

**ANEXO**

**Scotiabank Inverlat**

# Información Financiera

## SCOTIABANK INVERLAT

### Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros	T3 2022	T4 2022	T1 2023	T2 2023
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	15.1%	10.1%	15.9%	13.2%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.6%	1.0%	1.6%	1.3%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.5%	2.8%	3.7%	3.4%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.3%	2.4%	2.3%	2.2%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.8%	3.7%	3.8%	4.0%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	85.8%	90.6%	87.8%	82.2%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	20.99%	19.78%	21.01	21.94 <sup>1)</sup>
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.41%	15.50%	16.12	16.59 <sup>1)</sup>
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	40.6%	45.5%	44.0%	56.6%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

Los resultados alcanzados dan una utilidad neta al cierre del segundo trimestre de \$2,520 millones, una disminución anual de \$342 millones; El resultado se debe a un mejor desempeño en los ingresos, los cuales fueron más que compensados por mayores impuestos a la utilidad debido a una menor inflación en el periodo; así como, mayores gastos de administración y promoción. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta disminuyó \$475 millones, principalmente por menores comisiones, un menor margen financiero y mayores requerimientos de reservas crediticias.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio 2023 se ubicó en \$5,515 millones; una disminución anual de \$796 millones o 13%; debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022 y mayores impuestos a la utilidad; compensados parcialmente por mayores ingresos.

	3 meses				6 meses		
<b>Scotiabank- Información Financiera</b> <b>(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
Ingresos por intereses	13,144	18,392	19,618	49%	25,174	38,010	51%
Gastos por intereses	(6,984)	(11,733)	(13,118)	88%	(13,029)	(24,851)	91%
<b>Margen Financiero</b>	<b>6,160</b>	<b>6,659</b>	<b>6,500</b>	<b>6%</b>	<b>12,145</b>	<b>13,159</b>	<b>8%</b>
Comisiones	1,023	1,199	1,024	0%	2,025	2,223	10%
Resultado por Intermediación	464	563	560	21%	843	1,123	33%
Otros ingresos/egresos de la operación	178	282	208	17%	313	490	57%
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,665</b>	<b>2,044</b>	<b>1,792</b>	<b>8%</b>	<b>3,181</b>	<b>3,836</b>	<b>21%</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>7,825</b>	<b>8,703</b>	<b>8,292</b>	<b>6%</b>	<b>15,326</b>	<b>16,995</b>	<b>11%</b>
Gastos de Administración y Promoción	(3,870)	(4,434)	(4,280)	11%	(8,344)	(8,714)	4%
<b>PTPP<sup>1)</sup></b>	<b>3,955</b>	<b>4,269</b>	<b>4,012</b>	<b>1%</b>	<b>6,982</b>	<b>8,281</b>	<b>19%</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(391)	(145)	(287)	-27%	1,039	(432)	> -100%
<b>Resultado de la Operación</b>	<b>3,564</b>	<b>4,124</b>	<b>3,725</b>	<b>5%</b>	<b>8,021</b>	<b>7,849</b>	<b>-2%</b>
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	58	79	89	53%	58	168	> +100%
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>3,622</b>	<b>4,203</b>	<b>3,814</b>	<b>5%</b>	<b>8,079</b>	<b>8,017</b>	<b>-1%</b>
Impuestos a la Utilidad	(760)	(1,208)	(1,294)	70%	(1,768)	(2,502)	42%
<b>Resultado Neto</b>	<b>2,862</b>	<b>2,995</b>	<b>2,520</b>	<b>-12%</b>	<b>6,311</b>	<b>5,515</b>	<b>-13%</b>
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(108)	52	30	> -100%	(157)	82	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	201	(42)	(165)	> -100%	558	(207)	> -100%
Remediación de beneficios definidos a los empleados	14	1	4	-71%	10	5	-50%
<b>Resultado Integral</b>	<b>2,969</b>	<b>3,006</b>	<b>2,389</b>	<b>-20%</b>	<b>6,722</b>	<b>5,395</b>	<b>-20%</b>

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

## Margen Financiero

El margen financiero fue de \$6,500 millones al cierre del segundo trimestre de 2023, un incremento de \$340 millones o 6% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente a mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como en inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos por el incremento en la tasa de referencia.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró una disminución de \$159 millones o 2%; debido principalmente a un cambio en la mezcla de cartera y captación. En cartera se observa un incremento en la cartera comercial e hipotecaria. En captación, la participación de depósitos de exigibilidad inmediata aumentó en relación con depósitos a plazo.

