05/17/2021	(974,000)	20.07227	19,550,390
2021050403165	FWD	USDMXN	05/17/2021	(150,000)	20.25639	3,038,458
2021050403213	FWD	USDMXN	05/17/2021	(3,640)	20.28222	73,821
2021050503055	FWD	USDMXN	05/17/2021	(133,000)	20.24763	2,692,935
2021050503115	FWD	USDMXN	05/17/2021	(160,000)	20.23407	3,237,451
2021050503373	FWD	USDMXN	05/17/2021	(3,530)	20.28364	71,597
2021050603335	FWD	USDMXN	05/17/2021	1,000,000	20.20325	(20,203,249)
2021051103273	FWD	USDMXN	05/17/2021	141,000	19.92642	(2,809,625)
2021051103275	FWD	USDMXN	05/17/2021	257	19.9176	(5,126)
2021051303042	FWD	USDMXN	05/17/2021	150,000,000	20.1482	(3,022,230,000)
2021051303046	FWD	USDMXN	05/17/2021	100,000,000	20.14615	(2,014,615,000)
2021051303304	FWD	USDMXN	05/17/2021	500,000	20.0066	(10,003,300)
2021051303017	FWD	USDMXN	05/17/2021	(70,000,000)	20.141	1,409,870,000
2021051303023	FWD	USDMXN	05/17/2021	(75,000,000)	20.141	1,510,575,000
2021051303025	FWD	USDMXN	05/17/2021	(75,000,000)	20.141	1,510,575,000
2021051303354	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000)	19.98874	1,998,874
2021051303356	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000)	19.98415	1,998,415
2021051303529	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000)	19.92968	1,992,968
2021051303533	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000)	19.93169	1,993,169
2021051303538	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000)	19.93584	1,993,584
2021051303540	FWD	USDMXN	05/17/2021	(150,000)	19.93481	2,990,222
2021051403121	FWD	USDMXN	05/17/2021	75,000,000	19.843	(1,488,225,000)
2021051403125	FWD	USDMXN	05/17/2021	50,000,000	19.843	(992,150,000)
2021051403224	FWD	USDMXN	05/17/2021	75,000,000	19.843	(1,488,225,000)
2021051403133	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000,000)	19.88	1,988,000,000
2021051403136	FWD	USDMXN	05/17/2021	(100,000,000)	19.88	1,988,000,000
2020120303601	FWD	USDMXN	05/18/2021	550,000	20.24161	(11,132,883)
2020120303497	FWD	USDMXN	05/18/2021	(550,000)	20.253	11,139,150
2021010603382	FWD	USDMXN	05/18/2021	1,400,000	19.91378	(27,879,291)
2021010603347	FWD	USDMXN	05/18/2021	(1,400,000)	19.9361	27,910,540
2021022503058	FWD	USDMXN	05/18/2021	100,000	20.9215	(2,092,150)
2021022503570	FWD	USDMXN	05/18/2021	10,092	21.04387	(212,369)
2021031203044	FWD	USDMXN	05/18/2021	(50,000)	20.94288	1,047,144
2021032203364	FWD	USDMXN	05/18/2021	50,000	20.69789	(1,034,895)
2021032503239	FWD	USDMXN	05/18/2021	45,000	20.84321	(937,944)
2021032903423	FWD	USDMXN	05/18/2021	26,000	20.71808	(538,670)
2021040603223	FWD	USDMXN	05/18/2021	100,000	20.24473	(2,024,473)
2021040803189	FWD	USDMXN	05/18/2021	1,000,000	20.17233	(20,172,331)
2021041403526	FWD	USDMXN	05/18/2021	82,800	20.15784	(1,669,069)
2021041503834	FWD	USDMXN	05/18/2021	74,600	19.99879	(1,491,910)
2021041903432	FWD	USDMXN	05/18/2021	500,000	19.89055	(9,945,276)
2021042003572	FWD	USDMXN	05/18/2021	1,000,000	20.04726	(20,047,259)
2021050503074	FWD	USDMXN	05/18/2021	(531,000)	20.21411	10,733,692
2021050503376	FWD	USDMXN	05/18/2021	(700)	20.28457	14,203
2021050703320	FWD	USDMXN	05/18/2021	15,000	19.92566	(298,885)
2021051303296	FWD	USDMXN	05/18/2021	1,000,000	20.011	(20,011,000)
2021051403134	FWD	USDMXN	05/18/2021	100,000,000	19.88205	(1,988,205,000)
2021051403137	FWD	USDMXN	05/18/2021	100,000,000	19.88205	(1,988,205,000)
2021051403122	FWD	USDMXN	05/18/2021	(75,000,000)	19.84535	1,488,401,250
2021051403126	FWD	USDMXN	05/18/2021	(50,000,000)	19.84535	992,267,500

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021051403225	FWD	USDMXN	05/18/2021	(75,000,000)	19.84535	1,488,401,250
2021051403472	FWD	USDMXN	05/18/2021	(100,000)	19.84686	1,984,686
2021051403474	FWD	USDMXN	05/18/2021	(100,000)	19.84664	1,984,664
2021051403588	FWD	USDMXN	05/18/2021	(382,000)	19.8585	7,585,947
2021051403591	FWD	USDMXN	05/18/2021	(500,000)	19.8547	9,927,350
2021051403593	FWD	USDMXN	05/18/2021	(500,000)	19.8571	9,928,550
2021051703018	FWD	USDMXN	05/18/2021	50,000,000	19.9	(995,000,000)
2021051703020	FWD	USDMXN	05/18/2021	30,000,000	19.89	(596,700,000)
2021051703273	FWD	USDMXN	05/18/2021	50,000,000	19.79	(989,500,000)
2021051703304	FWD	USDMXN	05/18/2021	50,000,000	19.78	(989,000,000)
2021051703349	FWD	USDMXN	05/18/2021	(100,000,000)	19.8	1,980,000,000
2021051703351	FWD	USDMXN	05/18/2021	(100,000,000)	19.8	1,980,000,000
2021051803157	FWD	USDMXN	05/18/2021	(1,000,000)	19.82	19,820,000
2020072803271	FWD	USDMXN	05/19/2021	243,216	22.74261	(5,531,368)
2020072803155	FWD	USDMXN	05/19/2021	(243,216)	22.387	5,444,877
2020100503486	FWD	USDMXN	05/19/2021	600,000	21.89027	(13,134,164)
2020100503222	FWD	USDMXN	05/19/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503543	FWD	USDMXN	05/19/2021	900,000	21.23288	(19,109,595)
2020110503402	FWD	USDMXN	05/19/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021011503209	FWD	USDMXN	05/19/2021	1,208,142	20.14492	(24,337,925)
2021011503098	FWD	USDMXN	05/19/2021	(1,208,142)	20.251	24,466,084
2021012003321	FWD	USDMXN	05/19/2021	938,837	19.85712	(18,642,594)
2021012003626	FWD	USDMXN	05/19/2021	305,953	19.82694	(6,066,112)
2021012003224	FWD	USDMXN	05/19/2021	(938,837)	19.9662	18,745,007
2021012003568	FWD	USDMXN	05/19/2021	(305,953)	19.9372	6,099,846
2021012103207	FWD	USDMXN	05/19/2021	742,919	19.95232	(14,822,960)
2021012103154	FWD	USDMXN	05/19/2021	(742,919)	20.0648	14,906,521
2021012603495	FWD	USDMXN	05/19/2021	91,442	20.24115	(1,850,891)
2021012703789	FWD	USDMXN	05/19/2021	86,427	20.52345	(1,773,780)
2021020403611	FWD	USDMXN	05/19/2021	1,884,821	20.61577	(38,857,042)
2021020403365	FWD	USDMXN	05/19/2021	(100,000)	20.65752	2,065,752
2021021203537	FWD	USDMXN	05/19/2021	109,803	20.15002	(2,212,532)
2021022503059	FWD	USDMXN	05/19/2021	650,000	20.9257	(13,601,705)
2021022503478	FWD	USDMXN	05/19/2021	(23,423)	21.05983	493,274
2021030303432	FWD	USDMXN	05/19/2021	19,567	21.07142	(412,304)
2021031203240	FWD	USDMXN	05/19/2021	(35,000)	20.85604	729,962
2021031603139	FWD	USDMXN	05/19/2021	(40,000)	20.70519	828,207
2021032403100	FWD	USDMXN	05/19/2021	76,155	20.90087	(1,591,706)
2021040803298	FWD	USDMXN	05/19/2021	1,100,000	20.16675	(22,183,425)
2021040803353	FWD	USDMXN	05/19/2021	250,000	20.17572	(5,043,930)
2021041403184	FWD	USDMXN	05/19/2021	320,000	20.14568	(6,446,617)
2021041503046	FWD	USDMXN	05/19/2021	200,000	20.04865	(4,009,730)
2021042103686	FWD	USDMXN	05/19/2021	315,000	19.95511	(6,285,858)
2021042103743	FWD	USDMXN	05/19/2021	17,000	19.95515	(339,237)
2021042203373	FWD	USDMXN	05/19/2021	971,943	19.95065	(19,390,896)
2021042303376	FWD	USDMXN	05/19/2021	193,349	19.8913	(3,845,962)
2021042303577	FWD	USDMXN	05/19/2021	136,485	19.89018	(2,714,711)
2021042703600	FWD	USDMXN	05/19/2021	276,127	20.09981	(5,550,101)
2021043003598	FWD	USDMXN	05/19/2021	251,563	20.26297	(5,097,414)
2021050503213	FWD	USDMXN	05/19/2021	(143,000)	20.27252	2,898,970
2021050503377	FWD	USDMXN	05/19/2021	(392)	20.28681	7,952
2021050603339	FWD	USDMXN	05/19/2021	131,553	20.14861	(2,650,616)
2021050603552	FWD	USDMXN	05/19/2021	61,697	20.10327	(1,240,312)
2021050603283	FWD	USDMXN	05/19/2021	(150,000)	20.15147	3,022,720
2021051103460	FWD	USDMXN	05/19/2021	(118,000)	19.99727	2,359,678
2021051103482	FWD	USDMXN	05/19/2021	(289)	20.00257	5,774

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021051703350	FWD	USDMXN	05/19/2021	100,000,000	19.80205	(1,980,205,000)
2021051703352	FWD	USDMXN	05/19/2021	100,000,000	19.80205	(1,980,205,000)
2021051703019	FWD	USDMXN	05/19/2021	(50,000,000)	19.90243	995,121,250
2021051703021	FWD	USDMXN	05/19/2021	(30,000,000)	19.8924	596,772,000
2021051703274	FWD	USDMXN	05/19/2021	(50,000,000)	19.79235	989,617,500
2021051703305	FWD	USDMXN	05/19/2021	(50,000,000)	19.78227	989,113,500
2020052003295	FWD	USDMXN	05/20/2021	800,000	24.32823	(19,462,588)
2020052003234	FWD	USDMXN	05/20/2021	(800,000)	24.336	19,468,800
2020052003236	FWD	USDMXN	05/20/2021	(800,000)	24.336	19,468,800
2020071503354	FWD	USDMXN	05/20/2021	(80,000)	23.19598	1,855,679
2020071503467	FWD	USDMXN	05/20/2021	(1,152)	23.17374	26,700
2020090903472	FWD	USDMXN	05/20/2021	34,000	22.12032	(752,091)
2020090903491	FWD	USDMXN	05/20/2021	(34,000)	22.1971	754,701
2020102303710	FWD	USDMXN	05/20/2021	125,000	21.36939	(2,671,174)
2020113003063	FWD	USDMXN	05/20/2021	800,000	20.4396	(16,351,680)
2020113003122	FWD	USDMXN	05/20/2021	(800,000)	20.45834	16,366,670
2020120903400	FWD	USDMXN	05/20/2021	40,000	20.31139	(812,455)
2020120903198	FWD	USDMXN	05/20/2021	(40,000)	20.2596	810,384
2021011503621	FWD	USDMXN	05/20/2021	300,000	20.07336	(6,022,009)
2021011503668	FWD	USDMXN	05/20/2021	(300,000)	20.079	6,023,700
2021012003342	FWD	USDMXN	05/20/2021	89,315	19.83798	(1,771,820)
2021030303214	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,710)	21.0508	330,709
2021031003477	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,648)	21.13108	330,658
2021031903167	FWD	USDMXN	05/20/2021	100,000	20.44756	(2,044,756)
2021033003374	FWD	USDMXN	05/20/2021	150,000	20.66538	(3,099,807)
2021033103393	FWD	USDMXN	05/20/2021	150,000	20.55773	(3,083,660)
2021040803277	FWD	USDMXN	05/20/2021	1,000,000	20.24822	(20,248,223)
2021041203193	FWD	USDMXN	05/20/2021	100,000	20.17198	(2,017,198)
2021041303115	FWD	USDMXN	05/20/2021	300,000	20.17295	(6,051,885)
2021041403308	FWD	USDMXN	05/20/2021	250,000	20.10738	(5,026,846)
2021041503149	FWD	USDMXN	05/20/2021	200,000	20.03256	(4,006,513)
2021041903489	FWD	USDMXN	05/20/2021	1,000,000	19.90018	(19,900,181)
2021041903512	FWD	USDMXN	05/20/2021	(540,000)	19.89748	10,744,637
2021041903688	FWD	USDMXN	05/20/2021	(210,000)	19.90089	4,179,187
2021042003678	FWD	USDMXN	05/20/2021	100,000	20.02746	(2,002,746)
2021042303270	FWD	USDMXN	05/20/2021	500,000	19.91359	(9,956,795)
2021042603457	FWD	USDMXN	05/20/2021	41,036	19.89558	(816,441)
2021043003479	FWD	USDMXN	05/20/2021	(345,000)	20.26251	6,990,566
2021050303006	FWD	USDMXN	05/20/2021	(474)	20.30294	9,629
2021050603506	FWD	USDMXN	05/20/2021	250,000	20.16813	(5,042,033)
2021051303505	FWD	USDMXN	05/20/2021	1,000,000	19.95468	(19,954,684)
2021051303001	FWD	USDMXN	05/20/2021	(80,000)	20.15742	1,612,593
2021051303542	FWD	USDMXN	05/20/2021	(829)	19.93661	16,526
2021051803517	FWD	MXNUSD	05/20/2021	418,600,000	19.85096	(21,087,141)
2021052003147	FWD	USDMXN	05/20/2021	(10,000,000)	19.89	198,900,000
2021052003293	FWD	USDMXN	05/20/2021	(3,513,174)	19.925	70,000,000
2021052003342	FWD	USDMXN	05/20/2021	(20,000,000)	19.913	398,260,000
2020090903345	FWD	USDMXN	05/21/2021	200,000	22.08219	(4,416,437)
2020090903320	FWD	USDMXN	05/21/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020110503216	FWD	USDMXN	05/21/2021	25,000	21.1791	(529,477)
2020110503015	FWD	USDMXN	05/21/2021	(25,000)	21.211	530,275
2020112003296	FWD	USDMXN	05/21/2021	50,000	20.53949	(1,026,975)
2020112003310	FWD	USDMXN	05/21/2021	(50,000)	20.5511	1,027,555
2020123003158	FWD	USDMXN	05/21/2021	250,000	20.16806	(5,042,014)
2020123003145	FWD	USDMXN	05/21/2021	(250,000)	20.3233	5,080,825
2021012203129	FWD	USDMXN	05/21/2021	5,000,000	20.21	(101,050,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012203131	FWD	USDMXN	05/21/2021	(5,000,000)	20.23432	101,171,585
2021031603222	FWD	USDMXN	05/21/2021	350,000	20.71389	(7,249,863)
2021031603495	FWD	USDMXN	05/21/2021	51,730	20.70426	(1,071,024)
2021040603495	FWD	USDMXN	05/21/2021	99,356	20.24745	(2,011,707)
2021041303391	FWD	USDMXN	05/21/2021	200,000	20.13153	(4,026,306)
2021041403185	FWD	USDMXN	05/21/2021	700,000	20.15007	(14,105,049)
2021042603398	FWD	USDMXN	05/21/2021	41,000	19.9203	(816,732)
2021042603473	FWD	USDMXN	05/21/2021	31	19.90753	(622)
2021050703321	FWD	USDMXN	05/21/2021	15,000	19.93252	(298,988)
2021051203538	FWD	USDMXN	05/21/2021	(359,000)	20.18721	7,247,209
2021051803158	FWD	USDMXN	05/21/2021	1,000,000	19.8266	(19,826,600)
2021052003148	FWD	USDMXN	05/21/2021	10,000,000	19.89235	(198,923,500)
2021052003294	FWD	USDMXN	05/21/2021	3,512,769	19.9273	(70,000,000)
2021052003343	FWD	USDMXN	05/21/2021	20,000,000	19.91533	(398,306,500)
2021052103088	FWD	USDMXN	05/21/2021	1,000,000	19.95	(19,950,000)
2020060803202	FWD	USDMXN	05/24/2021	112,176	22.58266	(2,533,232)
2020060803143	FWD	USDMXN	05/24/2021	(112,176)	22.59773	2,534,923
2021040603224	FWD	USDMXN	05/24/2021	100,000	20.25812	(2,025,812)
2021041503829	FWD	USDMXN	05/24/2021	750,000	19.97375	(14,980,310)
2021042303272	FWD	USDMXN	05/24/2021	500,000	19.92245	(9,961,225)
2021042603405	FWD	USDMXN	05/24/2021	69,000	19.92701	(1,374,964)
2021042603474	FWD	USDMXN	05/24/2021	215	19.91438	(4,273)
2021042903207	FWD	USDMXN	05/24/2021	36,000	20.13877	(724,996)
2021042903200	FWD	USDMXN	05/24/2021	(10,000,000)	20.11538	201,153,773
2021050703001	FWD	USDMXN	05/24/2021	(500,000)	20.08882	10,044,412
2021051203539	FWD	USDMXN	05/24/2021	(532,000)	20.19385	10,743,129
2021052103089	FWD	USDMXN	05/24/2021	(1,000,000)	19.9571	19,957,100
2021052103090	FWD	USDMXN	05/24/2021	(1,500,000)	19.95	29,925,000
2021012603335	FWD	USDMXN	05/25/2021	103,000	20.26528	(2,087,324)
2021012603476	FWD	USDMXN	05/25/2021	83	20.25493	(1,687)
2021030303553	FWD	USDMXN	05/25/2021	600,000	21.13885	(12,683,310)
2021032603299	FWD	USDMXN	05/25/2021	50,000	20.73382	(1,036,691)
2021040803545	FWD	USDMXN	05/25/2021	26,500	20.18262	(534,840)
2021041303407	FWD	USDMXN	05/25/2021	1,061,786	20.13365	(21,377,628)
2021041403183	FWD	USDMXN	05/25/2021	500,000	20.15885	(10,079,426)
2021042103635	FWD	USDMXN	05/25/2021	45,750	19.96337	(913,324)
2021042303614	FWD	USDMXN	05/25/2021	195,650	19.89684	(3,892,816)
2021042603409	FWD	USDMXN	05/25/2021	69,000	19.92281	(1,374,674)
2021042603477	FWD	USDMXN	05/25/2021	225	19.91568	(4,479)
2021042803225	FWD	USDMXN	05/25/2021	8,500	20.00886	(170,076)
2021042803364	FWD	USDMXN	05/25/2021	19	20.01254	(375)
2021050703322	FWD	USDMXN	05/25/2021	15,000	19.94166	(299,125)
2021051203540	FWD	USDMXN	05/25/2021	(276,000)	20.19607	5,574,114
2021051803313	FWD	USDMXN	05/25/2021	125,000	19.81657	(2,477,071)
2021052503394	FWD	USDMXN	05/25/2021	(20,000,000)	19.91	398,200,000
2020060803103	FWD	USDMXN	05/26/2021	110,000	22.62745	(2,489,020)
2020060803090	FWD	USDMXN	05/26/2021	(110,000)	22.64593	2,491,053
2020060803203	FWD	USDMXN	05/26/2021	(112,176)	22.57673	2,532,566
2020070103285	FWD	USDMXN	05/26/2021	(107,368)	23.66081	2,540,410
2020071303150	FWD	USDMXN	05/26/2021	(4,154)	23.26926	96,650
2020071303151	FWD	USDMXN	05/26/2021	(105,021)	23.29503	2,446,467
2020100503487	FWD	USDMXN	05/26/2021	600,000	21.90827	(13,144,960)
2020100503223	FWD	USDMXN	05/26/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503544	FWD	USDMXN	05/26/2021	900,000	21.25025	(19,125,226)
2020110503403	FWD	USDMXN	05/26/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021010703258	FWD	USDMXN	05/26/2021	(43,567)	20.25918	882,622

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011403550	FWD	USDMXN	05/26/2021	(44,046)	19.98625	880,319
2021012103413	FWD	USDMXN	05/26/2021	(44,002)	20.01378	880,650
2021020403164	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,760)	20.60724	881,165
2021020403366	FWD	USDMXN	05/26/2021	(100,000)	20.67328	2,067,328
2021021803234	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,658)	20.63185	880,122
2021022203065	FWD	USDMXN	05/26/2021	(50,000)	20.98708	1,049,354
2021022503447	FWD	USDMXN	05/26/2021	(41,905)	21.02638	881,105
2021031203005	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,091)	20.8266	876,616
2021031803549	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,760)	20.54554	878,526
2021032503407	FWD	USDMXN	05/26/2021	(42,208)	20.8602	880,473
2021040803297	FWD	USDMXN	05/26/2021	1,100,000	20.18212	(22,200,333)
2021040803354	FWD	USDMXN	05/26/2021	250,000	20.19109	(5,047,772)
2021042103687	FWD	USDMXN	05/26/2021	315,000	19.97063	(6,290,749)
2021042103744	FWD	USDMXN	05/26/2021	17,000	19.97068	(339,502)
2021050703433	FWD	USDMXN	05/26/2021	750,000	20.03161	(15,023,705)
2021051303355	FWD	USDMXN	05/26/2021	100,000	20.01005	(2,001,005)
2021052103091	FWD	USDMXN	05/26/2021	1,500,000	19.9545	(29,931,750)
2021052503395	FWD	USDMXN	05/26/2021	20,000,000	19.9125	(398,250,000)
2021052603017	FWD	USDMXN	05/26/2021	(25,000,000)	19.865	496,625,000
2021052603019	FWD	USDMXN	05/26/2021	(25,169,897)	19.865	500,000,000
2021052603076	FWD	USDMXN	05/26/2021	(1,500,000)	19.86	29,790,000
2021052603484	FWD	USDMXN	05/26/2021	(1)	19.89352	20
2020091003212	FWD	USDMXN	05/27/2021	34,000	21.92441	(745,430)
2020091003180	FWD	USDMXN	05/27/2021	(34,000)	22.059	750,006
2020091003332	FWD	USDMXN	05/27/2021	(34,000)	21.99818	747,938
2020102303711	FWD	USDMXN	05/27/2021	125,000	21.38744	(2,673,430)
2020110503349	FWD	USDMXN	05/27/2021	45,000	21.29159	(958,122)
2020110503726	FWD	USDMXN	05/27/2021	(45,000)	21.3974	962,883
2020120903401	FWD	USDMXN	05/27/2021	40,000	20.32694	(813,078)
2020120903200	FWD	USDMXN	05/27/2021	(40,000)	20.2755	811,020
2021011503622	FWD	USDMXN	05/27/2021	300,000	20.08945	(6,026,834)
2021011503672	FWD	USDMXN	05/27/2021	(300,000)	20.1	6,030,000
2021030403007	FWD	USDMXN	05/27/2021	(1,000,000)	21.01005	21,010,054
2021030503155	FWD	USDMXN	05/27/2021	(500,000)	21.39235	10,696,177
2021031803623	FWD	USDMXN	05/27/2021	1,500,000	20.57273	(30,859,095)
2021031903168	FWD	USDMXN	05/27/2021	100,000	20.46314	(2,046,314)
2021032403092	FWD	USDMXN	05/27/2021	(500,000)	20.97353	10,486,766
2021033003375	FWD	USDMXN	05/27/2021	150,000	20.68124	(3,102,186)
2021033103383	FWD	USDMXN	05/27/2021	500,000	20.64213	(10,321,065)
2021033103395	FWD	USDMXN	05/27/2021	150,000	20.57369	(3,086,054)
2021041203194	FWD	USDMXN	05/27/2021	100,000	20.18718	(2,018,718)
2021041303116	FWD	USDMXN	05/27/2021	300,000	20.18826	(6,056,478)
2021041503470	FWD	USDMXN	05/27/2021	250,000	20.09174	(5,022,934)
2021041903488	FWD	USDMXN	05/27/2021	250,000	19.94959	(4,987,399)
2021042603248	FWD	USDMXN	05/27/2021	1,500,000	19.9167	(29,875,047)
2021050603536	FWD	USDMXN	05/27/2021	250,000	20.12709	(5,031,772)
2021052503518	FWD	USDMXN	05/27/2021	215,000	19.89081	(4,276,524)
2021052503273	FWD	USDMXN	05/27/2021	(441,000)	19.903	8,777,223
2021052603018	FWD	USDMXN	05/27/2021	25,000,000	19.86748	(496,686,875)
2021052603020	FWD	USDMXN	05/27/2021	25,166,793	19.86745	(500,000,000)
2021052703054	FWD	USDMXN	05/27/2021	(25,110,486)	19.912	500,000,000
2021052703230	FWD	USDMXN	05/27/2021	(20,000,000)	19.945	398,900,000
2020012303309	FWD	USDMXN	05/28/2021	300,000	20.1045	(6,031,350)
2020012303326	FWD	USDMXN	05/28/2021	(300,000)	20.12508	6,037,524
2020031203149	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	23.01	(2,301,000)
2020031203131	FWD	USDMXN	05/28/2021	(100,000)	24.03682	2,403,682