El margen financiero acumulado al cierre de junio 2023 ascendió a \$13,159 millones, un incremento anual de \$1,014 millones u 8%, respecto al mismo periodo de 2022, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera comercial e inversiones en instrumentos financieros; contrarrestando los mayores intereses pagados en depósitos.

## Ingresos no Financieros

El total de ingresos no financieros fue de \$1,792 millones en el segundo trimestre de 2023, un incremento de \$127 millones u 8% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente a mayores ingresos por intermediación. Los ingresos por intermediación se vieron impactados por mayores ingresos provenientes de inversiones en derivados e instrumentos financieros en el trimestre.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$252 millones o 12%, debido principalmente a menores ingresos por colocación de créditos, así como a la cancelación de estimaciones de pérdidas crediticias esperadas en T1-23.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de junio 2023 ascendió a \$3,836 millones, un crecimiento anual de \$655 millones o 21%, debido principalmente a utilidad por intermediación de inversiones en instrumentos financieros, así como mayores ingresos provenientes de comisiones de menudeo.

	3 meses				6 meses		
	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	-	1	1	0%	-	2	0%
Actividades Fiduciarias	53	60	53	0%	118	113	-4%
Apertura de Cuenta	4	6	5	25%	8	11	38%
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	50	75	61	22%	107	136	27%
Cheques Certificados	-	1	-	0%	1	1	0%
Cheques de caja	1	-	1	0%	1	1	0%
Compraventa de instrumentos financieros	1	-	3	> +100%	1	3	> +100%
Manejo de Cuenta	89	83	82	-8%	172	165	-4%
Operaciones de Crédito	391	400	378	-3%	782	778	-1%
Otras Comisiones y Tarifas	361	495	369	2%	691	864	25%
Servicios de Banca Electrónica	45	51	45	0%	89	96	8%
Transferencia de Fondos	28	27	26	-7%	55	53	-4%
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,023</b>	<b>1,199</b>	<b>1,024</b>	<b>0%</b>	<b>2,025</b>	<b>2,223</b>	<b>10%</b>

	3 meses				6 meses		
<b>Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(17)	35	(23)	35%	(31)	12	> -100%
Aportaciones al IPAB	(492)	(533)	(542)	10%	(994)	(1,075)	8%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	49	35	9	-82%	132	44	-67%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	4	6	30	> +100%	22	36	64%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	1	-	-	-100%	1	-	-100%
Ingresos por Arrendamiento	(61)	3	19	> -100%	11	22	100%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	32	46	51	59%	61	97	59%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	730	762	719	-2%	1,581	1,481	-6%
Quebrantos	(71)	(72)	(66)	-7%	(476)	(138)	-71%
Recuperaciones	3	-	11	> +100%	6	11	83%
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>178</b>	<b>282</b>	<b>208</b>	<b>17%</b>	<b>313</b>	<b>490</b>	<b>57%</b>

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

	3 meses				6 meses		
<b>Scotiabank- Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>(391)</b>	<b>(145)</b>	<b>(287)</b>	<b>-27%</b>	<b>1,039</b>	<b>(432)</b>	<b>&gt; -100%</b>

En el segundo trimestre de 2023, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$287 millones, una disminución de \$104 millones o 27% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos en la cartera comercial y de reservas voluntarias; compensados parcialmente por mayores requerimientos en la cartera de vivienda y consumo.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra un incremento de \$142 millones o 98% debido a mayores requerimientos en tarjeta de crédito; así como menores requerimientos en la cartera comercial.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de junio 2023 ascendió a \$432 millones, un incremento anual de \$1,471 millones, debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022.