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020031803360	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	24.6122	(2,461,220)
2020031803394	FWD	USDMXN	05/28/2021	(100,000)	25.51	2,551,000
2020052903222	FWD	USDMXN	05/28/2021	760,000	23.25097	(17,670,741)
2020052903129	FWD	USDMXN	05/28/2021	(760,000)	23.266	17,682,160
2020060903055	FWD	USDMXN	05/28/2021	760,000	22.705	(17,255,800)
2020060903261	FWD	USDMXN	05/28/2021	(760,000)	22.71057	17,260,036
2020082703572	FWD	USDMXN	05/28/2021	424,328	22.67053	(9,619,738)
2020082703581	FWD	USDMXN	05/28/2021	(424,328)	22.6967	9,630,845
2020110503217	FWD	USDMXN	05/28/2021	25,000	21.19595	(529,899)
2020110503016	FWD	USDMXN	05/28/2021	(25,000)	21.211	530,275
2020110603586	FWD	USDMXN	05/28/2021	200,000	21.03061	(4,206,121)
2020110603567	FWD	USDMXN	05/28/2021	(100,000)	21.0799	2,107,990
2020110603568	FWD	USDMXN	05/28/2021	(100,000)	21.0799	2,107,990
2020111003513	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	20.78863	(2,078,863)
2020111003412	FWD	USDMXN	05/28/2021	(100,000)	24.6122	2,461,220
2020112003297	FWD	USDMXN	05/28/2021	50,000	20.5566	(1,027,830)
2020112003311	FWD	USDMXN	05/28/2021	(50,000)	20.5511	1,027,555
2020120303416	FWD	USDMXN	05/28/2021	980,100	20.28099	(19,877,402)
2020120303271	FWD	USDMXN	05/28/2021	(980,100)	20.2892	19,885,445
2020121703683	FWD	USDMXN	05/28/2021	106,000	20.16893	(2,137,907)
2020121703639	FWD	USDMXN	05/28/2021	(106,000)	20.176	2,138,656
2020123003159	FWD	USDMXN	05/28/2021	250,000	20.18437	(5,046,092)
2020123003148	FWD	USDMXN	05/28/2021	(250,000)	20.3381	5,084,525
2021011903504	FWD	USDMXN	05/28/2021	50,000	19.9845	(999,225)
2021011903491	FWD	USDMXN	05/28/2021	(50,000)	20.031	1,001,550
2021012803644	FWD	USDMXN	05/28/2021	46,439	20.45084	(949,718)
2021012803640	FWD	USDMXN	05/28/2021	(46,439)	20.44635	949,510
2021022303263	FWD	USDMXN	05/28/2021	2,565,976	20.80021	(53,372,829)
2021022303446	FWD	USDMXN	05/28/2021	450,000	20.73362	(9,330,127)
2021022403422	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	20.61539	(2,061,539)
2021031103530	FWD	USDMXN	05/28/2021	336,462	20.82514	(7,006,868)
2021031603023	FWD	USDMXN	05/28/2021	76	20.77215	(1,578)
2021031603223	FWD	USDMXN	05/28/2021	350,000	20.72965	(7,255,376)
2021031603496	FWD	USDMXN	05/28/2021	106,324	20.71988	(2,203,020)
2021032603486	FWD	USDMXN	05/28/2021	635,000	20.72344	(13,159,381)
2021040503488	FWD	USDMXN	05/28/2021	7	20.46924	(133)
2021040503470	FWD	USDMXN	05/28/2021	(4,000,000)	20.46838	81,873,528
2021040503471	FWD	USDMXN	05/28/2021	(485,700)	20.46959	9,942,078
2021040603225	FWD	USDMXN	05/28/2021	100,000	20.26708	(2,026,708)
2021040603496	FWD	USDMXN	05/28/2021	605,204	20.26304	(12,263,267)
2021041403188	FWD	USDMXN	05/28/2021	180,000	20.16546	(3,629,783)
2021041903256	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.92776	(8,768,213)
2021041903408	FWD	USDMXN	05/28/2021	1,000,000	19.89777	(19,897,769)
2021042003259	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.91737	(8,763,641)
2021042003385	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.97198	(8,787,671)
2021042103329	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.95223	(8,778,980)
2021042203678	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	20.02328	(8,810,242)
2021042303391	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.91625	(8,763,151)
2021042603574	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.90673	(8,758,961)
2021042603588	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	19.94971	(8,777,874)
2021042703347	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	20.03819	(8,816,805)
2021042803154	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	20.0397	(8,817,470)
2021042903405	FWD	USDMXN	05/28/2021	(738,000)	20.10496	14,837,457
2021042903406	FWD	USDMXN	05/28/2021	(748)	20.10746	15,043
2021043003451	FWD	USDMXN	05/28/2021	440,000	20.2164	(8,895,218)
2021050303043	FWD	USDMXN	05/28/2021	740,000	20.2124	(14,957,173)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021050603408	FWD	USDMXN	05/28/2021	599,200	20.15932	(12,079,465)
2021050603452	FWD	USDMXN	05/28/2021	5	20.16568	(97)
2021050703323	FWD	USDMXN	05/28/2021	15,000	19.94848	(299,227)
2021051103285	FWD	USDMXN	05/28/2021	129,005	19.94834	(2,573,435)
2021051103301	FWD	USDMXN	05/28/2021	4,000,000	19.9447	(79,778,812)
2021051203541	FWD	USDMXN	05/28/2021	(159,000)	20.20271	3,212,230
2021052703055	FWD	USDMXN	05/28/2021	25,107,365	19.91448	(500,000,000)
2021052703231	FWD	USDMXN	05/28/2021	20,000,000	19.94755	(398,951,000)
2021052703096	FWD	USDMXN	05/28/2021	(20,000,000)	19.91297	398,259,450
2021052803066	FWD	USDMXN	05/28/2021	(10,000,000)	19.955	199,550,000
2021052803118	FWD	USDMXN	05/28/2021	(50,000,000)	19.98	999,000,000
2021052803562	FWD	USDMXN	05/28/2021	(10,000,000)	19.913	199,130,000
2021011803332	FWD	USDMXN	06/01/2021	100,000	20.01102	(2,001,103)
2021011803298	FWD	USDMXN	06/01/2021	(100,000)	20.0501	2,005,010
2021022403423	FWD	USDMXN	06/01/2021	100,000	20.62362	(2,062,362)
2021040803544	FWD	USDMXN	06/01/2021	23,000	20.198	(464,554)
2021041903460	FWD	USDMXN	06/01/2021	26,000	19.90495	(517,529)
2021042703300	FWD	USDMXN	06/01/2021	40,900	20.06345	(820,595)
2021042803559	FWD	USDMXN	06/01/2021	48,850	19.96731	(975,403)
2021050303101	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.23824	(8,904,825)
2021050303162	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.2713	(20,270)
2021050303223	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.2611	(8,914,884)
2021050303267	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.26501	(20,265)
2021050403126	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.30529	(8,934,330)
2021050403215	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.32453	(20,324)
2021050503172	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.28464	(8,925,240)
2021050503378	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.32752	(20,327)
2021050603336	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.25968	(8,914,260)
2021050603340	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.17713	(20,177)
2021050703313	FWD	USDMXN	06/01/2021	382,000	19.95745	(7,623,746)
2021051003209	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	19.93119	(8,769,724)
2021051003214	FWD	USDMXN	06/01/2021	756	19.92918	(15,067)
2021051003243	FWD	USDMXN	06/01/2021	244	19.93402	(4,863)
2021051003423	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	19.92308	(8,766,156)
2021051003458	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	19.96305	(19,963)
2021051103094	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	19.9101	(8,760,446)
2021051103180	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	19.89942	(19,899)
2021051103271	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	19.89026	(8,751,717)
2021051103272	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	19.94618	(19,946)
2021051203473	FWD	USDMXN	06/01/2021	440,000	20.16088	(8,870,789)
2021051203488	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,000	20.16642	(20,166)
2021051303450	FWD	USDMXN	06/01/2021	130,978	20.00472	(2,620,181)
2021051303328	FWD	USDMXN	06/01/2021	(182,000)	20.01505	3,642,739
2021051403589	FWD	USDMXN	06/01/2021	382,000	19.89082	(7,598,294)
2021051703498	FWD	USDMXN	06/01/2021	(13,067)	19.81128	258,867
2021051803058	FWD	USDMXN	06/01/2021	(93,000)	19.85447	1,846,466
2021051803105	FWD	USDMXN	06/01/2021	(31,000)	19.81735	614,338
2021051803334	FWD	USDMXN	06/01/2021	(432)	19.8517	8,577
2021051803362	FWD	USDMXN	06/01/2021	(1,160)	19.85971	23,041
2021051803586	FWD	USDMXN	06/01/2021	(82,000)	19.86468	1,628,903
2021051803644	FWD	USDMXN	06/01/2021	(1,509)	19.85634	29,966
2021051903250	FWD	USDMXN	06/01/2021	64,000	19.83983	(1,269,749)
2021052003470	FWD	USDMXN	06/01/2021	(492,000)	19.94443	9,812,657
2021052403071	FWD	USDMXN	06/01/2021	(251,000)	19.88258	4,990,529
2021052403313	FWD	USDMXN	06/01/2021	(636)	19.90125	12,650
2021052603077	FWD	USDMXN	06/01/2021	1,500,000	19.8742	(29,811,300)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021052703097	FWD	USDMXN	06/01/2021	20,000,000	19.9233	(398,466,000)
2021052803067	FWD	USDMXN	06/01/2021	10,000,000	19.9653	(199,653,000)
2021052803119	FWD	USDMXN	06/01/2021	50,000,000	19.9905	(999,525,000)
2021052803563	FWD	USDMXN	06/01/2021	10,000,000	19.923	(199,230,000)
2021060103376	FWD	USDMXN	06/01/2021	50,000,000	19.955	(997,750,000)
2021060103054	FWD	USDMXN	06/01/2021	(50,000,000)	19.874	993,700,000
2021060103099	FWD	USDMXN	06/01/2021	(20,000,000)	19.872	397,440,000
2021060103313	FWD	USDMXN	06/01/2021	(2,000,000)	19.95	39,900,000
2021060103378	FWD	USDMXN	06/01/2021	(50,000,000)	19.95	997,500,000
2020100503488	FWD	USDMXN	06/02/2021	600,000	21.92592	(13,155,553)
2020100503224	FWD	USDMXN	06/02/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503545	FWD	USDMXN	06/02/2021	900,000	21.26762	(19,140,859)
2020110503404	FWD	USDMXN	06/02/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021022503653	FWD	USDMXN	06/02/2021	(100,000)	21.16349	2,116,350
2021040803299	FWD	USDMXN	06/02/2021	1,100,000	20.19757	(22,217,323)
2021041503393	FWD	USDMXN	06/02/2021	300,000	20.01357	(6,004,071)
2021041603510	FWD	USDMXN	06/02/2021	500,000	19.99217	(9,996,084)
2021042003070	FWD	USDMXN	06/02/2021	250,000	19.89779	(4,974,447)
2021042103688	FWD	USDMXN	06/02/2021	315,000	19.98629	(6,295,682)
2021042103746	FWD	USDMXN	06/02/2021	17,000	19.98635	(339,768)
2021050703434	FWD	USDMXN	06/02/2021	750,000	20.04749	(15,035,617)
2021051303357	FWD	USDMXN	06/02/2021	100,000	20.02157	(2,002,157)
2021051903079	FWD	USDMXN	06/02/2021	(5,000)	19.83554	99,178
2021051903341	FWD	USDMXN	06/02/2021	(604)	19.93068	12,029
2021052003239	FWD	USDMXN	06/02/2021	(15,000)	19.93727	299,059
2021052003485	FWD	USDMXN	06/02/2021	(554)	19.92932	11,037
2021052003557	FWD	USDMXN	06/02/2021	(121,000)	19.89982	2,407,878
2021052003564	FWD	USDMXN	06/02/2021	(493)	19.9039	9,811
2021052103448	FWD	USDMXN	06/02/2021	(13,000)	19.98657	259,825
2021052103501	FWD	USDMXN	06/02/2021	(205)	19.9753	4,096
2021052403072	FWD	USDMXN	06/02/2021	(100,000)	19.88503	1,988,503
2021052403314	FWD	USDMXN	06/02/2021	(629)	19.90298	12,518
2021052803420	FWD	USDMXN	06/02/2021	500,000	19.91332	(9,956,660)
2021060103055	FWD	USDMXN	06/02/2021	50,000,000	19.87625	(993,812,500)
2021060103100	FWD	USDMXN	06/02/2021	20,000,000	19.87435	(397,487,000)
2021060103373	FWD	USDMXN	06/02/2021	50,000,000	19.959	(997,950,000)
2021060103071	FWD	USDMXN	06/02/2021	(50,000,000)	19.855	992,750,000
2021060103377	FWD	USDMXN	06/02/2021	(50,000,000)	19.95718	997,859,000
2020082503342	FWD	USDMXN	06/03/2021	34,000	22.62822	(769,360)
2020082503362	FWD	USDMXN	06/03/2021	(34,000)	22.6965	771,681
2020082803183	FWD	MXNUSD	06/03/2021	(9,082,706)	22.58056	402,236
2020082803186	FWD	MXNUSD	06/03/2021	(103,328,790)	22.59062	4,573,968
2020082803188	FWD	MXNUSD	06/03/2021	(79,434,564)	22.58642	3,516,916
2020082803456	FWD	USDMXN	06/03/2021	(92,967)	22.57727	2,098,935
2020092903456	FWD	USDMXN	06/03/2021	91,045	23.04907	(2,098,514)
2020092903392	FWD	USDMXN	06/03/2021	(8,491,199)	22.59352	191,846,060
2020102303712	FWD	USDMXN	06/03/2021	125,000	21.40543	(2,675,679)
2021032303043	FWD	USDMXN	06/03/2021	114,000	20.78956	(2,370,010)
2021032303478	FWD	USDMXN	06/03/2021	467	20.9539	(9,783)
2021040603267	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	20.36105	(610,832)
2021040803215	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	20.21585	(606,476)
2021041503284	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	20.1012	(603,036)
2021041603272	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	19.99145	(599,744)
2021041903630	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	19.93003	(597,901)
2021050603205	FWD	USDMXN	06/03/2021	10,000	20.20175	(202,018)
2021050603448	FWD	USDMXN	06/03/2021	(10,000)	20.17016	201,702

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021050703721	FWD	USDMXN	06/03/2021	500,000	19.98484	(9,992,422)
2021051003508	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	19.93369	(598,011)
2021051103161	FWD	USDMXN	06/03/2021	30,000	19.89887	(596,967)
2021051703512	FWD	USDMXN	06/03/2021	500,000	19.81321	(9,906,604)
2021051803343	FWD	USDMXN	06/03/2021	60,000	19.81554	(1,188,932)
2021052003142	FWD	USDMXN	06/03/2021	(28,000)	19.91316	557,569
2021052003471	FWD	USDMXN	06/03/2021	(177,000)	19.9489	3,530,956
2021052003486	FWD	USDMXN	06/03/2021	(567)	19.93103	11,303
2021052403015	FWD	USDMXN	06/03/2021	(21,000)	19.96799	419,328
2021052403075	FWD	USDMXN	06/03/2021	(201,000)	19.8844	3,996,765
2021052403315	FWD	USDMXN	06/03/2021	(433)	19.90467	8,624
2021060103072	FWD	USDMXN	06/03/2021	50,000,000	19.85735	(992,867,500)
2021060103379	FWD	USDMXN	06/03/2021	50,000,000	19.9536	(997,680,000)
2021060103374	FWD	USDMXN	06/03/2021	(50,000,000)	19.9613	998,065,000
2021060303057	FWD	USDMXN	06/03/2021	40,000,000	20.06	(802,400,000)
2021060303101	FWD	USDMXN	06/03/2021	(50,000,000)	20.05	1,002,500,000
2021060303105	FWD	USDMXN	06/03/2021	(5,000,000)	20.03484	100,174,205
2020060803208	FWD	USDMXN	06/04/2021	(141)	22.60153	3,187
2020090903346	FWD	USDMXN	06/04/2021	200,000	22.11928	(4,423,857)
2020090903321	FWD	USDMXN	06/04/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020112703162	FWD	USDMXN	06/04/2021	100,000	20.49456	(2,049,456)
2020112703133	FWD	USDMXN	06/04/2021	(100,000)	20.526	2,052,600
2020120103437	FWD	USDMXN	06/04/2021	65,000	20.44986	(1,329,241)
2020120103426	FWD	USDMXN	06/04/2021	(65,000)	20.4897	1,331,831
2020120403355	FWD	USDMXN	06/04/2021	25,000	20.13535	(503,384)
2020120403246	FWD	USDMXN	06/04/2021	(25,000)	20.1823	504,558
2020120903522	FWD	USDMXN	06/04/2021	100,000	20.29327	(2,029,328)
2020120903492	FWD	USDMXN	06/04/2021	(100,000)	20.36	2,036,000
2021021103198	FWD	USDMXN	06/04/2021	250,000	20.21978	(5,054,946)
2021031603497	FWD	USDMXN	06/04/2021	165,598	20.7355	(3,433,754)
2021032303046	FWD	USDMXN	06/04/2021	114,000	20.7882	(2,369,855)
2021032303479	FWD	USDMXN	06/04/2021	641	20.9553	(13,425)
2021040603497	FWD	USDMXN	06/04/2021	220,015	20.27863	(4,461,597)
2021041603203	FWD	USDMXN	06/04/2021	(50,000)	20.00838	1,000,419
2021051203474	FWD	USDMXN	06/04/2021	50,000	20.17389	(1,008,695)
2021052003533	FWD	USDMXN	06/04/2021	(148,000)	19.95119	2,952,777
2021052403078	FWD	USDMXN	06/04/2021	(251,000)	19.88177	4,990,325
2021052403317	FWD	USDMXN	06/04/2021	(636)	19.90648	12,653
2021060103314	FWD	USDMXN	06/04/2021	2,000,000	19.9566	(39,913,200)
2021060203284	FWD	USDMXN	06/04/2021	1,000,000	19.91175	(19,911,750)
2021060203240	FWD	USDMXN	06/04/2021	(471,150)	19.91582	9,383,339
2021060203299	FWD	USDMXN	06/04/2021	(299,400)	19.91804	5,963,461
2021060203301	FWD	USDMXN	06/04/2021	(298,200)	19.91833	5,939,646
2021060203330	FWD	USDMXN	06/04/2021	(226,489)	19.89408	4,505,790
2021060203332	FWD	USDMXN	06/04/2021	(144,344)	19.89446	2,871,646
2021060203334	FWD	USDMXN	06/04/2021	(2,417)	19.89435	48,077
2021060303083	FWD	USDMXN	06/04/2021	40,000,000	20.03	(801,200,000)
2021060303058	FWD	USDMXN	06/04/2021	(40,000,000)	20.0622	802,488,000
2021060303267	FWD	USDMXN	06/04/2021	(2,000,000)	20.1	40,200,000
2020112303043	FWD	USDMXN	06/07/2021	250,000	20.49269	(5,123,174)
2020112303032	FWD	USDMXN	06/07/2021	(250,000)	20.495	5,123,750
2020112403118	FWD	USDMXN	06/07/2021	253,800	20.48605	(5,199,359)
2020112403022	FWD	USDMXN	06/07/2021	(253,800)	20.4885	5,199,981
2020112703387	FWD	USDMXN	06/07/2021	250,000	20.51425	(5,128,563)
2020112703420	FWD	USDMXN	06/07/2021	(250,000)	20.516	5,129,000
2021032303050	FWD	USDMXN	06/07/2021	114,000	20.7553	(2,366,105)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021032303480	FWD	USDMXN	06/07/2021	527	20.96325	(11,046)
2021051803314	FWD	USDMXN	06/07/2021	80,000	19.84615	(1,587,692)
2021052003534	FWD	USDMXN	06/07/2021	(287,000)	19.95792	5,727,924
2021052003535	FWD	USDMXN	06/07/2021	(115,000)	19.95792	2,295,161
2021052403084	FWD	USDMXN	06/07/2021	(301,000)	19.88139	5,984,297
2021052403318	FWD	USDMXN	06/07/2021	(978)	19.90941	19,471
2021052603296	FWD	USDMXN	06/07/2021	50,000	19.8785	(993,926)
2021052603504	FWD	USDMXN	06/07/2021	(214,000)	19.92041	4,262,967
2021060303102	FWD	USDMXN	06/07/2021	50,000,000	20.058	(1,002,900,000)
2021060303580	FWD	USDMXN	06/07/2021	400,000	20.1708	(8,068,320)
2021060303084	FWD	USDMXN	06/07/2021	(40,000,000)	20.0372	801,488,000
2021060703102	FWD	USDMXN	06/07/2021	50,000,000	19.77	(988,500,000)
2021060703153	FWD	USDMXN	06/07/2021	(50,000,000)	19.78	989,000,000
2020092903052	FWD	USDMXN	06/08/2021	2,109,887	22.89665	(48,309,340)
2020092903123	FWD	USDMXN	06/08/2021	(2,109,887)	22.8985	48,313,247
2021011803333	FWD	USDMXN	06/08/2021	100,000	20.02648	(2,002,648)
2021011803301	FWD	USDMXN	06/08/2021	(100,000)	20.0643	2,006,430
2021040703083	FWD	USDMXN	06/08/2021	1,000,000	20.29024	(20,290,235)
2021041903542	FWD	USDMXN	06/08/2021	27,051	19.9253	(539,000)
2021052403087	FWD	USDMXN	06/08/2021	(251,000)	19.88436	4,990,975
2021052403322	FWD	USDMXN	06/08/2021	(598)	19.91407	11,902
2021052603505	FWD	USDMXN	06/08/2021	(275,000)	19.92266	5,478,732
2021060303268	FWD	USDMXN	06/08/2021	2,000,000	20.1092	(40,218,400)
2021060403243	FWD	USDMXN	06/08/2021	(442,300)	19.92464	8,812,668
2021060403535	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9422	19,942,200
2021060403568	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9458	19,945,800
2021060403570	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9484	19,948,400
2021060403572	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9486	19,948,600
2021060403574	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.947	19,947,000
2021060403576	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9505	19,950,500
2021060403580	FWD	USDMXN	06/08/2021	(1,000,000)	19.9505	19,950,500
2021060703137	FWD	USDMXN	06/08/2021	50,000,000	19.802	(990,100,000)
2021060703103	FWD	USDMXN	06/08/2021	(50,000,000)	19.7723	988,615,000
2021060803530	FWD	USDMXN	06/08/2021	(2,000,000)	19.72	39,440,000
2021061003562	FWD	USDMXN	06/08/2021	8,600,000	19.77	(170,022,000)
2020100503489	FWD	USDMXN	06/09/2021	600,000	21.94394	(13,166,366)
2020100503225	FWD	USDMXN	06/09/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503546	FWD	USDMXN	06/09/2021	900,000	21.28499	(19,156,491)
2020110503405	FWD	USDMXN	06/09/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020121603225	FWD	USDMXN	06/09/2021	250,000	20.33502	(5,083,756)
2020121603078	FWD	USDMXN	06/09/2021	(250,000)	20.333	5,083,250
2020121703144	FWD	USDMXN	06/09/2021	250,000	20.19395	(5,048,488)
2020121703084	FWD	USDMXN	06/09/2021	(250,000)	20.193	5,048,250
2020122403088	FWD	USDMXN	06/09/2021	300,000	20.26891	(6,080,674)
2020122403082	FWD	USDMXN	06/09/2021	(300,000)	20.285	6,085,500
2021010603408	FWD	USDMXN	06/09/2021	50,000	19.95838	(997,919)
2021010603527	FWD	USDMXN	06/09/2021	(50,000)	20.01125	1,000,563
2021010703261	FWD	USDMXN	06/09/2021	(58,056)	20.29494	1,178,248
2021011403551	FWD	USDMXN	06/09/2021	(24,920)	20.01629	498,814
2021011403554	FWD	USDMXN	06/09/2021	(33,777)	20.03369	676,673
2021012003151	FWD	USDMXN	06/09/2021	1,100,000	19.89527	(21,884,797)
2021012003150	FWD	USDMXN	06/09/2021	(1,100,000)	19.9078	21,898,580
2021012103414	FWD	USDMXN	06/09/2021	(20,584)	20.04506	412,600
2021012103417	FWD	USDMXN	06/09/2021	(38,070)	20.07538	764,262
2021020403165	FWD	USDMXN	06/09/2021	(56,959)	20.63827	1,175,528
2021022503654	FWD	USDMXN	06/09/2021	(100,000)	21.17831	2,117,831

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030403317	FWD	USDMXN	06/09/2021	(55,984)	20.99217	1,175,234
2021031203006	FWD	USDMXN	06/09/2021	(56,115)	20.8577	1,170,438
2021031803550	FWD	USDMXN	06/09/2021	(57,039)	20.57695	1,173,685
2021032303053	FWD	USDMXN	06/09/2021	221,000	20.76195	(4,588,391)
2021032303481	FWD	USDMXN	06/09/2021	789	20.96623	(16,533)
2021040803300	FWD	USDMXN	06/09/2021	1,100,000	20.21301	(22,234,310)
2021040903366	FWD	USDMXN	06/09/2021	400,000	20.25929	(8,103,716)
2021041503830	FWD	USDMXN	06/09/2021	1,390,000	20.00883	(27,812,275)
2021041603511	FWD	USDMXN	06/09/2021	500,000	20.00778	(10,003,889)
2021042003071	FWD	USDMXN	06/09/2021	250,000	19.91305	(4,978,264)
2021042103689	FWD	USDMXN	06/09/2021	315,000	20.00199	(6,300,625)
2021042103747	FWD	USDMXN	06/09/2021	17,000	20.00205	(340,035)
2021042303571	FWD	USDMXN	06/09/2021	92,022	19.92476	(1,833,509)
2021042703355	FWD	USDMXN	06/09/2021	(253,971)	20.08141	5,100,104
2021051103099	FWD	USDMXN	06/09/2021	500,000	19.90858	(9,954,290)
2021051403473	FWD	USDMXN	06/09/2021	100,000	19.89848	(1,989,848)
2021052403090	FWD	USDMXN	06/09/2021	(251,000)	19.88704	4,991,646
2021052403323	FWD	USDMXN	06/09/2021	(572)	19.91813	11,400
2021060703154	FWD	USDMXN	06/09/2021	50,000,000	19.784	(989,200,000)
2021060703138	FWD	USDMXN	06/09/2021	(50,000,000)	19.80423	990,211,250
2021060703271	FWD	USDMXN	06/09/2021	(1,997,204)	19.79987	39,544,378
2021060703273	FWD	USDMXN	06/09/2021	(1,991,139)	19.8005	39,425,556
2021060903419	FWD	USDMXN	06/09/2021	(20,000,000)	19.735	394,700,000
2020061003397	FWD	USDMXN	06/10/2021	600,000	22.84509	(13,707,052)
2020061003363	FWD	USDMXN	06/10/2021	(600,000)	22.86	13,716,000
2020090103550	FWD	USDMXN	06/10/2021	34,000	22.40934	(761,918)
2020090103561	FWD	USDMXN	06/10/2021	(34,000)	22.5195	765,663
2020091703299	FWD	USDMXN	06/10/2021	(461,000)	21.64648	9,979,029
2020091703304	FWD	USDMXN	06/10/2021	(1,107)	21.62475	23,943
2020102303713	FWD	USDMXN	06/10/2021	125,000	21.42342	(2,677,927)
2020113003065	FWD	USDMXN	06/10/2021	600,000	20.4883	(12,292,980)
2020113003123	FWD	USDMXN	06/10/2021	(600,000)	20.50711	12,304,268
2021010703010	FWD	USDMXN	06/10/2021	(11,084)	20.09921	222,783
2021012003472	FWD	USDMXN	06/10/2021	(11,206)	19.89444	222,933
2021022403160	FWD	USDMXN	06/10/2021	(40,399)	20.73634	837,731
2021031003478	FWD	USDMXN	06/10/2021	(39,621)	21.17827	839,097
2021032403232	FWD	USDMXN	06/10/2021	(40,050)	20.95326	839,180
2021040603268	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	20.37677	(611,303)
2021040803216	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	20.23131	(606,939)
2021041403532	FWD	USDMXN	06/10/2021	500,000	20.19067	(10,095,336)
2021041503283	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	20.1167	(603,501)
2021041603274	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	20.00678	(600,203)
2021041603634	FWD	USDMXN	06/10/2021	300,000	20.0304	(6,009,120)
2021041903631	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	19.94526	(598,358)
2021042203661	FWD	USDMXN	06/10/2021	(1,300,000)	20.04691	26,060,988
2021042203668	FWD	USDMXN	06/10/2021	(57,327)	20.05161	1,149,498
2021042903404	FWD	USDMXN	06/10/2021	92	20.13559	(1,843)
2021042903377	FWD	USDMXN	06/10/2021	(400,000)	20.13113	8,052,454
2021051003210	FWD	USDMXN	06/10/2021	500,000	19.93408	(9,967,040)
2021051003507	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	19.94949	(598,485)
2021051103162	FWD	USDMXN	06/10/2021	30,000	19.91446	(597,434)
2021051803342	FWD	USDMXN	06/10/2021	60,000	19.8313	(1,189,878)
2021051803370	FWD	USDMXN	06/10/2021	500,000	19.78318	(9,891,590)
2021052403092	FWD	USDMXN	06/10/2021	(251,000)	19.89107	4,992,659
2021052403324	FWD	USDMXN	06/10/2021	(509)	19.92016	10,141
2021052603506	FWD	USDMXN	06/10/2021	(34,000)	19.92717	677,524

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021060303567	FWD	USDMXN	06/10/2021	(1,000,000)	20.16131	20,161,308
2021060403549	FWD	USDMXN	06/10/2021	(2,400,000)	19.94984	47,879,625
2021060403550	FWD	USDMXN	06/10/2021	(41,500)	19.94784	827,836
2021060403622	FWD	USDMXN	06/10/2021	(71)	19.95576	1,413
2021060903420	FWD	USDMXN	06/10/2021	20,000,000	19.73735	(394,747,000)
2021061003103	FWD	USDMXN	06/10/2021	(20,000,000)	19.707	394,140,000
2020060403308	FWD	USDMXN	06/11/2021	700,000	22.93232	(16,052,624)
2020060403124	FWD	USDMXN	06/11/2021	(700,000)	22.9	16,030,000
2020112703163	FWD	USDMXN	06/11/2021	100,000	20.51166	(2,051,166)
2020112703134	FWD	USDMXN	06/11/2021	(100,000)	20.5431	2,054,310
2020120103438	FWD	USDMXN	06/11/2021	65,000	20.46651	(1,330,323)
2020120103428	FWD	USDMXN	06/11/2021	(65,000)	20.5065	1,332,923
2020120303421	FWD	USDMXN	06/11/2021	1,366,400	20.3133	(27,756,089)
2020120303274	FWD	USDMXN	06/11/2021	(1,366,400)	20.3212	27,766,888
2020120403356	FWD	USDMXN	06/11/2021	25,000	20.15128	(503,782)
2020120403248	FWD	USDMXN	06/11/2021	(25,000)	20.1823	504,558
2020120903523	FWD	USDMXN	06/11/2021	100,000	20.3087	(2,030,870)
2020120903493	FWD	USDMXN	06/11/2021	(100,000)	20.36	2,036,000
2021021103199	FWD	USDMXN	06/11/2021	250,000	20.23534	(5,058,834)
2021032303059	FWD	USDMXN	06/11/2021	111,000	20.74737	(2,302,958)
2021032303387	FWD	USDMXN	06/11/2021	(60)	20.92123	1,258
2021040603498	FWD	USDMXN	06/11/2021	17,370	20.29436	(352,503)
2021042703482	FWD	USDMXN	06/11/2021	2,396,721	20.11886	(48,219,303)
2021050703227	FWD	USDMXN	06/11/2021	400,000	20.0894	(8,035,759)
2021051203475	FWD	USDMXN	06/11/2021	50,000	20.18976	(1,009,488)
2021052603507	FWD	USDMXN	06/11/2021	(160,000)	19.92943	3,188,709
2021060303581	FWD	USDMXN	06/11/2021	(400,000)	20.17935	8,071,740
2021060803531	FWD	USDMXN	06/11/2021	2,000,000	19.7263	(39,452,600)
2021060903067	FWD	USDMXN	06/11/2021	(500,000)	19.6074	9,803,700
2021060903069	FWD	USDMXN	06/11/2021	(500,000)	19.6067	9,803,350
2021060903526	FWD	USDMXN	06/11/2021	(442,300)	19.73083	8,726,946
2021061003104	FWD	USDMXN	06/11/2021	20,000,000	19.7092	(394,184,000)
2021061103167	FWD	USDMXN	06/11/2021	(8,900,000)	19.71	175,419,000
2021061103170	FWD	USDMXN	06/11/2021	(2,000,000)	19.92	39,840,000
2021011403357	FWD	USDMXN	06/14/2021	250,000	20.03872	(5,009,680)
2021011403375	FWD	USDMXN	06/14/2021	(250,000)	20.0415	5,010,375
2021040803510	FWD	USDMXN	06/14/2021	500,000	20.22762	(10,113,808)
2021041203385	FWD	USDMXN	06/14/2021	50,000	20.24382	(1,012,191)
2021051903251	FWD	USDMXN	06/14/2021	65,000	19.86942	(1,291,512)
2021052603508	FWD	USDMXN	06/14/2021	(421,000)	19.93625	8,393,163
2021060703216	FWD	USDMXN	06/14/2021	1,000,000	19.8035	(19,803,503)
2021061003376	FWD	USDMXN	06/14/2021	3,639,392	19.7155	(71,752,437)
2021061003034	FWD	USDMXN	06/14/2021	(4,000,000)	19.7349	78,939,600
2021061003037	FWD	USDMXN	06/14/2021	(1,727,000)	19.7146	34,047,114
2021061003360	FWD	USDMXN	06/14/2021	(471,150)	19.71097	9,286,824
2021061003374	FWD	USDMXN	06/14/2021	(1,819,696)	19.7129	35,871,487
2020030903372	FWD	USDMXN	06/15/2021	100,000	22.0587	(2,205,870)
2020030903325	FWD	USDMXN	06/15/2021	(100,000)	22.71832	2,271,832
2020091103070	FWD	USDMXN	06/15/2021	500,000	21.96098	(10,980,491)
2020091103042	FWD	USDMXN	06/15/2021	(500,000)	21.997	10,998,500
2020100803301	FWD	USDMXN	06/15/2021	180,000	22.03804	(3,966,847)
2020100803302	FWD	USDMXN	06/15/2021	8,000	22.01525	(176,122)
202011903588	FWD	USDMXN	06/15/2021	170,000	20.65467	(3,511,294)
2021010403368	FWD	USDMXN	06/15/2021	300,000	20.31769	(6,095,308)
2021010403371	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.348	6,104,400
2021011803334	FWD	USDMXN	06/15/2021	100,000	20.04194	(2,004,194)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011803306	FWD	USDMXN	06/15/2021	(100,000)	20.0793	2,007,930
2021020303083	FWD	USDMXN	06/15/2021	(100,000)	20.51415	2,051,415
2021020503118	FWD	USDMXN	06/15/2021	300,000	20.44506	(6,133,517)
2021020503003	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.7042	6,211,259
2021021703060	FWD	USDMXN	06/15/2021	35,000	20.54653	(719,129)
2021021703252	FWD	USDMXN	06/15/2021	66	20.44575	(1,353)
2021021803362	FWD	USDMXN	06/15/2021	(300,000)	20.67071	6,201,212
2021041503394	FWD	USDMXN	06/15/2021	1,000,000	20.04224	(20,042,241)
2021041503693	FWD	USDMXN	06/15/2021	50,000	20.05843	(1,002,922)
2021041903459	FWD	USDMXN	06/15/2021	50,000	19.93559	(996,780)
2021051203083	FWD	USDMXN	06/15/2021	22,900	20.10554	(460,417)
2021051303322	FWD	USDMXN	06/15/2021	25,700	20.06417	(515,649)
2021051403576	FWD	USDMXN	06/15/2021	600,000	19.91347	(11,948,080)
2021061103168	FWD	USDMXN	06/15/2021	8,900,000	19.71855	(175,495,095)
2021061503725	FWD	USDMXN	06/15/2021	(500,000)	20.04	10,020,000
2020100503490	FWD	USDMXN	06/16/2021	600,000	21.96208	(13,177,246)
2020100503226	FWD	USDMXN	06/16/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503547	FWD	USDMXN	06/16/2021	900,000	21.30235	(19,172,118)
2020110503406	FWD	USDMXN	06/16/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021011503210	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,212,908	20.20718	(24,509,451)
2021011503099	FWD	USDMXN	06/16/2021	(1,212,908)	20.251	24,562,600
2021012003322	FWD	USDMXN	06/16/2021	942,542	19.91912	(18,774,605)
2021012003627	FWD	USDMXN	06/16/2021	318,005	19.88841	(6,324,613)
2021012003226	FWD	USDMXN	06/16/2021	(942,542)	19.9662	18,818,982
2021012003570	FWD	USDMXN	06/16/2021	(318,005)	19.9372	6,340,129
2021012103208	FWD	USDMXN	06/16/2021	745,850	20.01503	(14,928,208)
2021012103157	FWD	USDMXN	06/16/2021	(745,850)	20.0648	14,965,331
2021012603494	FWD	USDMXN	06/16/2021	92,580	20.30542	(1,879,876)
2021012703790	FWD	USDMXN	06/16/2021	77,423	20.58755	(1,593,950)
2021020403613	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,848,467	20.67545	(38,217,887)
2021021203538	FWD	USDMXN	06/16/2021	111,170	20.21257	(2,247,031)
2021022503655	FWD	USDMXN	06/16/2021	(100,000)	21.19314	2,119,314
2021030303433	FWD	USDMXN	06/16/2021	20,037	21.13179	(423,418)
2021032403101	FWD	USDMXN	06/16/2021	83,901	20.96493	(1,758,979)
2021040803301	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,100,000	20.22864	(22,251,503)
2021041603512	FWD	USDMXN	06/16/2021	500,000	20.02339	(10,011,693)
2021042003072	FWD	USDMXN	06/16/2021	250,000	19.92834	(4,982,084)
2021042103690	FWD	USDMXN	06/16/2021	315,000	20.01769	(6,305,573)
2021042103748	FWD	USDMXN	06/16/2021	17,000	20.01777	(340,302)
2021042203374	FWD	USDMXN	06/16/2021	936,760	20.01307	(18,747,443)
2021042303377	FWD	USDMXN	06/16/2021	195,668	19.95345	(3,904,251)
2021042303578	FWD	USDMXN	06/16/2021	138,122	19.95188	(2,755,793)
2021042703602	FWD	USDMXN	06/16/2021	279,438	20.16259	(5,634,193)
2021043003599	FWD	USDMXN	06/16/2021	254,716	20.32615	(5,177,396)
2021050603553	FWD	USDMXN	06/16/2021	62,437	20.16694	(1,259,163)
2021051103096	FWD	USDMXN	06/16/2021	500,000	19.92425	(9,962,123)
2021051403475	FWD	USDMXN	06/16/2021	100,000	19.91427	(1,991,427)
2021052003568	FWD	USDMXN	06/16/2021	(59,000)	19.92652	1,175,665
2021052003661	FWD	USDMXN	06/16/2021	(904)	19.91478	18,000
2021052103491	FWD	USDMXN	06/16/2021	95,388	20.02478	(1,910,124)
2021052403333	FWD	USDMXN	06/16/2021	(143,000)	19.94877	2,852,674
2021052403346	FWD	USDMXN	06/16/2021	(341)	19.93581	6,789
2021052503559	FWD	USDMXN	06/16/2021	(8,229)	19.94593	164,142
2021052603246	FWD	USDMXN	06/16/2021	(13,000)	19.94587	259,296
2021052603390	FWD	USDMXN	06/16/2021	(554)	19.94794	11,047
2021052703028	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,502)	19.9311	408,634

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021052803246	FWD	USDMXN	06/16/2021	16	19.97106	(328)
2021052803627	FWD	USDMXN	06/16/2021	10,599	19.9477	(211,426)
2021052803105	FWD	USDMXN	06/16/2021	(5,000)	20.01958	100,098
2021061103171	FWD	USDMXN	06/16/2021	2,000,000	19.9302	(39,860,400)
2021061403484	FWD	USDMXN	06/16/2021	143,459	19.95727	(2,863,050)
2021061403225	FWD	USDMXN	06/16/2021	(2,000,000)	19.9117	39,823,400
2021061503726	FWD	USDMXN	06/16/2021	500,000	20.042	(10,021,000)
2021061603018	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,000,000)	20.045	400,900,000
2021061603340	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,000,000)	20.057	401,140,000
2021061603652	FWD	USDMXN	06/16/2021	(2,500,000)	20.27	50,675,000
2020090903473	FWD	USDMXN	06/17/2021	34,000	22.19471	(754,620)
2020090903494	FWD	USDMXN	06/17/2021	(34,000)	22.2714	757,228
2020102303714	FWD	USDMXN	06/17/2021	125,000	21.4414	(2,680,175)
2021040603269	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	20.39265	(611,779)
2021040803217	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	20.24704	(607,411)
2021041403533	FWD	USDMXN	06/17/2021	500,000	20.20607	(10,103,036)
2021041503285	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	20.13219	(603,966)
2021041503660	FWD	USDMXN	06/17/2021	300,000	20.11803	(6,035,410)
2021041603277	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	20.01941	(600,582)
2021041903633	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	19.9605	(598,815)
2021042103610	FWD	USDMXN	06/17/2021	200,000	20.01706	(4,003,412)
2021051003211	FWD	USDMXN	06/17/2021	500,000	19.96928	(9,984,638)
2021051003509	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	19.96521	(598,956)
2021051103163	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	19.93009	(597,903)
2021051803344	FWD	USDMXN	06/17/2021	60,000	19.8469	(1,190,814)
2021051803371	FWD	USDMXN	06/17/2021	500,000	19.82382	(9,911,912)
2021052703052	FWD	USDMXN	06/17/2021	(46,000)	19.95118	917,754
2021052703573	FWD	USDMXN	06/17/2021	(102)	20.01542	2,032
2021052803062	FWD	USDMXN	06/17/2021	(225,000)	20.00023	4,500,052
2021052803247	FWD	USDMXN	06/17/2021	(225)	19.9644	4,497
2021060703325	FWD	USDMXN	06/17/2021	30,000	19.81922	(594,577)
2021060703574	FWD	USDMXN	06/17/2021	250,000	19.80521	(4,951,302)
2021061503208	FWD	USDMXN	06/17/2021	13,000,000	20.1415	(261,839,500)
2021061503327	FWD	USDMXN	06/17/2021	3,000,000	20.1378	(60,413,400)
2021061503412	FWD	USDMXN	06/17/2021	19,000,000	20.1305	(382,479,500)
2021061603019	FWD	USDMXN	06/17/2021	20,000,000	20.0473	(400,946,000)
2021061603341	FWD	USDMXN	06/17/2021	20,000,000	20.05938	(401,187,500)
2021061603653	FWD	USDMXN	06/17/2021	2,500,000	20.2721	(50,680,250)
2021061703006	FWD	USDMXN	06/17/2021	(50,000,000)	20.49	1,024,500,000
2021061703088	FWD	USDMXN	06/17/2021	(10,000,000)	20.45099	204,509,882
2021061703091	FWD	USDMXN	06/17/2021	(10,000,000)	20.44788	204,478,790
2021061703195	FWD	USDMXN	06/17/2021	(25,000,000)	20.443	511,075,000
2021061703297	FWD	USDMXN	06/17/2021	(10,000,000)	20.46	204,600,000
2021061703626	FWD	USDMXN	06/17/2021	(10,000,000)	20.45	204,500,000
2021061703652	FWD	USDMXN	06/17/2021	(2,500,000)	20.44	51,100,000
2020112703164	FWD	USDMXN	06/18/2021	100,000	20.52875	(2,052,875)
2020112703135	FWD	USDMXN	06/18/2021	(100,000)	20.5602	2,056,020
2020120103440	FWD	USDMXN	06/18/2021	65,000	20.48316	(1,331,405)
2020120103429	FWD	USDMXN	06/18/2021	(65,000)	20.5236	1,334,034
2020120303423	FWD	USDMXN	06/18/2021	1,366,400	20.32979	(27,778,631)
2020120303278	FWD	USDMXN	06/18/2021	(1,366,400)	20.3374	27,789,023
2020120403357	FWD	USDMXN	06/18/2021	25,000	20.16718	(504,180)
2020120403255	FWD	USDMXN	06/18/2021	(25,000)	20.1823	504,558
2020120903524	FWD	USDMXN	06/18/2021	100,000	20.32481	(2,032,481)
2020120903494	FWD	USDMXN	06/18/2021	(100,000)	20.36	2,036,000
2021021103200	FWD	USDMXN	06/18/2021	250,000	20.251	(5,062,751)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021030903264	FWD	USDMXN	06/18/2021	(250,000)	21.49433	5,373,582
2021040503291	FWD	USDMXN	06/18/2021	520,000	20.43115	(10,624,196)
2021040603499	FWD	USDMXN	06/18/2021	41,502	20.31028	(842,923)
2021040803278	FWD	USDMXN	06/18/2021	250,000	20.31274	(5,078,184)
2021051203476	FWD	USDMXN	06/18/2021	50,000	20.20578	(1,010,289)
2021051703059	FWD	USDMXN	06/18/2021	300,000	19.87069	(5,961,207)
2021052603297	FWD	USDMXN	06/18/2021	300,000	19.90412	(5,971,236)
2021060103141	FWD	USDMXN	06/18/2021	250,000	19.89664	(4,974,159)
2021060303106	FWD	USDMXN	06/18/2021	(120,000)	20.07525	2,409,030
2021061503595	FWD	USDMXN	06/18/2021	2,000,000	20.08373	(40,167,450)
2021061703007	FWD	USDMXN	06/18/2021	50,000,000	20.49235	(1,024,617,500)
2021061703196	FWD	USDMXN	06/18/2021	25,000,000	20.4455	(511,137,500)
2021061703627	FWD	USDMXN	06/18/2021	10,000,000	20.4526	(204,526,000)
2021061703653	FWD	USDMXN	06/18/2021	2,500,000	20.4424	(51,106,000)
2021061703629	FWD	USDMXN	06/18/2021	(10,000,000)	20.45	204,500,000
2021061803007	FWD	USDMXN	06/18/2021	(10,000,000)	20.50534	205,053,430
2021061803026	FWD	USDMXN	06/18/2021	(2,500,000)	20.52	51,300,000
2021061803044	FWD	USDMXN	06/18/2021	(10,000,000)	20.52	205,200,000
2021061803581	FWD	USDMXN	06/18/2021	(10,000,000)	20.63	206,300,000
2021061803654	FWD	USDMXN	06/18/2021	(20,000,000)	20.603	412,060,000
2020120903402	FWD	USDMXN	06/21/2021	40,000	20.38359	(815,343)
2020120903201	FWD	USDMXN	06/21/2021	(40,000)	20.3334	813,336
2021051803315	FWD	USDMXN	06/21/2021	130,000	19.87746	(2,584,069)
2021052803346	FWD	USDMXN	06/21/2021	(290,000)	19.9555	5,787,096
2021052803445	FWD	USDMXN	06/21/2021	(286)	19.95423	5,711
2021060103026	FWD	USDMXN	06/21/2021	1,000,000	19.95945	(19,959,451)
2021060703570	FWD	USDMXN	06/21/2021	32,000	19.82699	(634,464)
2021061503209	FWD	USDMXN	06/21/2021	(13,000,000)	20.1503	261,953,952
2021061503328	FWD	USDMXN	06/21/2021	(3,000,000)	20.14673	60,440,181
2021061503413	FWD	USDMXN	06/21/2021	(19,000,000)	20.1394	382,648,657
2021061703089	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,000,000	20.4608	(204,608,000)
2021061703092	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,000,000	20.4577	(204,577,000)
2021061703217	FWD	USDMXN	06/21/2021	1,366,400	20.47082	(27,971,328)
2021061703497	FWD	USDMXN	06/21/2021	400,000	20.43	(8,172,000)
2021061703630	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,000,000	20.4584	(204,584,000)
2021061803027	FWD	USDMXN	06/21/2021	2,500,000	20.5284	(51,321,000)
2021061803045	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,000,000	20.5301	(205,301,000)
2021061803582	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,000,000	20.64	(206,400,000)
2021061803655	FWD	USDMXN	06/21/2021	20,000,000	20.6125	(412,250,000)
2021061803030	FWD	USDMXN	06/21/2021	(3,500,000)	20.52	71,820,000
2021062103005	FWD	USDMXN	06/21/2021	(50,000,000)	20.579	1,028,950,000
2021011803335	FWD	USDMXN	06/22/2021	100,000	20.05744	(2,005,744)
2021011803311	FWD	USDMXN	06/22/2021	(100,000)	20.0944	2,009,440
2021012003343	FWD	USDMXN	06/22/2021	98,410	19.91078	(1,959,426)
2021031803042	FWD	USDMXN	06/22/2021	115,000	20.63856	(2,373,434)
2021031803678	FWD	USDMXN	06/22/2021	535	20.67748	(11,060)
2021040703084	FWD	USDMXN	06/22/2021	1,000,000	20.322	(20,322,004)
2021041903541	FWD	USDMXN	06/22/2021	25,082	19.956	(500,528)
2021051003533	FWD	USDMXN	06/22/2021	36,145	19.99248	(722,628)
2021051803518	FWD	MXNUSD	06/22/2021	(418,600,000)	19.92611	21,007,613
2021051803590	FWD	USDMXN	06/22/2021	(517)	19.91161	10,286
2021060103003	FWD	USDMXN	06/22/2021	(111,000)	19.96361	2,215,961
2021060103157	FWD	USDMXN	06/22/2021	(67)	19.92665	1,335
2021060403380	FWD	USDMXN	06/22/2021	2,000,000	19.96693	(39,933,858)
2021061103430	FWD	USDMXN	06/22/2021	(250,000)	19.99066	4,997,665
2021061403408	FWD	USDMXN	06/22/2021	200,000	19.96984	(3,993,969)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021061403409	FWD	USDMXN	06/22/2021	200,000	19.96469	(3,992,939)
2021061403277	FWD	USDMXN	06/22/2021	(11,000)	19.9335	219,269
2021061403367	FWD	USDMXN	06/22/2021	(220,000)	19.97255	4,393,960
2021061403372	FWD	USDMXN	06/22/2021	(200,000)	19.97225	3,994,449
2021061403415	FWD	USDMXN	06/22/2021	(85,000)	19.95819	1,696,447
2021061403464	FWD	USDMXN	06/22/2021	(1,533)	19.9637	30,598
2021061503184	FWD	USDMXN	06/22/2021	(184,000)	19.9936	3,678,823
2021061503596	FWD	USDMXN	06/22/2021	(2,000,000)	20.09182	40,183,632
2021061803031	FWD	USDMXN	06/22/2021	3,500,000	20.5228	(71,829,800)
2021061803329	FWD	USDMXN	06/22/2021	400,000	20.69152	(8,276,608)
2021061803693	FWD	USDMXN	06/22/2021	64,075	20.60367	(1,320,179)
2021062103006	FWD	USDMXN	06/22/2021	50,000,000	20.583	(1,029,150,000)
2021062103362	FWD	USDMXN	06/22/2021	(3,500,000)	20.49	71,715,000
2021062203278	FWD	USDMXN	06/22/2021	10,000,000	20.45	(204,500,000)
2020100503491	FWD	USDMXN	06/23/2021	600,000	21.98021	(13,188,124)
2020100503227	FWD	USDMXN	06/23/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503548	FWD	USDMXN	06/23/2021	900,000	21.31972	(19,187,745)
2020110503407	FWD	USDMXN	06/23/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
202102103419	FWD	USDMXN	06/23/2021	(58,574)	20.10674	1,177,738
2021020403166	FWD	USDMXN	06/23/2021	(56,879)	20.66929	1,175,642
2021022503449	FWD	USDMXN	06/23/2021	(55,819)	21.08602	1,177,011
2021022503656	FWD	USDMXN	06/23/2021	(100,000)	21.20884	2,120,884
2021030403318	FWD	USDMXN	06/23/2021	(55,907)	21.02264	1,175,315
2021031203007	FWD	USDMXN	06/23/2021	(56,048)	20.88921	1,170,808
2021041603513	FWD	USDMXN	06/23/2021	500,000	20.03896	(10,019,482)
2021042003074	FWD	USDMXN	06/23/2021	250,000	19.94367	(4,985,918)
2021042103618	FWD	USDMXN	06/23/2021	100,000	20.02458	(2,002,458)
2021042103691	FWD	USDMXN	06/23/2021	315,000	20.0334	(6,310,521)
2021042103749	FWD	USDMXN	06/23/2021	17,000	20.03349	(340,569)
2021051103100	FWD	USDMXN	06/23/2021	500,000	19.93977	(9,969,884)
2021051703329	FWD	USDMXN	06/23/2021	750,000	19.87714	(14,907,858)
2021060703698	FWD	USDMXN	06/23/2021	27,250	19.87009	(541,460)
2021061703298	FWD	USDMXN	06/23/2021	10,000,000	20.47595	(204,759,500)
2021062103363	FWD	USDMXN	06/23/2021	3,500,000	20.4938	(71,728,300)
2021062203279	FWD	USDMXN	06/23/2021	(10,000,000)	20.4539	204,539,000
2020091003213	FWD	USDMXN	06/24/2021	34,000	21.99784	(747,927)
2020091003181	FWD	USDMXN	06/24/2021	(34,000)	22.1323	752,498
2020091003334	FWD	USDMXN	06/24/2021	(34,000)	22.07086	750,409
2020102303715	FWD	USDMXN	06/24/2021	125,000	21.45939	(2,682,424)
2020110503350	FWD	USDMXN	06/24/2021	45,000	21.36081	(961,237)
2020110503729	FWD	USDMXN	06/24/2021	(45,000)	21.4647	965,912
2021010703011	FWD	USDMXN	06/24/2021	(11,064)	20.1303	222,717
2021012703402	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,816)	20.55385	222,320
2021020303231	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,852)	20.5154	222,640
2021021003391	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,931)	20.30625	221,961
2021030403009	FWD	USDMXN	06/24/2021	(1,000,000)	21.07377	21,073,774
2021031003479	FWD	USDMXN	06/24/2021	(39,555)	21.21068	838,994
2021031203215	FWD	USDMXN	06/24/2021	(500,000)	21.05474	10,527,372
2021031803624	FWD	USDMXN	06/24/2021	1,500,000	20.63639	(30,954,585)
2021032403093	FWD	USDMXN	06/24/2021	(500,000)	21.03655	10,518,276
2021032403139	FWD	USDMXN	06/24/2021	(39,974)	20.98683	838,922
2021032503424	FWD	USDMXN	06/24/2021	229,000	20.93924	(4,795,086)
2021032503444	FWD	USDMXN	06/24/2021	358	20.90578	(7,483)
2021033103382	FWD	USDMXN	06/24/2021	500,000	20.70657	(10,353,287)
2021040603270	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	20.40852	(612,256)
2021040803218	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	20.26315	(607,894)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041503286	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	20.14784	(604,435)
2021041503661	FWD	USDMXN	06/24/2021	300,000	20.1538	(6,046,140)
2021041503831	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	20.04199	(601,260)
2021041603281	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	20.03484	(601,045)
2021041603332	FWD	USDMXN	06/24/2021	750,000	20.04174	(15,031,308)
2021041603635	FWD	USDMXN	06/24/2021	600,000	20.06157	(12,036,943)
2021041903632	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	19.97593	(599,278)
2021042603418	FWD	USDMXN	06/24/2021	40,000	19.99157	(799,663)
2021042603478	FWD	USDMXN	06/24/2021	883	19.98387	(17,655)
2021050703002	FWD	USDMXN	06/24/2021	500,000	20.15944	(10,079,722)
2021051003510	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	19.98084	(599,425)
2021051103123	FWD	USDMXN	06/24/2021	500,000	19.9418	(9,970,900)
2021051103164	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	19.94577	(598,373)
2021051803345	FWD	USDMXN	06/24/2021	60,000	19.86261	(1,191,757)
2021051803373	FWD	USDMXN	06/24/2021	500,000	19.84454	(9,922,270)
2021052403404	FWD	USDMXN	06/24/2021	200,000	19.9664	(3,993,280)
2021060403536	FWD	USDMXN	06/24/2021	1,000,000	19.97829	(19,978,293)
2021060703326	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000	19.83446	(595,034)
2021060703573	FWD	USDMXN	06/24/2021	250,000	19.82043	(4,955,108)
2021060803176	FWD	USDMXN	06/24/2021	1,500,000	19.78786	(29,681,786)
2021061103431	FWD	USDMXN	06/24/2021	(250,000)	19.99492	4,998,730
2021061503183	FWD	USDMXN	06/24/2021	(392,000)	19.99788	7,839,171
2021061503639	FWD	USDMXN	06/24/2021	(50,000)	20.07824	1,003,912
2021061603613	FWD	USDMXN	06/24/2021	(500,000)	20.34672	10,173,362
2021062203391	FWD	USDMXN	06/24/2021	26,399	20.41332	(538,888)
2021062203141	FWD	USDMXN	06/24/2021	(471,150)	20.5667	9,690,001
2021062403066	FWD	USDMXN	06/24/2021	(10,000,000)	20.037	200,370,000
2020090903347	FWD	USDMXN	06/25/2021	200,000	22.1747	(4,434,939)
2020090903325	FWD	USDMXN	06/25/2021	(200,000)	21.9953	4,399,060
2020112703165	FWD	USDMXN	06/25/2021	100,000	20.54585	(2,054,585)
2020112703136	FWD	USDMXN	06/25/2021	(100,000)	20.5769	2,057,690
2020120103439	FWD	USDMXN	06/25/2021	65,000	20.49981	(1,332,488)
2020120103430	FWD	USDMXN	06/25/2021	(65,000)	20.54	1,335,100
2020120403358	FWD	USDMXN	06/25/2021	25,000	20.18309	(504,577)
2020120403242	FWD	USDMXN	06/25/2021	(25,000)	20.1823	504,558
2020120903525	FWD	USDMXN	06/25/2021	100,000	20.34092	(2,034,092)
2020120903495	FWD	USDMXN	06/25/2021	(100,000)	20.36	2,036,000
2021011803336	FWD	USDMXN	06/25/2021	100,000	20.06422	(2,006,422)
2021011803314	FWD	USDMXN	06/25/2021	(100,000)	20.1019	2,010,190
2021021103201	FWD	USDMXN	06/25/2021	250,000	20.26696	(5,066,739)
2021030503157	FWD	USDMXN	06/25/2021	(236,685)	21.4909	5,086,565
2021030903454	FWD	USDMXN	06/25/2021	(13,315)	21.44635	285,568
2021040603500	FWD	USDMXN	06/25/2021	145,314	20.3262	(2,953,687)
2021040803279	FWD	USDMXN	06/25/2021	250,000	20.32888	(5,082,220)
2021051203477	FWD	USDMXN	06/25/2021	50,000	20.22191	(1,011,096)
2021052603298	FWD	USDMXN	06/25/2021	200,000	19.92023	(3,984,046)
2021052603576	FWD	USDMXN	06/25/2021	500,000	19.89986	(9,949,929)
2021052803029	FWD	USDMXN	06/25/2021	109,000	20.03802	(2,184,144)
2021052803243	FWD	USDMXN	06/25/2021	619	19.99209	(12,383)
2021052803550	FWD	USDMXN	06/25/2021	1,500,000	19.98061	(29,970,914)
2021052803421	FWD	USDMXN	06/25/2021	(500,000)	19.96555	9,982,776
2021061103432	FWD	USDMXN	06/25/2021	(500,000)	19.99705	9,998,525
2021061403416	FWD	USDMXN	06/25/2021	(50,000)	19.96215	998,108
2021061503185	FWD	USDMXN	06/25/2021	(306,000)	20.00002	6,120,007
2021062303229	FWD	USDMXN	06/25/2021	175,000	20.22009	(3,538,516)
2021062403067	FWD	USDMXN	06/25/2021	10,000,000	20.0394	(200,394,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020120903403	FWD	USDMXN	06/28/2021	40,000	20.39991	(815,996)
2020120903202	FWD	USDMXN	06/28/2021	(40,000)	20.3499	813,996
2021012003410	FWD	USDMXN	06/28/2021	1,000,000	19.92462	(19,924,623)
2021012003537	FWD	USDMXN	06/28/2021	2,362,441	19.97057	(47,179,303)
2021012003428	FWD	USDMXN	06/28/2021	(3,362,441)	19.926	67,000,000
2021040703085	FWD	USDMXN	06/28/2021	1,000,000	20.33564	(20,335,639)
2021052803033	FWD	USDMXN	06/28/2021	68,000	20.0251	(1,361,707)
2021052803245	FWD	USDMXN	06/28/2021	849	20.00094	(16,971)
2021061503186	FWD	USDMXN	06/28/2021	(339,000)	20.00644	6,782,184
2021062103082	FWD	USDMXN	06/28/2021	63,000	20.61882	(1,298,986)
2021062103263	FWD	USDMXN	06/28/2021	181	20.53776	(3,715)
2020120303426	FWD	USDMXN	06/29/2021	1,366,400	20.35787	(27,816,989)
2020120303283	FWD	USDMXN	06/29/2021	(1,366,400)	20.363	27,824,003
2021011803436	FWD	USDMXN	06/29/2021	100,000	20.07467	(2,007,467)
2021011803424	FWD	USDMXN	06/29/2021	(100,000)	20.1125	2,011,250
2021022203066	FWD	USDMXN	06/29/2021	(50,000)	21.06054	1,053,027
2021041903543	FWD	USDMXN	06/29/2021	48,867	19.97169	(975,965)
2021041903648	FWD	USDMXN	06/29/2021	624	19.97525	(12,473)
2021050603449	FWD	USDMXN	06/29/2021	10,000	20.22988	(202,299)
2021050603393	FWD	USDMXN	06/29/2021	(174,670)	20.22851	3,533,313
2021051003228	FWD	USDMXN	06/29/2021	250,000	19.99192	(4,997,980)
2021051003535	FWD	USDMXN	06/29/2021	93,842	20.00818	(1,877,601)
2021052003296	FWD	USDMXN	06/29/2021	63,760	19.98938	(1,274,515)
2021052703421	FWD	USDMXN	06/29/2021	(379,200)	20.06598	7,609,019
2021052703574	FWD	USDMXN	06/29/2021	(32)	20.03878	646
2021061003362	FWD	USDMXN	06/29/2021	269,566	19.74848	(5,323,511)
2021061403485	FWD	USDMXN	06/29/2021	(143,459)	19.98526	2,867,065
2021061603461	FWD	USDMXN	06/29/2021	(460,000)	20.26212	9,320,577
2021061703218	FWD	USDMXN	06/29/2021	(1,366,400)	20.48846	27,995,428
2021061803694	FWD	USDMXN	06/29/2021	(64,075)	20.62285	1,321,407
2021062103249	FWD	USDMXN	06/29/2021	400,000	20.56094	(8,224,375)
2021062203392	FWD	USDMXN	06/29/2021	(26,399)	20.42764	539,266
2021062503311	FWD	USDMXN	06/29/2021	(500,000)	19.7766	9,888,300
2021062503316	FWD	USDMXN	06/29/2021	(500,000)	19.7763	9,888,150
2021062503319	FWD	USDMXN	06/29/2021	(500,000)	19.7725	9,886,250
2021062503324	FWD	USDMXN	06/29/2021	(442,300)	19.7771	8,747,411
2021062803503	FWD	USDMXN	06/29/2021	(50,000)	19.8229	991,145
2021062903306	FWD	USDMXN	06/29/2021	(3,250,000)	19.81991	64,414,704
2020082703573	FWD	USDMXN	06/30/2021	890,857	22.76116	(20,276,936)
2020082703582	FWD	USDMXN	06/30/2021	(890,857)	22.7882	20,301,023
2020100503492	FWD	USDMXN	06/30/2021	600,000	21.99834	(13,199,003)
2020100503228	FWD	USDMXN	06/30/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503549	FWD	USDMXN	06/30/2021	900,000	21.33708	(19,203,372)
2020110503409	FWD	USDMXN	06/30/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020121703684	FWD	USDMXN	06/30/2021	106,000	20.24443	(2,145,909)
2020121703640	FWD	USDMXN	06/30/2021	(106,000)	20.2519	2,146,701
2021022503657	FWD	USDMXN	06/30/2021	(100,000)	21.22453	2,122,453
2021022603452	FWD	USDMXN	06/30/2021	35,000	21.17222	(741,028)
2021031203207	FWD	USDMXN	06/30/2021	67,000	20.99125	(1,406,414)
2021031603024	FWD	USDMXN	06/30/2021	850	20.8461	(17,719)
2021032303335	FWD	USDMXN	06/30/2021	7,400,000	20.93759	(154,938,166)
2021032303385	FWD	USDMXN	06/30/2021	(2,127)	20.96176	44,593
2021032603490	FWD	USDMXN	06/30/2021	60,000	20.80643	(1,248,386)
2021033003385	FWD	USDMXN	06/30/2021	425,165	20.76684	(8,829,342)
2021041203496	FWD	USDMXN	06/30/2021	65,800	20.33474	(1,338,026)
2021041503682	FWD	USDMXN	06/30/2021	100,000	20.09596	(2,009,596)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041603514	FWD	USDMXN	06/30/2021	500,000	20.05446	(10,027,231)
2021041603636	FWD	USDMXN	06/30/2021	500,000	20.07486	(10,037,429)
2021042003073	FWD	USDMXN	06/30/2021	250,000	19.95935	(4,989,838)
2021042103692	FWD	USDMXN	06/30/2021	315,000	20.04939	(6,315,558)
2021042103750	FWD	USDMXN	06/30/2021	17,000	20.04949	(340,841)
2021050503345	FWD	USDMXN	06/30/2021	93,750	20.39606	(1,912,131)
2021050703337	FWD	USDMXN	06/30/2021	93,750	20.07247	(1,881,794)
2021051703328	FWD	USDMXN	06/30/2021	750,000	19.8931	(14,919,827)
2021051703331	FWD	USDMXN	06/30/2021	440,000	19.88149	(8,747,856)
2021051703499	FWD	USDMXN	06/30/2021	1,000	19.88087	(19,880)
2021051803191	FWD	USDMXN	06/30/2021	7,425,000	19.92735	(147,960,596)
2021051803193	FWD	USDMXN	06/30/2021	618	19.93339	(12,319)
2021051803363	FWD	USDMXN	06/30/2021	(372)	19.92465	7,416
2021051903327	FWD	USDMXN	06/30/2021	441,000	19.90572	(8,778,424)
2021052103168	FWD	USDMXN	06/30/2021	440,000	20.00829	(8,803,647)
2021052103312	FWD	USDMXN	06/30/2021	1,000	20.0842	(20,083)
2021052103386	FWD	USDMXN	06/30/2021	440,000	20.06843	(8,830,109)
2021052103389	FWD	USDMXN	06/30/2021	1,000	20.06005	(20,060)
2021052403455	FWD	USDMXN	06/30/2021	250,200	19.97325	(4,997,308)
2021052503274	FWD	USDMXN	06/30/2021	441,000	19.98262	(8,812,335)
2021052503490	FWD	USDMXN	06/30/2021	441,000	19.9958	(8,818,150)
2021052603386	FWD	USDMXN	06/30/2021	441,000	19.9585	(8,801,699)
2021052703172	FWD	USDMXN	06/30/2021	175,000	19.9597	(3,492,947)
2021052703422	FWD	USDMXN	06/30/2021	440,000	20.06257	(8,827,532)
2021052703575	FWD	USDMXN	06/30/2021	1,000	20.04675	(20,046)
2021052703620	FWD	USDMXN	06/30/2021	441,000	20.03824	(8,836,862)
2021052803422	FWD	USDMXN	06/30/2021	440,000	19.99138	(8,796,207)
2021052803447	FWD	USDMXN	06/30/2021	1,000	19.98181	(19,981)
2021060103565	FWD	USDMXN	06/30/2021	26,350	20.02674	(527,705)
2021060703539	FWD	USDMXN	06/30/2021	300,000	19.85849	(5,957,546)
2021060803467	FWD	USDMXN	06/30/2021	175,000	19.79499	(3,464,123)
2021061503493	FWD	USDMXN	06/30/2021	10,112,000	20.13138	(203,568,474)
2021061503686	FWD	USDMXN	06/30/2021	289	20.05371	(5,804)
2021061603462	FWD	USDMXN	06/30/2021	(270,000)	20.26413	5,471,315
2021061603541	FWD	USDMXN	06/30/2021	(125,000)	20.26587	2,533,234
2021061703112	FWD	USDMXN	06/30/2021	(125,000)	20.56876	2,571,095
2021061803682	FWD	USDMXN	06/30/2021	(200,000)	20.64861	4,129,722
2021062303230	FWD	USDMXN	06/30/2021	(175,000)	20.23144	3,540,502
2021062303232	FWD	USDMXN	06/30/2021	(175,000)	20.30312	3,553,046
2021030103270	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.6977	1,448,839,000
2021030103307	FWD	USDMXN	04/05/2021	(50,000,000)	20.7278	1,036,390,000
2021031803298	FWD	USDMXN	04/05/2021	50,000,000	20.5	(1,025,000,000)
2021031803440	FWD	USDMXN	04/05/2021	25,000,000	20.3886	(509,715,000)
2021031803588	FWD	USDMXN	04/05/2021	19,000,000	20.465	(388,835,000)
2021032303236	FWD	USDMXN	04/05/2021	80,000,000	20.7037	(1,656,296,000)
2021032903012	FWD	USDMXN	04/05/2021	(63,225,805)	20.74775	1,311,793,203
2021033003211	FWD	USDMXN	04/05/2021	6,000,000	20.62	(123,720,000)
2021033003292	FWD	USDMXN	04/05/2021	5,000,000	20.582	(102,910,000)
2021033003095	FWD	USDMXN	04/05/2021	(10,000,000)	20.553	205,530,000
2021033003464	FWD	USDMXN	04/05/2021	(70,000,000)	20.566	1,439,620,000
2021033103005	FWD	USDMXN	04/05/2021	10,225,805	20.45888	(209,208,564)
2021033103008	FWD	USDMXN	04/05/2021	(19,000,000)	20.4512	388,572,800
2021040503035	FWD	USDMXN	04/05/2021	(20,000,000)	20.273	405,460,000
2021040503097	FWD	USDMXN	04/05/2021	(30,000,000)	20.255	607,650,000
2021033103135	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.4376	(1,021,880,000)
2021033103166	FWD	USDMXN	04/06/2021	50,000,000	20.445	(1,022,250,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021033103006	FWD	USDMXN	04/06/2021	(10,225,805)	20.4612	209,232,248
2021033103110	FWD	USDMXN	04/06/2021	(139,159,908)	20.43	2,843,036,929
2021040503007	FWD	USDMXN	04/06/2021	276,134	20.26101	(5,594,757)
2021040503036	FWD	USDMXN	04/06/2021	20,000,000	20.2752	(405,504,000)
2021040503098	FWD	USDMXN	04/06/2021	30,000,000	20.2572	(607,716,000)
2021040503008	FWD	USDMXN	04/07/2021	(276,134)	20.2633	5,595,390
2021040603007	FWD	USDMXN	04/07/2021	9,276,134	20.24565	(187,801,325)
2021040603487	FWD	USDMXN	04/08/2021	9,000,000	20.16	(181,440,000)
2021040603008	FWD	USDMXN	04/08/2021	(9,276,134)	20.2479	187,822,238
2021040603483	FWD	USDMXN	04/08/2021	(7,000,000)	20.16	141,120,000
2021040603665	FWD	USDMXN	04/08/2021	(7,000,000)	20.186	141,302,000
2021040703009	FWD	USDMXN	04/08/2021	276,134	20.20528	(5,579,370)
2020122103304	FWD	USDMXN	04/09/2021	386,667	20.5408	(7,942,445)
2021040703010	FWD	USDMXN	04/09/2021	(276,134)	20.2075	5,579,982
2021040703357	FWD	USDMXN	04/09/2021	(10,000,000)	20.19	201,900,000
2021040803236	FWD	USDMXN	04/09/2021	174,467	20.0763	(3,502,659)
2021010703419	FWD	USDMXN	04/12/2021	25,000,000	20.156	(503,900,000)
2021040803097	FWD	USDMXN	04/12/2021	20,000,000	20.1	(402,000,000)
2021040803100	FWD	USDMXN	04/12/2021	(30,000,000)	20.1	603,000,000
2021040803237	FWD	USDMXN	04/12/2021	(174,467)	20.0827	3,503,776
2021040903015	FWD	USDMXN	04/12/2021	30,174,467	20.22	(610,127,731)
2021033103111	FWD	USDMXN	04/13/2021	139,051,689	20.4459	(2,843,036,929)
2021033103136	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.45317	1,022,658,460
2021033103167	FWD	USDMXN	04/13/2021	(50,000,000)	20.4608	1,023,040,000
2021040903016	FWD	USDMXN	04/13/2021	(30,174,467)	20.22215	610,192,606
2021041203007	FWD	USDMXN	04/13/2021	(8,877,222)	20.11422	178,558,398
2021041203411	FWD	USDMXN	04/13/2021	(11,000,000)	20.135	221,485,000
2021022603321	FWD	USDMXN	04/14/2021	57,680,000	21.0061	(1,211,631,848)
2021031803589	FWD	USDMXN	04/14/2021	(19,000,000)	20.485	389,215,000
2021041203008	FWD	USDMXN	04/14/2021	8,877,222	20.1164	(178,577,741)
2021041203017	FWD	USDMXN	04/14/2021	19,450,000	20.105	(391,042,250)
2021041203412	FWD	USDMXN	04/14/2021	11,000,000	20.1372	(221,509,200)
2021041203045	FWD	USDMXN	04/14/2021	(29,000,000)	20.115	583,335,000
2021041203485	FWD	USDMXN	04/14/2021	(48,000,000)	20.159	967,632,000
2021041303002	FWD	USDMXN	04/14/2021	(159,692)	20.1423	3,216,560
2020121103311	FWD	USDMXN	04/15/2021	50,000,000	20.36	(1,018,000,000)
2020121103541	FWD	USDMXN	04/15/2021	(91,250,000)	20.336	1,855,660,000
2021030103143	FWD	USDMXN	04/15/2021	62,430,000	20.6748	(1,290,727,764)
2021041203046	FWD	USDMXN	04/15/2021	29,000,000	20.11715	(583,397,350)
2021041303003	FWD	USDMXN	04/15/2021	159,692	20.1445	(3,216,911)
2021041303060	FWD	USDMXN	04/15/2021	(40,000,000)	20.104	804,160,000
2021041303147	FWD	USDMXN	04/15/2021	(339,692)	20.0595	6,814,047
2021041403409	FWD	USDMXN	04/15/2021	9,965,098	20.07	(199,999,510)
2021041403005	FWD	USDMXN	04/15/2021	(5,000,000)	20.1021	100,510,508
2020122103307	FWD	USDMXN	04/16/2021	386,667	20.5568	(7,948,632)
2021041203018	FWD	USDMXN	04/16/2021	(19,450,000)	20.1094	391,127,830
2021041303148	FWD	USDMXN	04/16/2021	339,692	20.06168	(6,814,788)
2021041403006	FWD	USDMXN	04/16/2021	5,000,000	20.1043	(100,521,500)
2021041503027	FWD	USDMXN	04/16/2021	28,200,000	19.96	(562,872,000)
2021041503043	FWD	USDMXN	04/16/2021	(28,476,359)	19.97	568,672,881
2021011403076	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0455	(200,455,000)
2021011503167	FWD	USDMXN	04/19/2021	10,000,000	20.0095	(200,095,000)
2021041503044	FWD	USDMXN	04/19/2021	28,476,359	19.9767	(568,863,672)
2021041503028	FWD	USDMXN	04/19/2021	(28,200,000)	19.9666	563,058,120
2021041603065	FWD	USDMXN	04/19/2021	8,300,000	19.96	(165,668,000)
2021041603001	FWD	USDMXN	04/19/2021	(1,676,359)	19.93748	33,422,358

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041603164	FWD	USDMXN	04/19/2021	(8,300,000)	19.93115	165,428,582
2021041603002	FWD	USDMXN	04/20/2021	1,676,359	19.9397	(33,426,087)
2021041603165	FWD	USDMXN	04/20/2021	8,300,000	19.9334	(165,447,220)
2021041603278	FWD	USDMXN	04/20/2021	100,000,000	19.902	(1,990,200,000)
2021041603534	FWD	USDMXN	04/20/2021	(5,000,000)	19.91	99,550,000
2021041903001	FWD	USDMXN	04/20/2021	(9,000,000)	19.84	178,560,000
2021041903008	FWD	USDMXN	04/20/2021	(130,000,000)	19.845	2,579,850,000
2021041903010	FWD	USDMXN	04/20/2021	(326,359)	19.84978	6,478,146
2021041203486	FWD	USDMXN	04/21/2021	48,000,000	20.174	(968,352,000)
2021041603268	FWD	USDMXN	04/21/2021	(82,840,000)	19.919	1,650,089,960
2021041903002	FWD	USDMXN	04/21/2021	9,000,000	19.84223	(178,580,025)
2021041903009	FWD	USDMXN	04/21/2021	130,000,000	19.8472	(2,580,136,000)
2021041903011	FWD	USDMXN	04/21/2021	326,359	19.852	(6,478,870)
2021041903566	FWD	USDMXN	04/21/2021	(30,000,000)	19.833	594,990,000
2021042003419	FWD	USDMXN	04/21/2021	1,000,000	19.90593	(19,905,935)
2021042003001	FWD	USDMXN	04/21/2021	(74,486,359)	19.9	1,482,278,536
2021042103031	FWD	USDMXN	04/21/2021	(2,010,000)	19.89562	39,990,190
2021031803299	FWD	USDMXN	04/22/2021	(50,000,000)	20.5375	1,026,875,000
2021041303061	FWD	USDMXN	04/22/2021	40,000,000	20.11919	(804,767,480)
2021042003002	FWD	USDMXN	04/22/2021	74,486,359	19.9022	(1,482,442,406)
2021042003420	FWD	USDMXN	04/22/2021	(1,000,000)	19.9081	19,908,100
2021042103017	FWD	USDMXN	04/22/2021	27,283	19.92554	(543,626)
2021042103011	FWD	USDMXN	04/22/2021	(29,500,000)	19.923	587,728,500
2021042103013	FWD	USDMXN	04/22/2021	(13,641)	19.90319	271,508
2020122103313	FWD	USDMXN	04/23/2021	386,667	20.5728	(7,954,819)
2021041603066	FWD	USDMXN	04/23/2021	(8,300,000)	19.9715	165,763,450
2021042103012	FWD	USDMXN	04/23/2021	29,500,000	19.92518	(587,792,663)
2021042103014	FWD	USDMXN	04/23/2021	13,641	19.9054	(271,538)
2021042103032	FWD	USDMXN	04/23/2021	2,010,000	19.9	(39,999,000)
2021042103126	FWD	USDMXN	04/23/2021	5,000,000	19.8745	(99,372,500)
2021042103018	FWD	USDMXN	04/23/2021	(27,283)	19.9277	543,685
2021042103082	FWD	USDMXN	04/23/2021	(14,000,000)	19.88	278,320,000
2021042103165	FWD	USDMXN	04/23/2021	(15,000,000)	19.879	298,185,000
2021042203059	FWD	USDMXN	04/23/2021	(7,573,025)	19.87373	150,504,284
2021042303015	FWD	USDMXN	04/23/2021	8,200,000	19.84	(162,688,000)
2021042303017	FWD	MXNUSD	04/23/2021	1,286,964	19.82545	(64,915)
2021042303019	FWD	USDMXN	04/23/2021	(12,100,000)	19.845	240,124,500
2021042103083	FWD	USDMXN	04/26/2021	14,000,000	19.8865	(278,411,000)
2021042203060	FWD	USDMXN	04/26/2021	7,573,025	19.8803	(150,554,016)
2021042303020	FWD	USDMXN	04/26/2021	12,100,000	19.8515	(240,203,150)
2021042303049	FWD	USDMXN	04/26/2021	7,426,975	19.85676	(147,475,642)
2021042303016	FWD	USDMXN	04/26/2021	(8,200,000)	19.84655	162,741,710
2021042303047	FWD	USDMXN	04/26/2021	(29,000,000)	19.84	575,360,000
2021042303048	FWD	USDMXN	04/27/2021	29,000,000	19.84213	(575,421,625)
2021042303050	FWD	USDMXN	04/27/2021	(7,426,975)	19.8589	147,491,546
2021042303117	FWD	USDMXN	04/27/2021	(10,000,000)	19.88	198,800,000
2021042303307	FWD	USDMXN	04/27/2021	(10,000,000)	19.86	198,600,000
2021042603000	FWD	USDMXN	04/27/2021	(1,573,025)	19.84571	31,217,805
2021042703071	FWD	USDMXN	04/27/2021	8,800,000	19.99239	(175,932,989)
2021042703076	FWD	USDMXN	04/27/2021	(8,800,000)	19.992	175,929,600
2021042603001	FWD	USDMXN	04/28/2021	1,573,025	19.8479	(31,221,250)
2021042703002	FWD	USDMXN	04/28/2021	(1,573,025)	19.93164	31,352,969
2021042803000	FWD	USDMXN	04/28/2021	(4,000,000)	20.02031	80,081,259
2021042703003	FWD	USDMXN	04/29/2021	1,573,025	19.9338	(31,356,373)
2021042703077	FWD	USDMXN	04/29/2021	8,800,000	19.9962	(175,966,560)
2021042703072	FWD	USDMXN	04/29/2021	(8,800,000)	19.9966	175,970,080

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021042703080	FWD	USDMXN	04/29/2021	(8,500,000)	19.99	169,915,000
2021042803001	FWD	USDMXN	04/29/2021	4,000,000	20.02256	(80,090,240)
2021042803003	FWD	USDMXN	04/29/2021	(14,802,146)	20.02192	296,367,354
2020081803038	FWD	USDMXN	04/30/2021	3,500,000	22.73124	(79,559,340)
2020122103314	FWD	USDMXN	04/30/2021	386,667	20.5887	(7,960,967)
2021042803004	FWD	USDMXN	04/30/2021	14,802,146	20.0241	(296,399,650)
2021042803314	FWD	USDMXN	04/30/2021	25,000,000	19.964	(499,100,000)
2021042803183	FWD	USDMXN	04/30/2021	(53,450,000)	19.9675	1,067,262,875
2021042903290	FWD	USDMXN	04/30/2021	13,261,187	20.11494	(266,748,013)
2021042903335	FWD	USDMXN	05/03/2021	25,000,000	20.0987	(502,467,500)
2021042903354	FWD	USDMXN	05/03/2021	20,000,000	20.075	(401,500,000)
2021042903291	FWD	USDMXN	05/03/2021	(13,261,187)	20.1215	266,834,980
2021042903508	FWD	USDMXN	05/03/2021	(60,530,000)	20.105	1,216,955,650
2021043003022	FWD	USDMXN	05/03/2021	19,000,000	20.045	(380,855,000)
2021043003033	FWD	USDMXN	05/03/2021	19,000,000	20.045	(380,855,000)
2021043003049	FWD	USDMXN	05/03/2021	(208,813)	20.12659	4,202,687
2021043003018	FWD	USDMXN	05/04/2021	35,000,000	20.03	(701,050,000)
2021043003050	FWD	USDMXN	05/04/2021	208,813	20.1288	(4,203,149)
2021043003023	FWD	USDMXN	05/04/2021	(19,000,000)	20.0472	380,896,800
2021043003034	FWD	USDMXN	05/04/2021	(19,000,000)	20.0472	380,896,800
2021043003495	FWD	USDMXN	05/04/2021	(16,208,813)	20.2353	327,990,188
2021050303381	FWD	USDMXN	05/04/2021	(2,000,000)	20.17781	40,355,629
2021043003496	FWD	USDMXN	05/05/2021	16,208,813	20.23755	(328,026,682)
2021050303382	FWD	USDMXN	05/05/2021	2,000,000	20.1801	(40,360,200)
2021050303379	FWD	USDMXN	05/05/2021	(16,208,813)	20.1812	327,113,291
2021050303380	FWD	USDMXN	05/06/2021	16,208,813	20.18346	(327,149,923)
2021050403400	FWD	USDMXN	05/06/2021	(16,208,813)	20.207	327,531,478
2021050503015	FWD	USDMXN	05/06/2021	(20,800,000)	20.229	420,763,200
2021050503017	FWD	USDMXN	05/06/2021	(43,307)	20.22486	875,875
2020122103315	FWD	USDMXN	05/07/2021	386,667	20.6047	(7,967,153)
2021050403401	FWD	USDMXN	05/07/2021	16,208,813	20.20928	(327,568,353)
2021050503016	FWD	USDMXN	05/07/2021	20,800,000	20.23128	(420,810,520)
2021050503018	FWD	USDMXN	05/07/2021	43,307	20.2272	(875,977)
2021050503359	FWD	USDMXN	05/07/2021	30,000,000	20.255	(607,650,000)
2021050503336	FWD	USDMXN	05/07/2021	(14,000,000)	20.26	283,640,000
2021050603017	FWD	USDMXN	05/07/2021	(59,438,786)	20.242	1,203,159,914
2021050603018	FWD	USDMXN	05/10/2021	59,438,786	20.24875	(1,203,561,125)
2021050703018	FWD	USDMXN	05/10/2021	(50,000,000)	19.93	996,500,000
2021050703066	FWD	USDMXN	05/10/2021	(9,438,786)	19.95665	188,366,537
2021051003027	FWD	USDMXN	05/10/2021	(14,230,000)	19.885	282,963,550
2021051003034	FWD	USDMXN	05/10/2021	(36,770,000)	19.905	731,906,850
2021050703019	FWD	USDMXN	05/11/2021	50,000,000	19.9322	(996,610,000)
2021050703067	FWD	USDMXN	05/11/2021	9,438,786	19.9589	(188,387,793)
2021051003028	FWD	USDMXN	05/11/2021	14,230,000	19.88725	(282,995,568)
2021051003035	FWD	USDMXN	05/11/2021	36,770,000	19.90728	(731,990,502)
2021051003021	FWD	USDMXN	05/11/2021	(52,438,786)	19.885	1,042,745,267
2021051003022	FWD	USDMXN	05/12/2021	52,438,786	19.88725	(1,042,863,254)
2021051003378	FWD	USDMXN	05/12/2021	(30,000,000)	19.88	596,400,000
2021051103016	FWD	USDMXN	05/12/2021	(18,437,426)	19.91	367,089,155
2021051103017	FWD	USDMXN	05/13/2021	18,437,426	19.91225	(367,130,640)
2021051103092	FWD	USDMXN	05/13/2021	20,000,000	19.878	(397,560,000)
2021051103097	FWD	USDMXN	05/13/2021	40,000,000	19.878	(795,120,000)
2021051103216	FWD	USDMXN	05/13/2021	20,000,000	19.87	(397,400,000)
2021051103218	FWD	USDMXN	05/13/2021	30,000,000	19.87	(596,100,000)
2021051103023	FWD	USDMXN	05/13/2021	(20,000,000)	19.86	397,200,000
2021051103104	FWD	USDMXN	05/13/2021	(40,000,000)	19.8525	794,100,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021051103323	FWD	USDMXN	05/13/2021	(10,000,000)	19.917	199,170,000
2021051203046	FWD	USDMXN	05/13/2021	297,426	20.02047	(5,954,615)
2021051203044	FWD	USDMXN	05/13/2021	(148,713)	20.02072	2,977,344
2020122103318	FWD	USDMXN	05/14/2021	386,667	20.6207	(7,973,340)
2021051203045	FWD	USDMXN	05/14/2021	148,713	20.023	(2,977,684)
2021051203047	FWD	USDMXN	05/14/2021	(297,426)	20.0227	5,955,279
2021051203459	FWD	USDMXN	05/14/2021	(47,675,380)	20.099	958,227,459
2021041403410	FWD	USDMXN	05/17/2021	(9,929,772)	20.1414	199,999,510
2021051203460	FWD	USDMXN	05/17/2021	47,675,380	20.1058	(958,551,651)
2021051303161	FWD	USDMXN	05/17/2021	5,000,000	20.0825	(100,412,500)
2021051303315	FWD	USDMXN	05/17/2021	40,000,000	20.0215	(800,860,000)
2021051303317	FWD	USDMXN	05/17/2021	(30,000,000)	20.0215	600,645,000
2021051403018	FWD	USDMXN	05/17/2021	(29,883,428)	19.775	590,944,789
2021051403019	FWD	USDMXN	05/18/2021	29,883,428	19.77735	(591,015,015)
2021051703002	FWD	USDMXN	05/18/2021	(29,883,428)	19.92	595,277,886
2021051703003	FWD	USDMXN	05/19/2021	29,883,428	19.92243	(595,350,354)
2021051803018	FWD	USDMXN	05/19/2021	(29,883,428)	19.8	591,691,875
2021051903049	FWD	USDMXN	05/19/2021	(11,300,000)	19.91	224,983,000
2021051903051	FWD	USDMXN	05/19/2021	(31,700,000)	19.845	629,086,500
2021051803019	FWD	USDMXN	05/20/2021	29,883,428	19.80238	(591,762,848)
2021051803225	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,000,000)	19.83	297,450,000
2021051803540	FWD	USDMXN	05/20/2021	(15,000,000)	19.86	297,900,000
2021051903050	FWD	USDMXN	05/20/2021	11,300,000	19.91235	(225,009,555)
2021051903052	FWD	USDMXN	05/20/2021	31,700,000	19.84735	(629,160,995)
2021051903005	FWD	USDMXN	05/20/2021	(11,110,985)	19.8811	220,898,618
2020122103319	FWD	USDMXN	05/21/2021	386,667	20.6367	(7,979,527)
2020122103320	FWD	USDMXN	05/21/2021	386,667	20.6367	(7,979,527)
2021051903006	FWD	USDMXN	05/21/2021	11,110,985	19.8835	(220,925,278)
2021051903129	FWD	USDMXN	05/21/2021	50,000,000	19.8	(990,000,000)
2021051903196	FWD	USDMXN	05/21/2021	(61,884,319)	19.8175	1,226,392,492
2021051103211	FWD	USDMXN	05/24/2021	(59,910,000)	19.8747	1,190,693,277
2021051903197	FWD	USDMXN	05/24/2021	61,884,319	19.82465	(1,226,834,965)
2021052103004	FWD	USDMXN	05/24/2021	8,891,086	19.90269	(176,956,488)
2021052103005	FWD	USDMXN	05/25/2021	(8,891,086)	19.905	176,977,071
2021052403012	FWD	USDMXN	05/25/2021	8,891,086	19.95174	(177,392,600)
2021052403067	FWD	USDMXN	05/26/2021	25,000,000	19.8708	(496,770,000)
2021052403013	FWD	USDMXN	05/26/2021	(8,891,086)	19.9541	177,413,623
2021052503021	FWD	USDMXN	05/26/2021	(15,345,323)	19.84	304,451,217
2021052503022	FWD	USDMXN	05/27/2021	15,345,323	19.8425	(304,489,580)
2021052603013	FWD	USDMXN	05/27/2021	(23,416,657)	19.885	465,640,226
2020122103325	FWD	USDMXN	05/28/2021	386,667	20.6527	(7,985,713)
2021042703081	FWD	USDMXN	05/28/2021	8,500,000	20.054	(170,459,000)
2021052603014	FWD	USDMXN	05/28/2021	23,416,657	19.88753	(465,699,353)
2021052603228	FWD	USDMXN	05/28/2021	17,200,000	19.882	(341,970,400)
2021052603529	FWD	USDMXN	05/28/2021	15,000,000	19.89	(298,350,000)
2021052603067	FWD	USDMXN	05/28/2021	(8,600,000)	19.87	170,882,000
2021052603091	FWD	USDMXN	05/28/2021	(21,075,767)	19.864	418,649,026
2021052603119	FWD	USDMXN	05/28/2021	(8,600,000)	19.8429	170,648,940
2021052603351	FWD	USDMXN	05/28/2021	(15,000,000)	19.885	298,275,000
2021022603322	FWD	USDMXN	06/01/2021	(57,680,000)	21.1101	1,217,630,568
2021052603229	FWD	USDMXN	06/01/2021	(17,200,000)	19.8922	342,145,840
2021052603530	FWD	USDMXN	06/01/2021	(15,000,000)	19.9003	298,504,500
2021052703059	FWD	USDMXN	06/01/2021	20,000,000	19.9109	(398,218,000)
2021052803064	FWD	USDMXN	06/01/2021	11,780,000	19.97	(235,246,600)
2021052803213	FWD	USDMXN	06/01/2021	55,000,000	20.018	(1,100,990,000)
2021022603336	FWD	USDMXN	06/02/2021	50,000,000	21.1155	(1,055,775,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021052803065	FWD	USDMXN	06/02/2021	(11,780,000)	19.97248	235,275,756
2021052803214	FWD	USDMXN	06/02/2021	(55,000,000)	20.0205	1,101,127,500
2021060103010	FWD	USDMXN	06/02/2021	19,880,000	19.89	(395,413,200)
2021060103011	FWD	USDMXN	06/03/2021	(19,880,000)	19.8924	395,460,912
2021060103213	FWD	USDMXN	06/03/2021	(15,000,000)	19.885	298,275,000
2021060103248	FWD	USDMXN	06/03/2021	(50,000,000)	19.9	995,000,000
2021060203004	FWD	USDMXN	06/03/2021	(120,000)	19.98284	2,397,941
2020122103327	FWD	USDMXN	06/04/2021	386,667	20.6686	(7,991,861)
2021052603068	FWD	USDMXN	06/04/2021	8,600,000	19.8874	(171,031,640)
2021060203005	FWD	USDMXN	06/04/2021	120,000	19.9853	(2,398,236)
2021060203596	FWD	USDMXN	06/04/2021	30,000,000	19.893	(596,790,000)
2021060203594	FWD	USDMXN	06/04/2021	(8,700,000)	19.893	173,069,100
2021060303002	FWD	USDMXN	06/04/2021	4,593,333	19.99094	(91,825,061)
2021060403031	FWD	USDMXN	06/04/2021	(40,000,000)	20.015	800,600,000
2021060303575	FWD	USDMXN	06/07/2021	5,000,000	20.135	(100,675,000)
2021060303003	FWD	USDMXN	06/07/2021	(4,593,333)	19.9981	91,857,937
2021060403032	FWD	USDMXN	06/07/2021	40,000,000	20.02185	(800,874,000)
2021060403001	FWD	USDMXN	06/07/2021	(406,667)	20.13284	8,187,357
2021060403002	FWD	USDMXN	06/08/2021	406,667	20.1352	(8,188,317)
2021060703020	FWD	USDMXN	06/08/2021	(590,930)	19.73691	11,663,139
2021060703021	FWD	USDMXN	06/09/2021	590,930	19.7392	(11,664,491)
2021060803001	FWD	USDMXN	06/09/2021	(590,930)	19.75131	11,671,650
2021060803002	FWD	USDMXN	06/10/2021	590,930	19.7536	(11,673,000)
2021060803248	FWD	USDMXN	06/10/2021	50,000,000	19.775	(988,750,000)
2021060803280	FWD	USDMXN	06/10/2021	(20,000,000)	19.77	395,400,000
2021060803349	FWD	USDMXN	06/10/2021	(30,000,000)	19.77	593,100,000
2021060903015	FWD	USDMXN	06/10/2021	(590,930)	19.65898	11,617,084
2021060903125	FWD	USDMXN	06/10/2021	(40,000,000)	19.665	786,600,000
2020122103330	FWD	USDMXN	06/11/2021	386,667	20.6846	(7,998,048)
2021060203595	FWD	USDMXN	06/11/2021	8,700,000	19.91	(173,217,000)
2021060203597	FWD	USDMXN	06/11/2021	(30,000,000)	19.91	597,300,000
2021060903016	FWD	USDMXN	06/11/2021	590,930	19.6612	(11,618,398)
2021060903126	FWD	USDMXN	06/11/2021	40,000,000	19.66723	(786,689,000)
2021061003001	FWD	USDMXN	06/11/2021	3,447,690	19.69178	(67,891,151)
2021040803101	FWD	USDMXN	06/14/2021	30,000,000	20.238	(607,140,000)
2021061003437	FWD	USDMXN	06/14/2021	20,000,000	19.7	(394,000,000)
2021061003002	FWD	USDMXN	06/14/2021	(3,447,690)	19.6985	67,914,316
2021061003099	FWD	USDMXN	06/14/2021	(5,000,000)	19.7233	98,616,500
2021061003428	FWD	USDMXN	06/14/2021	(25,000,000)	19.7	492,500,000
2021061103003	FWD	USDMXN	06/14/2021	(16,552,310)	19.6994	326,070,506
2021061403220	FWD	USDMXN	06/14/2021	500,000,000	19.88	(9,940,000,000)
2021061403223	FWD	USDMXN	06/14/2021	(500,000,000)	19.93619	9,968,095,000
2021061103004	FWD	USDMXN	06/15/2021	16,552,310	19.7017	(326,108,651)
2021061103579	FWD	USDMXN	06/15/2021	(75,000,000)	19.7385	1,480,387,500
2021061403048	FWD	USDMXN	06/15/2021	55,000,000	19.915	(1,095,325,000)
2021061403051	FWD	USDMXN	06/15/2021	3,447,690	19.9117	(68,649,367)
2021030503603	FWD	USDMXN	06/16/2021	(20,000,000)	21.5412	430,824,000
2021042303118	FWD	USDMXN	06/16/2021	10,000,000	19.9903	(199,903,000)
2021052403140	FWD	USDMXN	06/16/2021	100,000,000	19.906	(1,990,600,000)
2021052403143	FWD	USDMXN	06/16/2021	50,000,000	19.906	(995,300,000)
2021052403263	FWD	USDMXN	06/16/2021	30,000,000	19.9285	(597,855,000)
2021052403266	FWD	USDMXN	06/16/2021	20,000,000	19.9285	(398,570,000)
2021052403475	FWD	USDMXN	06/16/2021	50,000,000	19.9315	(996,575,000)
2021052403112	FWD	USDMXN	06/16/2021	(247,080,357)	19.9204	4,921,939,534
2021052603120	FWD	USDMXN	06/16/2021	8,600,000	19.88832	(171,039,535)
2021052603049	FWD	USDMXN	06/16/2021	(50,000,000)	19.9546	997,730,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021052703292	FWD	USDMXN	06/16/2021	50,000,000	20.066	(1,003,300,000)
2021061103086	FWD	USDMXN	06/16/2021	76,500,000	19.7125	(1,508,006,250)
2021061403049	FWD	USDMXN	06/16/2021	(55,000,000)	19.91728	1,095,450,125
2021061403052	FWD	USDMXN	06/16/2021	(3,447,690)	19.914	68,657,293
2021061503024	FWD	USDMXN	06/16/2021	1,928,046	19.99154	(38,544,613)
2021021203216	FWD	USDMXN	06/17/2021	50,000,000	20.218	(1,010,900,000)
2021021203113	FWD	USDMXN	06/17/2021	(71,130,000)	20.2725	1,441,982,925
2021052603092	FWD	USDMXN	06/17/2021	21,075,767	19.91192	(419,658,913)
2021061503033	FWD	USDMXN	06/17/2021	50,000,000	19.977	(998,850,000)
2021061503025	FWD	USDMXN	06/17/2021	(1,928,046)	19.9938	38,548,971
2021061603035	FWD	USDMXN	06/17/2021	(25,000,000)	20.065	501,625,000
2021061603039	FWD	USDMXN	06/17/2021	(17,720)	20.10654	356,293
2020122103332	FWD	USDMXN	06/18/2021	386,667	20.7006	(8,004,235)
2020122103335	FWD	USDMXN	06/18/2021	386,667	20.7006	(8,004,235)
2021061603036	FWD	USDMXN	06/18/2021	25,000,000	20.06733	(501,683,125)
2021061603040	FWD	USDMXN	06/18/2021	17,720	20.1089	(356,335)
2021061603192	FWD	USDMXN	06/18/2021	25,000,000	20.025	(500,625,000)
2021061703003	FWD	USDMXN	06/18/2021	(10,791,054)	20.46423	220,830,596
2021031703140	FWD	USDMXN	06/21/2021	30,000,000	20.9045	(627,135,000)
2021051903130	FWD	USDMXN	06/21/2021	(50,000,000)	19.8709	993,545,000
2021061703004	FWD	USDMXN	06/21/2021	10,791,054	20.4714	(220,907,980)
2021061803188	FWD	USDMXN	06/21/2021	9,208,946	20.70583	(190,678,908)
2021062103101	FWD	USDMXN	06/21/2021	1,818,448	20.63712	(37,527,529)
2021062103232	FWD	USDMXN	06/21/2021	43,700,000	20.61	(900,657,000)
2021062103095	FWD	USDMXN	06/21/2021	(43,700,000)	20.61	900,657,000
2021061803254	FWD	USDMXN	06/22/2021	50,000,000	20.68	(1,034,000,000)
2021061803257	FWD	USDMXN	06/22/2021	50,000,000	20.68	(1,034,000,000)
2021061803295	FWD	USDMXN	06/22/2021	50,000,000	20.7	(1,035,000,000)
2021061803189	FWD	USDMXN	06/22/2021	(9,208,946)	20.7092	190,709,908
2021062103096	FWD	USDMXN	06/22/2021	43,700,000	20.61445	(900,851,465)
2021062103415	FWD	USDMXN	06/22/2021	100,000,000	20.5	(2,050,000,000)
2021062103002	FWD	USDMXN	06/22/2021	(40,791,054)	20.57473	839,264,768
2021062103019	FWD	USDMXN	06/22/2021	(50,000,000)	20.584	1,029,200,000
2021062103031	FWD	USDMXN	06/22/2021	(50,000,000)	20.608	1,030,400,000
2021062103102	FWD	USDMXN	06/22/2021	(1,818,448)	20.64116	37,534,866
2021062103233	FWD	USDMXN	06/22/2021	(43,700,000)	20.61445	900,851,465
2021062103413	FWD	USDMXN	06/22/2021	(100,000,000)	20.5	2,050,000,000
2021062103003	FWD	USDMXN	06/23/2021	40,791,054	20.5784	(839,414,623)
2021062103020	FWD	USDMXN	06/23/2021	50,000,000	20.5881	(1,029,405,000)
2021062103032	FWD	USDMXN	06/23/2021	50,000,000	20.6123	(1,030,615,000)
2021062103099	FWD	USDMXN	06/23/2021	(50,000,000)	20.617	1,030,850,000
2021062103238	FWD	USDMXN	06/23/2021	(5,000,000)	20.585	102,925,000
2021062103411	FWD	USDMXN	06/23/2021	(50,000,000)	20.485	1,024,250,000
2021062203322	FWD	USDMXN	06/23/2021	75,000,000	20.63	(1,547,250,000)
2021062203324	FWD	USDMXN	06/23/2021	5,000,000	20.63	(103,150,000)
2021062203480	FWD	USDMXN	06/23/2021	3,500,000	20.63	(72,205,000)
2021062203000	FWD	USDMXN	06/23/2021	(35,791,054)	20.617	737,904,157
2021062203319	FWD	USDMXN	06/23/2021	(80,000,000)	20.63	1,650,400,000
2021062203475	FWD	USDMXN	06/23/2021	(3,500,000)	20.63	72,205,000
2021062203001	FWD	USDMXN	06/24/2021	35,791,054	20.622	(738,083,112)
2021062203349	FWD	USDMXN	06/24/2021	30,000,000	20.4339	(613,017,000)
2021062203394	FWD	USDMXN	06/24/2021	20,000,000	20.4051	(408,102,000)
2021062203283	FWD	USDMXN	06/24/2021	(30,000,000)	20.46	613,800,000
2021062203526	FWD	USDMXN	06/24/2021	(63,700,000)	20.36	1,296,932,000
2021062203528	FWD	USDMXN	06/24/2021	(91,054)	20.3633	1,854,157
2021062303026	FWD	USDMXN	06/24/2021	69,000,000	20.26	(1,397,940,000)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021062303028	FWD	USDMXN	06/24/2021	(69,000,000)	20.26	1,397,940,000
2020122103341	FWD	USDMXN	06/25/2021	386,667	20.7166	(8,010,421)
2021022303110	FWD	USDMXN	06/25/2021	20,000,000	20.8075	(416,150,000)
2021061803335	FWD	USDMXN	06/25/2021	(15,000,000)	20.709	310,635,000
2021062203527	FWD	USDMXN	06/25/2021	63,700,000	20.3626	(1,297,097,620)
2021062203529	FWD	USDMXN	06/25/2021	91,054	20.36731	(1,854,522)
2021062303159	FWD	USDMXN	06/25/2021	50,000,000	20.2703	(1,013,515,000)
2021062303363	FWD	USDMXN	06/25/2021	20,000,000	20.19	(403,800,000)
2021062303414	FWD	USDMXN	06/25/2021	26,851	20.2	(542,380)
2021062303027	FWD	USDMXN	06/25/2021	(69,000,000)	20.2635	1,398,181,500
2021062303179	FWD	USDMXN	06/25/2021	(50,000,000)	20.27	1,013,500,000
2021062303242	FWD	USDMXN	06/25/2021	(20,000,000)	20.213	404,260,000
2021011903322	FWD	USDMXN	06/28/2021	(10,150,000)	20.02	203,203,000
2021011903328	FWD	USDMXN	06/28/2021	(1,650,000)	20.024	33,039,600
2021011903329	FWD	USDMXN	06/28/2021	(400,000)	20.02	8,008,000
2021012203434	FWD	USDMXN	06/28/2021	10,000,000	20.262	(202,620,000)
2021062303029	FWD	USDMXN	06/28/2021	69,000,000	20.2704	(1,398,657,600)
2021062303180	FWD	USDMXN	06/28/2021	50,000,000	20.2776	(1,013,880,000)
2021062303160	FWD	USDMXN	06/28/2021	(50,000,000)	20.27877	1,013,938,605
2021062303415	FWD	USDMXN	06/28/2021	(26,851)	20.20788	542,592
2021062403306	FWD	USDMXN	06/28/2021	(15,215,558)	19.99	304,159,012
2021062403432	FWD	USDMXN	06/28/2021	(6,878,096)	19.99	137,493,142
2021062403459	FWD	USDMXN	06/28/2021	(30,000,000)	19.85	595,500,000
2021062503019	FWD	USDMXN	06/28/2021	(14,721,041)	19.71533	290,230,178
2021062503020	FWD	USDMXN	06/29/2021	14,721,041	19.7179	(290,268,005)
2021062503326	FWD	USDMXN	06/29/2021	(10,000,000)	19.7729	197,729,000
2021062803000	FWD	USDMXN	06/29/2021	(4,721,041)	19.85054	93,715,214
2021062903045	FWD	USDMXN	06/29/2021	(7,400,000)	19.82	146,668,000
2021030103144	FWD	USDMXN	06/30/2021	(62,430,000)	20.8388	1,300,966,284
2021062103100	FWD	USDMXN	06/30/2021	50,000,000	20.639	(1,031,950,000)
2021062103412	FWD	USDMXN	06/30/2021	50,000,000	20.5038	(1,025,190,000)
2021062203320	FWD	USDMXN	06/30/2021	80,000,000	20.6491	(1,651,928,000)
2021062203476	FWD	USDMXN	06/30/2021	3,500,000	20.6491	(72,271,850)
2021062203323	FWD	USDMXN	06/30/2021	(75,000,000)	20.6491	1,548,682,500
2021062203325	FWD	USDMXN	06/30/2021	(5,000,000)	20.6491	103,245,500
2021062203481	FWD	USDMXN	06/30/2021	(3,500,000)	20.6491	72,271,850
2021062803001	FWD	USDMXN	06/30/2021	4,721,041	19.8531	(93,727,290)
2021062803026	FWD	USDMXN	06/30/2021	(20,000,000)	19.8416	396,832,000
2021062903046	FWD	USDMXN	06/30/2021	7,400,000	19.82235	(146,685,390)
2021062903140	FWD	USDMXN	06/30/2021	2,200,000	19.8	(43,560,000)
2021062903174	FWD	USDMXN	06/30/2021	3,500,000	19.8	(69,300,000)
2021062903048	FWD	USDMXN	06/30/2021	(6,791,041)	19.81566	134,568,966
2021062903168	FWD	USDMXN	06/30/2021	(3,500,000)	19.8	69,300,000
2021062903204	FWD	USDMXN	06/30/2021	(2,200,000)	19.79824	43,556,122

Liquidados anticipadamente

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
C59376	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	usd	10,000,000	usd	230,320,000	mxn	
C59377	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	usd	20,000,000	usd	474,500,000	mxn	
C59388	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	usd	10,000,000	usd	250,600,000	mxn	
E57876	Eq Option	28/05/2021	Buy	U	mxn					23,825,000
E57883	Eq Option	28/05/2021	Sell	U	mxn					23,825,000
E57884	Eq Option	28/05/2021	Sell	U	mxn					23,825,000
E57885	Eq Option	28/05/2021	Buy	U	mxn					23,825,000
E60984	Eq Option	16/11/2021	Buy	U	mxn					52,910,000
E60993	Eq Option	16/11/2021	Buy	U	mxn					52,910,000
E60994	Eq Option	16/11/2021	Sell	U	mxn					52,910,000
E60995	Eq Option	16/11/2021	Sell	U	mxn					52,910,000
E66383	Eq Option	19/05/2021	Buy	U	mxn					2,600,000
E66384	Eq Option	19/05/2021	Sell	U	mxn					2,600,000
E66656	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	mxn					95,210,000
E66657	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	mxn					95,210,000
E66658	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	mxn					95,210,000
E66659	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	mxn					95,210,000
E69569	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	mxn					71,191,500
E69570	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	mxn					71,191,500
E69571	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	mxn					71,191,500
E69572	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	mxn					71,191,500
MGB352	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	usd	20,000,000	usd	20,000,000	usd	
MGB963	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	usd	10,000,000	usd	10,000,000	usd	
MGD885	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	usd	10,000,000	usd	10,000,000	usd	
MJX140	Term Deposit	30/10/2025	Buy	U	usd	40,850,409	usd	40,850,409	usd	
MMP527	Term Loan	16/04/2025	Buy	U	mxn	93,677,757	mxn	93,677,757	mxn	
MNF305	Term Deposit	11/12/2023	Buy	U	mxn	130,000,000	mxn	130,000,000	mxn	
MNF418	Term Deposit	20/03/2023	Buy	U	mxn	582,494,669	mxn	582,494,669	mxn	
MNF419	Term Deposit	18/06/2024	Buy	U	mxn	101,000,000	mxn	101,000,000	mxn	
MNF451	Term Deposit	11/12/2026	Buy	U	mxn	438,000,000	mxn	438,000,000	mxn	
MNF498	Term Deposit	23/10/2023	Buy	U	usd	45,000,000	usd	45,000,000	usd	
P16209	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					21,996,015
P16210	Cap	12/07/2022	Buy	U	mxn					21,996,015
P16211	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					21,996,015
P16212	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					12,925,040
P16214	Cap	12/07/2022	Buy	U	mxn					12,925,040
P16215	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					12,925,040
P16216	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					6,428,442
P16217	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					6,428,442
P16219	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					3,119,298
P16220	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					3,119,298
P16221	Cap	12/07/2022	Buy	U	mxn					3,119,298

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P16222	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					3,531,205
P16223	Cap	12/07/2022	Sell	U	mxn					3,531,205
P16224	Cap	12/07/2022	Buy	U	mxn					3,531,205
P16225	Cap	12/07/2022	Buy	U	mxn					6,428,442
P17164	Cap	01/09/2021	Buy	U	mxn					2,578,665
P17165	Cap	01/09/2021	Sell	U	mxn					2,578,665
P17166	Cap	01/09/2021	Sell	U	mxn					2,360,422
P17167	Cap	01/09/2021	Buy	U	mxn					2,360,422
P17168	Cap	01/09/2021	Sell	U	mxn					2,360,422
SAL520	SC Swap	28/02/2022	Buy	U	mxn	886,506	mxn	886,506	mxn	
SAL542	SC Swap	28/02/2022	Buy	U	mxn	886,506	mxn	886,506	mxn	
SCE325	SC Swap	11/12/2024	Buy	U	mxn	34,548,431	mxn	34,548,431	mxn	
SCE367	SC Swap	11/12/2024	Buy	U	mxn	34,548,431	mxn	34,548,431	mxn	
SCG418	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mxn	13,724,000	mxn	13,724,000	mxn	
SCG420	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	mxn	13,724,000	mxn	13,724,000	mxn	
SCU483	SC Swap	09/09/2021	Buy	U	mxn	71,084,957	mxn	71,084,957	mxn	
SCU484	SC Swap	09/09/2021	Buy	U	mxn	71,084,957	mxn	71,084,957	mxn	
SCU485	SC Swap	09/11/2021	Buy	U	mxn	11,025,778	mxn	11,025,778	mxn	
SCU486	SC Swap	09/11/2021	Buy	U	mxn	11,025,778	mxn	11,025,778	mxn	
SCU487	SC Swap	08/09/2021	Buy	U	mxn	16,152,576	mxn	16,152,576	mxn	
SCU488	SC Swap	08/09/2021	Buy	U	mxn	16,152,576	mxn	16,152,576	mxn	
SCU489	SC Swap	07/01/2022	Buy	U	mxn	21,092,553	mxn	21,092,553	mxn	
SCU490	SC Swap	07/01/2022	Buy	U	mxn	21,092,553	mxn	21,092,553	mxn	
SCU491	SC Swap	07/01/2022	Buy	U	mxn	7,000,000	mxn	7,000,000	mxn	
SCU492	SC Swap	07/01/2022	Buy	U	mxn	7,000,000	mxn	7,000,000	mxn	
SCU497	SC Swap	08/04/2022	Buy	U	mxn	10,970,400	mxn	10,970,400	mxn	
SCU498	SC Swap	08/04/2022	Buy	U	mxn	10,970,400	mxn	10,970,400	mxn	
SCU500	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	13,524,480	mxn	13,524,480	mxn	
SCU501	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	13,524,480	mxn	13,524,480	mxn	
SCU503	SC Swap	01/07/2022	Buy	U	mxn	3,703,392	mxn	3,703,392	mxn	
SCU504	SC Swap	01/07/2022	Buy	U	mxn	3,703,392	mxn	3,703,392	mxn	
SCU505	SC Swap	15/06/2022	Buy	U	mxn	3,344,000	mxn	3,344,000	mxn	
SCU506	SC Swap	15/06/2022	Buy	U	mxn	3,344,000	mxn	3,344,000	mxn	
SCU507	SC Swap	20/07/2022	Buy	U	mxn	3,500,000	mxn	3,500,000	mxn	
SCU508	SC Swap	20/07/2022	Buy	U	mxn	3,500,000	mxn	3,500,000	mxn	
SCU511	SC Swap	11/08/2021	Buy	U	mxn	5,155,236	mxn	5,155,236	mxn	
SCU512	SC Swap	11/08/2021	Buy	U	mxn	5,155,236	mxn	5,155,236	mxn	
SCU513	SC Swap	16/08/2021	Buy	U	mxn	9,400,000	mxn	9,400,000	mxn	
SCU514	SC Swap	16/08/2021	Buy	U	mxn	9,400,000	mxn	9,400,000	mxn	
SCU519	SC Swap	16/08/2021	Buy	U	mxn	5,300,000	mxn	5,300,000	mxn	
SCU520	SC Swap	16/08/2021	Buy	U	mxn	5,300,000	mxn	5,300,000	mxn	
SCU524	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	5,200,000	mxn	5,200,000	mxn	
SCU525	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	5,200,000	mxn	5,200,000	mxn	
SCU539	SC Swap	17/08/2021	Buy	U	mxn	6,600,000	mxn	6,600,000	mxn	
SCU540	SC Swap	17/08/2021	Buy	U	mxn	6,600,000	mxn	6,600,000	mxn	
SCU541	SC Swap	13/08/2021	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SCU542	SC Swap	13/08/2021	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SCU544	SC Swap	10/08/2021	Buy	U	mxn	5,700,000	mxn	5,700,000	mxn	
SCU545	SC Swap	10/08/2021	Buy	U	mxn	5,700,000	mxn	5,700,000	mxn	
SCU638	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	6,300,000	mxn	6,300,000	mxn	
SCU639	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	6,300,000	mxn	6,300,000	mxn	
SCU640	SC Swap	01/08/2021	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SCU641	SC Swap	01/08/2021	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SCU645	SC Swap	13/08/2021	Buy	U	mxn	6,000,000	mxn	6,000,000	mxn	
SCU646	SC Swap	13/08/2021	Buy	U	mxn	6,000,000	mxn	6,000,000	mxn	
SCU648	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	6,500,000	mxn	6,500,000	mxn	
SCU649	SC Swap	12/08/2021	Buy	U	mxn	6,500,000	mxn	6,500,000	mxn	
SCU650	SC Swap	10/08/2021	Buy	U	mxn	6,400,000	mxn	6,400,000	mxn	
SCU651	SC Swap	10/08/2021	Buy	U	mxn	6,400,000	mxn	6,400,000	mxn	
SCU652	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,900,000	mxn	7,900,000	mxn	
SCU653	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,900,000	mxn	7,900,000	mxn	
SCU655	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SCU656	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	5,000,000	mxn	5,000,000	mxn	
SCU661	SC Swap	11/07/2022	Buy	U	mxn	6,900,000	mxn	6,900,000	mxn	
SCU662	SC Swap	11/07/2022	Buy	U	mxn	6,900,000	mxn	6,900,000	mxn	
SCU663	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,300,000	mxn	7,300,000	mxn	
SCU664	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,300,000	mxn	7,300,000	mxn	
SCU665	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	6,800,000	mxn	6,800,000	mxn	
SCU666	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	6,800,000	mxn	6,800,000	mxn	
SCU667	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,900,000	mxn	7,900,000	mxn	
SCU668	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,900,000	mxn	7,900,000	mxn	
SCU669	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	8,600,000	mxn	8,600,000	mxn	
SCU670	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	8,600,000	mxn	8,600,000	mxn	
SCU671	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,495,000	mxn	7,495,000	mxn	
SCU673	SC Swap	04/08/2022	Buy	U	mxn	7,495,000	mxn	7,495,000	mxn	
SCV768	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	usd	40,850,409	usd	40,850,409	usd	
SCW410	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	usd	40,850,409	usd	40,850,409	usd	
SCW416	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	usd	40,850,409	usd	40,850,409	usd	
SDL170	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mxn	28,000,000	mxn	28,000,000	mxn	
SDL175	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mxn	28,000,000	mxn	28,000,000	mxn	
SDL347	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDM267	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	mxn	2,100,000,000	mxn	2,100,000,000	mxn	
SDM268	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	mxn	2,100,000,000	mxn	2,100,000,000	mxn	
SDM820	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	mxn	50,000,000	mxn	50,000,000	mxn	
SDO143	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDO145	SC Swap	13/03/2031	Buy	U	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDP187	SC Swap	25/07/2023	Buy	U	mxn	1,870,439,257	mxn	1,870,439,257	mxn	
SDS096	SC Swap	10/08/2023	Buy	U	mxn	9,330,025	mxn	9,330,025	mxn	
SDS104	SC Swap	10/08/2023	Buy	U	mxn	9,330,025	mxn	9,330,025	mxn	
SDS149	SC Swap	23/10/2023	Buy	U	usd	45,000,000	usd	45,000,000	usd	
SDS152	SC Swap	23/10/2023	Buy	U	usd	45,000,000	usd	45,000,000	usd	
SDS168	SC Swap	23/10/2023	Buy	U	usd	45,000,000	usd	45,000,000	usd	
SDS235	SC Swap	11/12/2023	Buy	U	mxn	130,000,000	mxn	130,000,000	mxn	
SDS471	SC Swap	20/03/2023	Buy	U	mxn	582,494,669	mxn	582,494,669	mxn	
SDS474	SC Swap	18/06/2024	Buy	U	mxn	101,000,000	mxn	101,000,000	mxn	
SDS483	SC Swap	18/06/2024	Buy	U	mxn	101,000,000	mxn	101,000,000	mxn	
SDS485	SC Swap	20/03/2023	Buy	U	mxn	582,494,669	mxn	582,494,669	mxn	
SDS492	SC Swap	20/03/2023	Buy	U	mxn	582,494,669	mxn	582,494,669	mxn	
SDS510	SC Swap	18/06/2024	Buy	U	mxn	101,000,000	mxn	101,000,000	mxn	
SDS538	SC Swap	11/12/2026	Buy	U	mxn	438,000,000	mxn	438,000,000	mxn	
SDS544	SC Swap	11/12/2026	Buy	U	mxn	438,000,000	mxn	438,000,000	mxn	
SDS548	SC Swap	11/12/2026	Buy	U	mxn	438,000,000	mxn	438,000,000	mxn	
SDS563	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDS574	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDS734	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	200,000	usd	200,000	usd	
SDS748	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	200,000	usd	200,000	usd	
SDS832	SC Swap	28/02/2024	Buy	U	mxn	3,105,600,000	mxn	3,105,600,000	mxn	
SDS838	SC Swap	28/02/2024	Buy	U	mxn	3,105,600,000	mxn	3,105,600,000	mxn	
SDS914	SC Swap	10/11/2023	Buy	U	mxn	17,607,764	mxn	17,607,764	mxn	
SDS922	SC Swap	10/11/2023	Buy	U	mxn	17,607,764	mxn	17,607,764	mxn	
SDS958	SC Swap	11/12/2023	Buy	U	mxn	130,000,000	mxn	130,000,000	mxn	
SDS968	SC Swap	11/12/2023	Buy	U	mxn	130,000,000	mxn	130,000,000	mxn	
SDS992	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDT090	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDT135	SC Swap	10/11/2023	Buy	U	mxn	17,653,838	mxn	17,653,838	mxn	
SDT138	SC Swap	10/11/2023	Buy	U	mxn	17,653,838	mxn	17,653,838	mxn	
SDT705	SC Swap	10/02/2023	Buy	U	mxn	16,641,917	mxn	16,641,917	mxn	
SDT706	SC Swap	10/01/2024	Buy	U	mxn	11,654,727	mxn	11,654,727	mxn	
SDT725	SC Swap	10/02/2023	Buy	U	mxn	16,641,917	mxn	16,641,917	mxn	
SDT736	SC Swap	10/01/2024	Buy	U	mxn	11,654,727	mxn	11,654,727	mxn	
SDT876	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	500,000	usd	500,000	usd	
SDT886	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	500,000	usd	500,000	usd	
SDU085	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDU096	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDU105	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	600,000	usd	600,000	usd	
SDU125	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	600,000	usd	600,000	usd	
SDU383	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDU395	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	1,000,000	usd	1,000,000	usd	
SDU451	SC Swap	30/04/2024	Buy	U	mxn	53,775,448	mxn	53,775,448	mxn	
SDU452	SC Swap	30/04/2024	Buy	U	mxn	53,775,448	mxn	53,775,448	mxn	
SDU480	SC Swap	10/01/2024	Buy	U	mxn	6,458,611	mxn	6,458,611	mxn	
SDU533	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	450,000	usd	450,000	usd	
SDU539	SC Swap	11/02/2022	Buy	U	usd	450,000	usd	450,000	usd	
SDU598	SC Swap	10/01/2024	Buy	U	mxn	6,458,611	mxn	6,458,611	mxn	
SDU718	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	800,000	usd	800,000	usd	
SDU719	SC Swap	22/11/2022	Buy	U	usd	800,000	usd	800,000	usd	
SDU918	SC Swap	02/08/2024	Buy	U	usd	80,000,000	usd	80,000,000	usd	
SDU924	SC Swap	02/08/2024	Buy	U	usd	80,000,000	usd	80,000,000	usd	
SDV122	SC Swap	19/01/2024	Buy	U	mxn	64,583,333	mxn	64,583,333	mxn	
SDV366	SC Swap	31/05/2022	Buy	U	mxn	25,000,000	mxn	25,000,000	mxn	
SDV428	SC Swap	31/05/2022	Buy	U	mxn	25,000,000	mxn	25,000,000	mxn	
SDV682	SC Swap	28/02/2024	Buy	U	usd	118,400,000	usd	118,400,000	usd	
SDV689	SC Swap	28/02/2024	Buy	U	usd	118,400,000	usd	118,400,000	usd	
SDX010	SC Swap	24/09/2021	Buy	U	usd	1,250,000	usd	1,250,000	usd	
SDX023	SC Swap	24/09/2021	Buy	U	usd	1,250,000	usd	1,250,000	usd	
SDX786	SC Swap	16/05/2031	Buy	U	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDX787	SC Swap	16/05/2031	Buy	U	mxn	14,000,000	mxn	14,000,000	mxn	
SDY457	SC Swap	02/06/2023	Buy	U	mxn	105,000,000	mxn	105,000,000	mxn	
SDY458	SC Swap	02/06/2023	Buy	U	mxn	105,000,000	mxn	105,000,000	mxn	
SDZ155	SC Swap	09/06/2023	Buy	U	mxn	108,000,000	mxn	108,000,000	mxn	
SDZ156	SC Swap	09/06/2023	Buy	U	mxn	108,000,000	mxn	108,000,000	mxn	
SX7342	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	mxn	2,100,000,000	mxn	2,100,000,000	mxn	
SX7345	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	mxn	2,100,000,000	mxn	2,100,000,000	mxn	
SY4465	SC Swap	09/06/2021	Buy	U	mxn	23,093,600	mxn	23,093,600	mxn	
SY4471	SC Swap	09/06/2021	Buy	U	mxn	23,093,600	mxn	23,093,600	mxn	

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2066675	FX	25,000	02-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2066676	FX	25,000	02-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2066677	FX	25,000	16-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2066678	FX	25,000	16-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069160	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069161	FX	250,000	04-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069162	FX	250,000	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069163	FX	29,271	04-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069164	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069165	FX	250,000	03-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069166	FX	250,000	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069167	FX	29,271	03-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069967	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069968	FX	400,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069969	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2069970	FX	43,064	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2074934	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2074935	FX	500,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2074936	FX	500,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2074937	FX	22,196	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2075024	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2075025	FX	650,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2075026	FX	650,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2075027	FX	39,539	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076505	FX	2,000,000	20-abr-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076506	FX	2,000,000	20-abr-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076507	FX	2,000,000	25-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076508	FX	2,000,000	25-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076525	FX	1,500,000	21-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076526	FX	1,500,000	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076573	FX	100,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076574	FX	100,000	18-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076575	FX	100,000	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076576	FX	9,113	18-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076577	FX	100,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076578	FX	100,000	15-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076579	FX	100,000	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076580	FX	9,113	15-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076765	FX	500,000	22-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2076766	FX	500,000	22-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2078513	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2078514	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2078515	FX	1,000,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2079084	FX	4,348	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2079088	FX	4,348	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2079100	FX	4,348	17-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2079104	FX	4,348	21-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080297	FX	500,000	19-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080298	FX	500,000	19-may-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080299	FX	500,000	19-may-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080300	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080301	FX	500,000	17-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2080302	FX	500,000	17-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2081611	FX	400,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2081612	FX	400,000	28-jun-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2081613	FX	400,000	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED
2081614	FX	43,064	28-jun-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	REVERSED

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

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2021 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

CONTRAPARTE	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	USD	-	(13,500,000)
CLIENTE 2	MXN	-	(555,100,000)
CLIENTE 3	MXN	118,000,000.00	(87,000,000)
CLIENTE 4	MXN	448,000,000.00	(544,000,000)
CLIENTE 5	MXN	-	(1,000,000)
CLIENTE 6	MXN	13,800,000.00	(15,300,000)
CLIENTE 7	MXN	284,100,000.00	(121,000,000)
CLIENTE 8	MXN	15,300,000	(81,600,000)
CLIENTE 9	MXN	1,068,669,634	(745,529,436)
CLIENTE 10	USD	45,090,000	(51,830,000)
CLIENTE 11	MXN	777,400,000	(521,800,000)
CLIENTE 12	USD	7,630,000	(148,650,000)
CLIENTE 13	USD	127,000,000	(45,000,000)
CLIENTE 14	USD	250,000	(1,180,000)
CLIENTE 15	USD	6,370,000.00	(6,010,000)
CLIENTE 16	MXN	102,200,000	(364,000,000)
CLIENTE 17	MXN	-	(115,000,000)
CLIENTE 18	USD	-	(2,797,340)
CLIENTE 19	MXN	-	(48,000,000)
CLIENTE 20	USD	150,000.00	-
CLIENTE 21	USD	11,670,000	(17,960,000.00)
CLIENTE 22	MXN	232,120,870	(4,038,670,743)
CLIENTE 23	MXN	179,600,000	(128,500,000)
CLIENTE 24	USD	250,000	-
CLIENTE 25	USD	810,000	(1,450,000)
CLIENTE 26	MXN	139,100,000	(133,300,000)
TOTAL		3,577,510,504	(7,788,177,518)

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

Cifras expresadas en pesos

Deal	Fecha de evento	Contraparte/ Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento	Producto
SAK055	28/04/2021	Cliente 1	MXN	1,407,421	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/04/2021	Cliente 2	MXN	1,670,346	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2077960	29/04/2021	Cliente 3	MXN	806,000	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
SY8025	30/04/2021	Cliente 4	USD	28,249	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2069432	20/05/2021	Cliente 5	USD	740,000	DISCREPANCIA CON LIQUIDACION	FX Options (Vanilla)
SAK065	27/05/2021	Cliente 6	MXN	278,365	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2074931	28/05/2021	Cliente 6	MXN	23,472,000	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
SAK055	28/05/2021	Cliente 7	MXN	1,400,901	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	31/05/2021	Cliente 8	MXN	1,715,984	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SY8025	01/06/2021	Cliente 9	MXN	29,870	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2021060403058	07/06/2021	Cliente 10	MXN	48,313,247	NO ENVIO LOS FONDOS	Forwards FX
P16955	14/06/2021	Cliente 11	MXN	319,498	NO FONDEO SU CUENTA	Caps & Floors
SDV942	23/06/2021	Cliente 12	MXN	104,798	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SAK055	28/06/2021	Cliente 13	MXN	1,437,731	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SDS087	28/06/2021	Cliente 14	MXN	188,706	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/06/2021	Cliente 15	MXN	1,544,204	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2021052003477	29/06/2021	Cliente 16	MXN	1,281,186	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021051003529	29/06/2021	Cliente 17	MXN	1,885,570	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021041903514	29/06/2021	Cliente 18	MXN	992,312	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
SDS278	30/06/2021	Cliente 19	MXN	111,900	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SDV030	30/06/2021	Cliente 20	MXN	185,267	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	Nego	2,594,204,482	Compra	Divisas	Divisas	77,851,121,579	107,259,521,266	2,307,869,618	286,334,865	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	Nego	2,729,645,359	Venta	Divisas	Divisas	(77,954,633,068)	(107,105,614,774)	2,479,277,933	250,367,426	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	445,631,000	Compra	Acción	Acción	51,475,240	66,093,581	-	445,631,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	(110,766,000)	Venta	Acción	Acción	(43,283,394)	(55,847,572)	-	(110,766,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	5,735,137,857	Compra	Divisas	Divisas	197,307,084	106,862,289	5,147,009,336	588,128,521	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	5,735,137,857	Venta	Divisas	Divisas	(195,525,600)	(105,555,873)	5,147,009,336	588,128,521	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	2,351,646,000	Compra	Índice	Índice	174,727,245	244,990,958	-	2,351,646,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	0	Venta	Índice	Índice	(3,835,874)	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	25,996,897,335	Compra	Tasas	Tasas	143,848,858	167,713,877	82,700,000	20,764,110,206	5,150,087,129	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	25,884,076,029	Venta	Tasas	Tasas	(141,570,893)	(164,385,288)	82,700,000	20,712,333,715	5,089,042,315	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	483,382,000	Compra	Acción NE	Acción NE	48,893,576.57	53,449,469.08	-	483,382,000.00	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	253,691,000	Venta	Acción NE	Acción NE	- 57,058,353.70	- 63,695,477.60	-	253,691,000.00	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	0	Compra	Índice NE	Índice NE	3,835,073	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	2,351,646,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(174,188,938)	(244,990,958)	-	2,351,646,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	76,330,125	Compra	Divisas NE	Divisas NE	4,185,916	1,590,363	-	76,330,124.84	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	76,330,125	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(5,967,506)	(2,896,778)	-	76,330,124.84	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933.3	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933	Venta	Tasas NE	Tasas NE	(1)	-	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	8,112,816,517	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	10,139,588	(80,792,695)	-	5,125,131,767	2,987,684,749	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	(2,836,212)	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES FIJA MXN	LIBOR USD / TASA DE INTERES FIJA MXN	(7,497,505)	(5,235,286)	-	(2,836,212)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	45,045,185,554	CCIRS / IRS	/TASA DE INTERES TIIE MXN	/TASA DE INTERES TIIE MXN	(1,045,222,585)	(248,907,185)	300,000,000	28,007,961,229	16,737,224,324	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	(4,466,948)	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	(5,317,116)	(5,642,330)	-	(4,466,948)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	8,657,710	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	19,229,473	56,090,150	-	24,964,989	(16,307,279)	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	21,438,245,555	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(1,204,829,233)	(985,620,809)	-	5,977,590,525	15,460,655,029	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	282,114,997,447	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	(3,211,333,611)	940,076,292	54,180,513,117	91,820,818,928	136,113,665,403	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	26,845,911,122	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	1,214,808,467	1,070,908,623	146,511,323	7,766,677,120	18,932,722,680	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	285,472,295,451	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	2,774,539,230	(1,509,999,005)	57,571,001,794	80,318,189,146	147,583,104,512	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			A C T I V O	684,320,177,880	655,907,475,432
110000000000			DISPONIBILIDADES	55,359,849,914	46,230,872,140
115000000000			CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	1,212,679,600	2,784,920,506
120000000000			INVERSIONES EN VALORES	142,500,190,908	103,159,084,881
	120100000000		Títulos para negociar	68,527,182,533	47,556,840,861
	120200000000		Títulos disponibles para la venta	68,879,946,923	50,591,363,699
	120300000000		Títulos conservados a vencimiento	5,093,061,452	5,010,880,321
120800000000			DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)	29,452,167,570	16,501,215,697
120700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
121400000000			DERIVADOS	19,719,633,818	26,135,382,178
	121406000000		Con fines de negociación	14,939,798,504	22,170,733,169
	121407000000		Con fines de cobertura	4,779,835,314	3,964,649,009
121700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	76,287,125	925,278,941
128000000000			TOTAL DE CARTERA DE CRÉDITO NETO	394,585,630,124	429,081,261,824
129000000000			CARTERA DE CRÉDITO NETA	394,585,630,124	429,081,261,824
129500000000			Cartera de crédito	411,326,296,924	443,360,641,105
130000000000			CARTERA DE CRÉDITO VIGENTE	395,793,070,210	431,936,373,407
	130100000000		Créditos comerciales	211,179,717,122	249,818,571,826
		130107010000	Actividad empresarial o comercial	176,490,328,498	201,820,507,854
		130107020000	Entidades financieras	23,202,855,796	35,151,736,166
		130107030000	Entidades gubernamentales	11,486,532,828	12,846,327,806
	131100000000		Créditos de consumo	35,531,624,233	41,881,264,442
	132100000000		Créditos a la vivienda	149,081,728,855	140,236,537,139
		132107010000	Media y residencial	144,102,687,082	134,867,100,558
		132107020000	De interés social	5,613,560	37,526,936
		132107030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,973,428,213	5,331,909,645
		132107040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
	133100000000		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
135000000000			CARTERA DE CRÉDITO VENCIDA	15,533,226,714	11,424,267,698
	135051000000		Créditos comerciales	6,041,188,678	5,091,393,826
		135051010000	Actividad empresarial o comercial	5,912,216,944	5,009,878,563
		135051020000	Entidades financieras	128,971,734	81,515,263
		135051030000	Entidades gubernamentales	0	0
	135061000000		Créditos de consumo	2,155,393,870	1,817,116,535
	135071000000		Créditos a la vivienda	7,336,644,166	4,515,757,337
		135071010000	Media y residencial	7,190,579,997	4,476,107,705
		135071020000	De interés social	15,266,097	16,932,417
		135071030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	130,798,072	22,717,215
		135071040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
139000000000			ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-16,740,666,800	-14,279,379,281
139700000000			Derechos de cobro (neto)	0	0
	139798000000		DERECHOS DE COBRO ADQUIRIDOS	0	0
	139799000000		ESTIMACIÓN POR IRRECUPERABILIDAD O DIFÍCIL COBRO	0	0
179700000000			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
140000000000			Otras cuentas por cobrar	25,720,761,914	16,031,466,634
150000000000			Bienes adjudicados	108,785,159	128,819,173
160000000000			Propiedades, mobiliario y equipo	3,399,088,762	3,252,202,391
170000000000			INVERSIONES PERMANENTES	51,688,909	51,099,021
179500000000			ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA	21,650,131	21,650,131
180000000000			Impuestos y ptu diferidos (a favor)	6,151,460,836	5,673,285,888
190000000000			OTROS ACTIVOS	5,960,303,110	5,930,936,027
	190300000000		Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	5,960,303,110	5,930,916,322
	191600000000		Otros activos a corto y largo plazo	0	19,705
200000000000			P A S I V O	624,665,103,437	601,708,441,089
210000000000			CAPTACIÓN TRADICIONAL	437,347,775,474	417,452,755,348
	210100000000		Depósitos de exigibilidad inmediata	223,676,511,243	189,425,161,117
	211100000000		Depósitos a plazo	179,725,722,872	187,730,275,231
		211101000000	Del público en general	174,924,339,827	145,815,071,234
		211102000000	Mercado de dinero	4,801,383,045	41,915,203,997
		211103000000	Fondos especiales	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
	212500000000		Títulos de crédito emitidos	33,336,134,065	39,699,347,128
	216100000000		Cuenta global de captación sin movimientos	609,407,294	597,971,872
230000000000			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	56,309,988,426	71,053,126,798
	230100000000		De exigibilidad inmediata	0	0
	230200000000		De corto plazo	23,297,083,613	29,785,562,727
	230300000000		De largo plazo	33,012,904,813	41,267,564,071
203000000000			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	20,148,845,444	6,318,328,969
220800000000			ACREEDORES POR REPORTE	49,098,763,778	39,498,726,782
220700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	5,250	7,208
220900000000			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	322,874,236	393,773,797
	220901000000		Reportos	0	0
	220902000000		Préstamo de valores	322,874,236	393,773,797
	220903000000		Derivados	0	0
	220990000000		Otros colaterales vendidos	0	0
221400000000			DERIVADOS	20,198,391,849	29,139,316,124
	221406000000		Con fines de negociación	15,077,684,599	22,154,173,784
	221407000000		Con fines de cobertura	5,120,707,250	6,985,142,340
221700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	10,329,741	15,588,256
221900000000			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
225000000000			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
240000000000			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	30,651,328,750	27,070,535,744
	240200000000		Impuestos a la utilidad por pagar	236,439,563	1,155,091,420
	240800000000		Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar	5,800,000	0
	240300000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	240900000000		Acreedores por liquidación de operaciones	19,549,543,178	13,787,524,809
	241000000000		Acreedores por cuentas de margen	0	0
	241300000000		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	595,730,111	1,706,953,646
	240100000000		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	10,263,815,898	10,420,965,869
270000000000			OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,048,921,017	9,046,256,381
280000000000			Impuestos y ptu diferidos (a cargo)	0	0
290000000000			CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	1,527,879,472	1,720,025,682
400000000000			CAPITAL CONTABLE	59,655,074,443	54,199,034,343
450000000000			Participación controladora	59,654,008,994	54,198,824,721
410000000000			CAPITAL CONTRIBUIDO	10,876,764,482	10,876,764,482
	410100000000		Capital social	10,404,165,369	10,404,165,369
	410700000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
	410400000000		Prima en venta de acciones	472,599,113	472,599,113
	411100000000		Obligaciones subordinadas en circulación	0	0
420000000000			CAPITAL GANADO	48,777,244,512	43,322,060,239
	420100000000		Reservas de capital	7,059,716,497	6,757,848,750
	420300000000		Resultado de ejercicios anteriores	39,148,984,764	36,423,406,940
	420500000000		Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-80,584,749	577,044,703
	421500000000		Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	5,034,966	-1,218,855,061
	421700000000		Efecto acumulado por conversión	0	0
	422300000000		Remediones por beneficios definidos a los empleados	-992,152,017	-795,332,995
	420900000000		Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	421100000000		Resultado neto	3,636,245,051	1,577,947,902
430000000000			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	1,065,449	209,622
	431000000000		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	850,812	6,056
	439000000000		Otra participación no controladora	214,637	203,566
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	2,726,790,601,496	2,874,821,535,423
710000000000			Avales otorgados	0	0
790000000000			Activos y pasivos contingentes	0	0
730000000000			Compromisos crediticios	277,164,306,180	258,404,714,645
740000000000			Bienes en fideicomiso o mandato	405,026,093,218	379,332,240,813
	740100000000		Fideicomisos	375,940,957,686	349,868,134,822
	740200000000		Mandatos	29,085,135,532	29,464,105,991
770300000000			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
750000000000			Bienes en custodia o en administración	617,571,935,887	674,332,646,720
773100000000			Colaterales recibidos por la entidad	38,534,978,773	44,653,601,906

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
773200000000			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	322,874,236	5,612,378,899
760000000000			Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros	135,673,838,432	108,621,276,909
771000000000			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	865,878,942	538,448,294
780000000000			Otras cuentas de registro	1,251,630,695,828	1,403,326,227,237

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2021**

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

ESTADO DE RESULTADOS DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
510000000000	Ingresos por intereses	21,938,388,702	25,303,292,702
610000000000	Gastos por intereses	9,555,329,677	12,925,899,123
520000000000	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
670100000000	MARGEN FINANCIERO	12,383,059,025	12,377,393,579
620000000000	Estimación preventiva para riesgos crediticios	2,261,283,626	5,060,235,757
670200000000	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	10,121,775,399	7,317,157,822
530000000000	Comisiones y tarifas cobradas	2,747,425,595	2,390,346,429
630000000000	Comisiones y tarifas pagadas	467,331,325	474,759,925
540000000000	Resultado por intermediación	580,747,713	1,180,078,795
505000000000	Otros ingresos (egresos) de la operación	1,040,731,747	883,364,689
590000000000	Subsidios	0	0
640000000000	Gastos de administración y promoción	9,463,686,068	9,080,541,786
670400000000	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	4,559,663,061	2,215,646,024
570000000000	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	603,484	671,482
672500000000	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	4,560,266,545	2,216,317,506
660000000000	Impuestos a la utilidad causados	703,163,691	1,399,502,875
560000000000	Impuestos a la utilidad diferidos	-220,006,991	761,139,327
670700000000	RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS	3,637,095,863	1,577,953,958
580000000000	Operaciones discontinuadas	0	0
671100000000	RESULTADO NETO	3,636,245,051	1,577,947,902
670900000000	Participación controladora	3,636,245,051	1,577,947,902
671300000000	Participación no controladora	850,812	6,056

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820103500000		Resultado neto	3,637,095,863	1,577,953,958
820103600000		Ajustes por partidas que no implican flujo de efectivo:	5,205,082,463	6,155,845,380
	820103600100	Pérdidas por deterioro o efecto por reversión del deterioro asociados a actividades de inversión	-26,930,520	57,743,101
	820103600200	Depreciaciones de propiedades, mobiliario y equipo	228,611,115	245,787,344
	820103600300	Amortizaciones de activo intangibles	251,905,796	198,688,942
	820103600400	Provisiones	2,541,178,698	5,318,032,463
	820103600500	Impuestos a la utilidad causados y diferidos	923,170,682	638,363,548
	820103600600	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	-603,484	-671,482
	820103600700	Operaciones discontinuadas	0	0
	820103609000	Otros	1,287,750,176	-302,098,536
		Actividades de operación		
	820103010000	Cambio en cuentas de margen	1,517,352,447	-1,768,241,564
	820103020000	Cambio en inversiones en valores	300,010,435	-11,295,232,684
	820103030000	Cambio en deudores por reporto	-1,593,316,236	-13,926,776,349
	820103040000	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	820103050000	Cambio en derivados (activo)	5,137,516,976	-12,874,298,784
	820103060000	Cambio de cartera de crédito (neto)	1,295,915,151	-32,016,391,607
	820103070000	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	820103080000	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	820103090000	Cambio en bienes adjudicados (neto)	86,831,803	-14,258,620
	820103100000	Cambio en otros activos operativos (neto)	-11,321,933,243	3,231,938,050
	820103110000	Cambio en captación tradicional	31,223,008,639	52,581,671,003
	820103120000	Cambio en préstamos interbancarios y de otros organismos	-10,301,991,060	15,410,963,080
	820103130000	Cambio en acreedores por reporto	6,207,435,866	-9,636,237,500
	820103140000	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-10,673	7,208
	820103150000	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-199,909,394	393,773,797
	820103160000	Cambio en derivados (pasivo)	-7,002,569,393	14,459,034,394
	820103170000	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	0	0
	820103180000	Cambio en obligaciones subordinadas con características de pasivo	-2,664,630	430,226
	820103190000	Cambio en otros pasivos operativos	3,780,125,034	-2,773,598,203
	820103200000	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	820103230000	Cobros de impuestos a la utilidad (devoluciones)	0	0
	820103240000	Pagos de impuestos a la utilidad	-2,023,948,837	-1,053,565,168
	820103900000	Otros	0	0
820103000000		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	17,101,852,885	719,217,279
		Actividades de inversión		
	820104010000	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	4,810,157	0
	820104020000	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-252,172,617	-89,399,975
	820104030000	Cobros por disposición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	0	0
	820104040000	Pagos por adquisición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	-1,000	0
	820104050000	Cobros por disposición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104060000	Pagos por adquisición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104070000	Cobros de dividendos en efectivo	666,698	1,044,492
	820104080000	Pagos por adquisición de activos intangibles	-292,047,140	-77,275,318
	820104090000	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	820104100000	Cobros por disposición de otros activos de larga duración	0	0
	820104110000	Pagos por adquisición de otros activos de larga duración	0	0
	820104120000	Cobros asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104130000	Pagos asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104900000	Otros	0	0
820104000000		Flujos netos de efectivo de actividades de inversión	-538,743,902	-165,630,801
		Actividades de financiamiento		
	820105010000	Cobros por emisión de acciones	0	0
	820105020000	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	820105030000	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	820105040000	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	820105050000	Cobros por la emisión de obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105060000	Pagos asociados a obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105900000	Otros	0	0
820105000000		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

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

AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820100000000		Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	25,405,287,309	8,287,385,816
820400000000		Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo	0	0
820200000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo	29,954,562,605	37,943,486,324
820000000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	55,359,849,914	46,230,872,140

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

**ESTADO DE VARIACIONES EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE
 CRÉDITO**
 AL 30 DE JUNIO DE 2021 Y 2020
 (PESOS)

CONSOLIDADO
 Impresión Final

Concepto	Participación controladora	Capital contribuido				Capital Ganado								Participación no controladora	Capital contable
		Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Obligaciones subordinadas en circulación	Reservas de capital	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	Efecto Acumulado por conversión	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Resultado neto		
Saldo al inicio del periodo	55,321,125,241	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,757,848,750	36,432,175,039	416,755,619	-1,161,122,172	0	-1,019,973,949	0	3,018,677,472	214,637	55,321,339,878
MOVIMIENTOS INHERENTES A LAS DECISIONES DE LOS PROPIETARIOS															
Suscripción de acciones	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Capitalización de utilidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Constitución de reservas	0	0	0	0	0	301,867,747	0	0	0	0	0	0	-301,867,747	0	0
Traspaso del resultado neto a resultado de ejercicios anteriores	0	0	0	0	0	0	2,716,809,725	0	0	0	0	0	-2,716,809,725	0	0
Pago de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total por movimientos inherentes a las decisiones de los propietarios	0	0	0	0	0	301,867,747	2,716,809,725	0	0	0	0	0	-3,018,677,472	0	0
MOVIMIENTOS INHERENTES AL RECONOCIMIENTO DE LA UTILIDAD INTEGRAL															
-Resultado neto	3,636,245,051	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	3,636,245,051	850,812	3,637,095,863
-Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-497,340,368	0	0	0	0	0	0	-497,340,368	0	0	0	0	0	0	-497,340,368
-Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo.	1,166,157,138	0	0	0	0	0	0	0	1,166,157,138	0	0	0	0	0	1,166,157,138
-Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	27,821,932	0	0	0	0	0	0	0	0	0	27,821,932	0	0	0	27,821,932
-Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total de movimientos inherentes al reconocimiento de la utilidad integral	4,332,883,753	0	0	0	0	0	0	-497,340,368	1,166,157,138	0	27,821,932	0	3,636,245,051	850,812	4,333,734,565
Saldo al final del periodo	59,654,008,994	10,404,165,369	0	472,599,113	0	7,059,716,497	39,148,984,764	-80,584,749	5,034,966	0	-992,152,017	0	3,636,245,051	1,065,449	59,655,074,443

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

(1) Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 15 de Julio de 2021, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

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

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

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

Bases de presentación

a) Declaración de cumplimiento

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

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

b) Uso de juicios y estimaciones

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Juicios

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

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

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

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

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

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

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

c) Moneda funcional y de informe

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

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

d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

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

(2) Resumen de las principales políticas contables-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 3 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

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

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

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

(b) Bases de consolidación-

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

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

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

(c) Disponibilidades-

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(d)Cuentas de margen-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

(e) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

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

Títulos disponibles para la venta-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 6 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

Títulos conservados al vencimiento-

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

Deterioro del valor de un título-

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Operaciones fecha valor-

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

Reclasificación entre categorías-

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

(f) Préstamo de valores-

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 8 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

(g) Operaciones de reporto-

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

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

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

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

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

(h) Derivados-

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 9/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

Derivados implícitos y estructurados

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

(i) Compensación de cuentas liquidadoras-

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

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

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

(j) Cartera de crédito-

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

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

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

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

Cartera INFONAVIT-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Créditos e intereses vencidos-

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

Pago sostenido

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 13 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

Reestructuras y renovaciones

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

d) Prórroga del plazo del crédito.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Comisiones

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

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

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

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

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

Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 16/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Adquisición de cartera de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(k) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 18 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 19/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

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

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

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

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

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

Cartera de consumo-

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

(l) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

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

(m) Otras cuentas por cobrar-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Porcentaje de reserva
Bienes muebles,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

(o) Inmuebles, mobiliario y equipo-

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 23 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores, se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(q) Inversiones permanentes-

Las inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

(r) Otros activos-

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(s) Impuestos a la utilidad-

Los impuestos a la utilidad causados en el año se determinan conforme a las disposiciones fiscales vigentes.

El impuesto causado se presenta dentro del balance general consolidado como un pasivo; cuando los anticipos realizados exceden el impuesto determinado del ejercicio, el exceso generado constituye una cuenta por cobrar.

Los impuestos a la utilidad diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 24 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

pérdidas fiscales por amortizar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por impuesto a la utilidad diferido se evalúa periódicamente creando, en su caso, reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

(t) Arrendamientos capitalizables-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(u) Captación tradicional-

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general, los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses". Por aquellos títulos colocados a un precio diferente al valor nominal, la diferencia entre el valor nominal del título y el monto de efectivo recibido por el mismo, se reconoce como un cargo o crédito diferido y se amortiza bajo el método de línea recta contra resultados durante el plazo del título que le dio origen.

Los depósitos e inversiones y sus intereses de los instrumentos de captación que no tengan una fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven de forma automática, así como las transacciones o las inversiones vencidas y no reclamadas se registraran en el rubro de "Cuenta global de captación sin movimientos". Los depósitos e inversiones y sus intereses sin movimiento en el transcurso de 3 años contados a partir de que estos últimos se depositen en la cuenta global, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública. El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto en este.

(v) Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

(w) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(x) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Plan de contribución definida

El Banco tiene reconocido un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

Plan de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos, se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 26 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el periodo, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del periodo.

Las remediciones generadas resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del periodo, se reconocen en el periodo en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable y posteriormente se recicla a los resultados del periodo, tomando como base la vida laboral remanente promedio del personal jubilado.

(y) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(z) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

(aa) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 27 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio para solventar obligaciones denominadas en moneda extranjera pagaderas en la República Mexicana, determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio FIX publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ad) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

(4) Cambios contables-

NIF aplicables en 2021:

NIF B-11 "Disposición de activos de larga duración y operaciones discontinuadas"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2020, no

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 28 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

permitiendo su aplicación anticipada, dado que es necesario aplicarla junto con la NIF C-15 que se reemitirá durante 2019 y también será aplicable a partir del 2020. La aplicación por primera vez de esta NIF no genera cambios contables en los estados financieros.

Venta de créditos de cartera hipotecaria

El 31 de enero de 2020, el Banco vendió un portafolio de préstamos hipotecarios totalmente castigados a una compañía no relacionada con valor nominal de \$181, el ingreso recibido y utilidad en libros de dicho portafolio fue de \$38. El resultado por esta operación fue registrado como recuperaciones en el estado de resultados dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios".

Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

El 4 de diciembre de 2020 la Comisión Bancaria emitió resolución sobre la entrada en vigor de la Resolución publicada en el DOF el 13 de marzo de 2020, referente a las NIF emitidas por el CINIF, referidas en el párrafo 3 del Criterio A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33, entrarán en vigor el 1 de enero de 2022.

El CINIF emitió las siguientes NIF's que se mencionan a continuación:

NIF B-17 "Determinación del valor razonable"- Establece las normas de valuación y revelación en la determinación del valor razonable, en su reconocimiento inicial y posterior, si el valor razonable es requerido o permitido por otras NIF particulares.

NIF C-2 "Inversión en instrumentos financieros"- Permite la opción de reconocer inversiones en ciertos instrumentos negociables de capital que no se negocian en el corto plazo, para ser valuadas a través del ORI. Esta mejora entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021, permitiéndose su aplicación anticipada para el ejercicio 2020. Los cambios contables que surjan deben reconocerse de conformidad con lo que establece la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-3 "Cuentas por cobrar"- Entre los principales cambios que presenta se encuentran los siguientes:

- Especifica que las cuentas por cobrar que se basan en un contrato representan un instrumento financiero, en tanto que algunas de las otras cuentas por cobrar, generadas por una disposición legal o fiscal, pueden tener ciertas características de un instrumento financiero, tal como generar intereses, pero no son en sí instrumentos financieros.
- Establece que la estimación para incobrabilidad por cuentas por cobrar debe reconocerse desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas presentando la estimación en un rubro de gastos, por separado cuando sea significativa en el estado de resultado integral.
- Establece que, desde el reconocimiento inicial, debe considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, debe ajustarse considerando dicho valor presente.
- Requiere una conciliación entre el saldo inicial y el final de la estimación para incobrabilidad por cada período presentado.

NIF C-9 "Provisiones, Contingencias y Compromisos"- Entre los principales aspectos que cubre esta NIF se encuentran los siguientes:

- Se disminuye su alcance al reubicar el tema relativo al tratamiento contable de
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 29 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

pasivos financieros en la NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar".

•Se modifica la definición de "pasivo" eliminando el calificativo de "virtualmente ineludible" e incluyendo el término "probable".

NIF C-15 "Deterioro en el valor de activos de larga duración"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien el 1 de enero de 2022 y permite su adopción anticipada. Deja sin efecto al Boletín C-15, "Deterioro" en el valor de los activos de larga duración y su disposición. Los cambios contables por su aplicación inicial deben reconocerse con base en el método prospectivo. Los principales cambios que presenta son:

Adiciona nuevos ejemplos de indicios para evaluar si existe deterioro, y los separa en fuentes externas de información, fuentes internas de información y aplicables a las inversiones en subsidiarias, asociadas o negocios conjuntos.

Cambia el requerimiento de uso de un precio neto de venta por el de valor razonable, menos los costos de disposición para llevar a cabo las pruebas de deterioro;

Establece la opción del uso de estimaciones de los flujos de efectivo futuros y de una tasa de descuento, en términos reales;

Incorpora normas para el tratamiento de flujos de efectivo futuros en moneda extranjera en la determinación del monto recuperable;

Modifica la NIF C-8, Activos intangibles, para indicar que la asignación del crédito mercantil debe hacerse a nivel de una unidad generadora de efectivo (UGE) que se espere será beneficiada por la sinergia de la adquisición de negocios;

Incorpora el reconocimiento del deterioro del crédito mercantil en dos pasos: i. primero, comparando el valor en libros de la UGE incluido el crédito mercantil con su monto recuperable, y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro; y ii. segundo, afectando esta pérdida en primera instancia al crédito mercantil, incluso hasta dejarlo en cero, para después, si existiera un exceso de pérdida por asignar, distribuirlo a prorrata entre los demás activos de larga duración que formen parte de la UGE;

Elimina el cálculo del deterioro a través del valor a perpetuidad en los activos intangibles de vida útil indefinida, modificando la prueba de deterioro.

Establece la determinación del deterioro de los activos corporativos como sigue: i. primero, se asignan a la UGE a la que pertenece de manera razonable y consistente, ii. segundo, se compara el valor en libros de la UGE, incluidos los activos corporativos, con su monto recuperable y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro, la cual se distribuye a prorrata entre todos los activos de larga duración que formen parte de la UGE, incluidos los activos corporativos,

Modifica las revelaciones en consecuente a los cambios antes descritos.

•
NIF C-16 "Deterioro de los instrumentos financieros por cobrar"- Establece las normas para el reconocimiento contable de las pérdidas por deterioro de todos los instrumentos financieros por cobrar (IFC); señala cuándo y cómo debe reconocerse una pérdida esperada por deterioro y establece la metodología para su determinación.

Los principales cambios que incluye esta NIF consisten en determinar cuándo y cómo deben reconocerse las pérdidas esperadas por deterioro de IFC, entre ellos:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 30 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- Establece que las pérdidas por deterioro de un IFC deben reconocerse cuando al haberse incrementado el riesgo de crédito se concluye que una parte de los flujos de efectivo futuros del IFC no se recuperará.
 - Propone que se reconozca la pérdida esperada con base en la experiencia histórica que tenga la entidad de pérdidas crediticias, las condiciones actuales y los pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el importe de los flujos de efectivo futuros de los IFC.
 - En el caso de los IFC que devengan intereses, establece determinar cuánto y cuándo se estima recuperar del monto del IFC, pues el monto recuperable debe estar a su valor presente.

NIF C-17 "Propiedades de inversión"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021 permitiendo su aplicación anticipada. Elimina la supletoriedad de la Norma Internacional de Contabilidad (NIC) 40 "Propiedades de inversión". Asimismo, deroga la Circular 55, "Aplicación supletoria de la NIC 40". Los efectos de su adopción deben reconocerse de forma retrospectiva. Los principales cambios son: 1) se ajusta la definición de propiedades de inversión para establecer que estos activos se tienen por un inversionista bajo un modelo de negocios cuyo objetivo principal es ganar por la apreciación de su valor (apreciación del capital) en el mediano plazo mediante su venta; 2) permite valuar las propiedades de inversión a su costo de adquisición o a su valor razonable.

NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar"- Entre las principales características que tiene se encuentran las siguientes:

- Se establece la posibilidad de valuar, subsecuentemente a su reconocimiento inicial, ciertos pasivos financieros a su valor razonable, cuando se cumplen ciertas condiciones.
- Valuar los pasivos a largo plazo a su valor presente en su reconocimiento inicial.
- Al reestructurar un pasivo, sin que se modifiquen sustancialmente los flujos de efectivo futuros para liquidar el mismo, los costos y comisiones erogados en este proceso afectarán el monto del pasivo y se amortizarán sobre una tasa de interés efectiva modificada, en lugar de afectar directamente la utilidad o pérdida neta.
- Incorpora lo establecido en la IFRIC 19 "Extinción de Pasivos Financieros con Instrumentos de Capital", tema que no estaba incluido en la normativa existente.
- El efecto de extinguir un pasivo financiero debe presentarse como un resultado financiero en el estado de resultado integral.
- Introduce los conceptos de costo amortizado para valuar los pasivos financieros y el de método de interés efectivo, basado en la tasa de interés efectiva.

NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés"- Entre los principales aspectos que cubre se encuentran los siguientes:

- La clasificación de los instrumentos financieros en el activo. Se descarta el concepto de intención de adquisición y tenencia de éstos para determinar su clasificación. En su lugar, se adopta el concepto de modelo de negocios de la administración, ya sea para obtener un rendimiento contractual, generar un rendimiento contractual y vender para cumplir ciertos objetivos estratégicos o para generar ganancias por su compra y venta, para clasificarlos de acuerdo con el modelo correspondiente.
 - El efecto de valuación de las inversiones en instrumentos financieros se enfoca también al modelo de negocios.
 - No se permite la reclasificación de los instrumentos financieros entre las clases de instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), la de instrumentos financieros para cobrar y vender (IFCV) y la de instrumentos financieros negociables, a menos de que cambie el modelo de negocios de la entidad.
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 31 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

•No se separa el instrumento derivado implícito que modifique los flujos de principal e interés del instrumento financiero por cobrar anfitrión, sino que todo el IFCPI se valorará a su valor razonable, como si fuera un instrumento financiero negociable.

NIF D-1 "Ingresos por contratos con clientes"- Entre los principales cambios se encuentran los siguientes:

- Establece la transferencia del control como base para la oportunidad del reconocimiento de los ingresos.
- Requiere la identificación de las obligaciones a cumplir en un contrato.
- Indica que la asignación del monto de la transacción entre las obligaciones a cumplir, debe realizarse con base en los precios de venta independientes.
- Introduce el concepto de "cuenta por cobrar condicionada".
- Requiere el reconocimiento de derechos de cobro.
- Establece requerimientos y orientación sobre cómo valorar la contraprestación variable y otros aspectos, al realizar la valuación del ingreso.

NIF D-2 "Costos por contratos con clientes"- Establece las normas para el reconocimiento contable de los costos de ventas de bienes o de prestación de servicios

Su principal cambio es la separación de la normativa relativa al reconocimiento de ingresos por contratos con clientes, de la correspondiente al reconocimiento de los costos por contratos con clientes. Adicionalmente, amplía el alcance que tenía el Boletín D-7, referenciado exclusivamente a costos relacionados con contratos de construcción y de fabricación de ciertos bienes de capital, para incluir costos relacionados con todo tipo de contratos con clientes.

NIF D-5 "Arrendamientos"- Los cambios más relevantes son los siguientes:

La norma contable introduce un único modelo de reconocimiento de los arrendamientos por el arrendatario y requiere que éste reconozca los activos y pasivos de todos los arrendamientos con una duración superior a 12 meses, a menos que el activo subyacente sea de bajo valor. Se requiere que reconozca un activo por derecho de uso que representa su derecho a usar el activo subyacente arrendado y un pasivo por arrendamiento que representa su obligación para hacer pagos por arrendamiento.

Se considera que los siguientes aspectos del nuevo modelo son los cambios más significativos e importantes para los arrendatarios:

- modificación de la definición de arrendamiento;
- eliminación de clasificación de arrendamientos operativos o financieros para un arrendatario, y éste reconoce un pasivo por arrendamiento al valor presente de los pagos por arrendamiento un activo por derecho de uso por ese mismo monto;
- aumento en los activos en arrendamiento y en los pasivos financieros de un arrendatario, lo que implica cambios en los indicadores financieros relacionados con los activos y pasivos de la entidad;
- cambia para los arrendatarios la naturaleza de los gastos relacionados con dichos arrendamientos: gasto por arrendamiento ahora dividido en un gasto por depreciación/amortización y gasto por interés;
- modificación en la presentación de los flujos de efectivo relacionados con arrendamientos operativos;
- modifica el reconocimiento de la ganancia o pérdida en arrendamientos de activos en vía de regreso.

Cabe mencionar que estos cambios entrarán en vigor el 1 de enero de 2022. El Grupo está en proceso de evaluación del impacto de las mismas.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Compra de cartera comercial

Durante el mes enero de 2021, el Banco celebró contratos de adquisición de cartera comercial a descuento con una institución financiera no relacionada, a la fecha de la compra la cartera estaba clasificada como cartera vigente, el valor en libros a la fecha de la compra era de \$874. El monto pagado por la transacción fue de \$865, generando una utilidad de \$9. La utilidad generada se registró en el estado consolidado de resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto" por \$5 y "Créditos diferidos y cobros anticipados" por \$4 que se amortizara conforme se realicen los cobros de dicha cartera adquirida.

Préstamo Bancario

Con fecha 19 de enero de 2021, el Banco firmó un contrato de apertura de crédito simple garantizado con activos elegibles fideicomitidos en fideicomiso de garantía con Banco de México por \$1,100, a una tasa promedio de la tasa interbancaria y a un plazo de 720 días.

"ver archivo completo en pdf"