## Gastos de Administración y Promoción

	3 meses				6 meses		
	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank- Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Gastos de Personal	(1,773)	(2,367)	(2,001)	13%	(4,175)	(4,368)	5%
Gastos de Operación	(2,097)	(2,067)	(2,279)	9%	(4,169)	(4,346)	4%
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(3,870)</b>	<b>(4,434)</b>	<b>(4,280)</b>	<b>11%</b>	<b>(8,344)</b>	<b>(8,714)</b>	<b>4%</b>

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,280 millones en el segundo trimestre, un incremento de \$410 millones u 11% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a un incremento en gastos de personal por PTU y salarios, así como un incremento en gastos de operación principalmente por mayores amortizaciones.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$154 millones o 3%. Los gastos de personal mostraron una disminución de \$366 millones o 15%, principalmente por PTU y compensación variable, así como un incremento en gastos de operación principalmente por mayores honorarios, seguros e IVA.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de junio 2023 ascendieron a \$8,714 millones, un incremento anual de \$370 millones o 4%. Los gastos de personal mostraron un incremento de \$193 millones o 5%, debido principalmente a mayores salarios. Por su parte, los gastos de operación mostraron un incremento anual de \$177 millones o 4%, debido principalmente a mayores gastos por amortizaciones.

## Impuestos a la Utilidad

	3 meses				6 meses		
	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%	30 jun 2022	30 jun 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank- Impuestos - Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Impuesto a la Utilidad Causado	(807)	(962)	(979)	21%	(1,429)	(1,941)	36%
Impuesto a la Utilidad Diferido	47	(246)	(315)	> -100%	(339)	(561)	65%
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(760)</b>	<b>(1,208)</b>	<b>(1,294)</b>	<b>70%</b>	<b>(1,768)</b>	<b>(2,502)</b>	<b>42%</b>

En el segundo trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$1,294 millones, un incremento de \$534 millones o 70% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por el efecto en la tasa impositiva producto de la disminución de la inflación.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto incrementó \$86 millones o 7%, originado principalmente por la disminución de la inflación en el periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2023 ascendieron a \$2,502 millones, un incremento anual de \$734 millones o 42%, debido a una menor inflación del periodo.

## Balance General

<b>Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	228,718	248,273	266,608	17%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	443,593	472,571	466,023	5%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,428	18,550	19,262	17%
Partidas diferidas	-	2,765	2,861	0%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,648)	(16,278)	(15,837)	1%
Otros Activos	47,430	50,515	37,076	-22%
<b>Total Activo</b>	<b>720,521</b>	<b>776,396</b>	<b>775,993</b>	<b>8%</b>
Depósitos	439,729	485,731	508,629	16%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	41,855	35,734	34,690	-17%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,052	9,099	9,054	0%
Otros Pasivos	154,994	170,396	145,795	-6%
<b>Capital</b>	<b>74,891</b>	<b>75,436</b>	<b>77,825</b>	<b>4%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>720,521</b>	<b>776,396</b>	<b>775,993</b>	<b>8%</b>

Al 30 de junio de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$775,993 millones, un incremento de \$55,472 millones u 8% respecto al cierre de junio de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes de cartera de crédito, así como en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico).

Los activos totales disminuyeron \$403 millones respecto al cierre del trimestre anterior, debido principalmente a menores volúmenes de deudores por liquidación de operaciones (en Otros Activos) y cartera de crédito de riesgo de crédito etapa 1; compensados parcialmente por mayores volúmenes en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico y otras entidades financieras).

El total del pasivo registró \$698,168 millones al 30 de junio de 2023, un incremento de \$52,538 millones u 8% respecto al año pasado, debido principalmente a menores volúmenes mayores volúmenes en depósitos, compensados parcialmente por menores volúmenes de valores asignados por liquidar y acreedores por liquidación de operaciones de inversiones en instrumentos financieros (en Otros Pasivos).

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total disminuyó \$2,792 millones, debido principalmente a menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones, valores asignados por liquidar, colaterales vendidos o dados en garantía, y acreedores por reporto (en Otros Pasivos), que contrarrestan el incremento de volúmenes en depósitos.



## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

<b>Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,313	33,042	33,368	-3%
Créditos a la Vivienda	176,249	192,939	198,261	12%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>210,562</b>	<b>225,981</b>	<b>231,629</b>	<b>10%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	197,079	216,060	201,226	2%
Entidades Financieras	19,869	16,097	15,909	-20%
Entidades Gubernamentales	16,083	14,433	17,259	7%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>233,031</b>	<b>246,590</b>	<b>234,394</b>	<b>1%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>443,593</b>	<b>472,571</b>	<b>466,023</b>	<b>5%</b>

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2023 se ubicó en \$234,394 millones, un incremento de \$1,363 millones o 1% respecto al año pasado y una disminución de \$12,196 millones o 5% respecto al trimestre anterior. El incremento anual se dio por mayores créditos de actividad empresarial o comercial y entidades gubernamentales; compensados por una disminución de créditos de entidades financieras. La disminución trimestral se debió principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial.

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2023 alcanzó \$231,629 millones, un incremento anual de \$21,067 millones o 10% y \$5,648 o 2% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados por mayores créditos a la vivienda.

## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

	3 meses			
<b>Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,428	18,550	19,262	17%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,648)	(16,278)	(15,837)	1%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>780</b>	<b>2,272</b>	<b>3,425</b>	<b>&gt; +100%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.57%</b>	<b>3.78%</b>	<b>3.97%</b>	<b>40pb</b>

Al 30 de junio de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$19,262 millones, un incremento anual de \$2,834 millones o 17% y un incremento trimestral de \$712 millones o 4%.



En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,837 millones, un incremento anual de \$189 millones o 1% y una disminución de \$441 millones o 3% respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.3% de la cartera total, una disminución de 14pb respecto al año anterior y de 5pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 82.2% al 30 de junio de 2023, una disminución de 1,300pb respecto del año anterior y de 600pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 30 de junio de 2023 fue de 4.0%, un incremento de 40pb respecto del año anterior y 19pb respecto al trimestre pasado.

## Depósitos

<b>Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023	A/A Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>221,199</b>	<b>229,911</b>	<b>257,433</b>	<b>16%</b>
Público en General	192,935	205,915	204,187	6%
Mercado de Dinero	2,305	43,630	42,770	> +100%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>195,240</b>	<b>249,545</b>	<b>246,957</b>	<b>26%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	22,355	5,047	3,007	-87%
Cuenta global de captación sin movimientos	935	1,228	1,232	32%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>439,729</b>	<b>485,731</b>	<b>508,629</b>	<b>16%</b>

El total de depósitos registró \$508,629 millones al 30 de junio de 2023, un incremento anual de \$68,900 millones o 16%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por \$51,717 millones o 26%.

Respecto al trimestre anterior, el total de depósitos aumentó \$22,899 millones o 5%, debido principalmente a un incremento en los depósitos a la vista y ahorro.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 30 de junio de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,054 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

<b>Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros</b> (millones de pesos al 30 de junio de 2023 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>67,365</b>	<b>1,557</b>	<b>23</b>	<b>200</b>	<b>69,145</b>
Sin restricción:	-	1,557	21	106	1,684
Restringidos:	67,365	-	2	94	67,461
En operaciones de reporto	59,678	-	-	94	59,772
Préstamos de valores	4,523	-	-	-	4,523
Otros	3,164	-	2	-	3,166
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>55,717</b>	<b>22,132</b>	<b>-</b>	<b>2,406</b>	<b>80,255</b>
Sin restricción:	44,251	22,132	-	2,406	68,789
Restringidos:	11,466	-	-	-	11,466
En operaciones de reporto	10,855	-	-	-	10,855
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	611	-	-	-	611
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>4,819</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,819</b>
Sin restricción	4,819	-	-	-	4,819
<b>Total</b>	<b>127,901</b>	<b>23,689</b>	<b>23</b>	<b>2,606</b>	<b>154,219</b>

<b>Scotiabank</b> <b>Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales</b> (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 30 de junio de 2023)				
Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-23271	14,913,906,620	11.20%	3	14,900

<b>Scotiabank-Instrumentos financieros derivados</b> (millones de pesos al 30 de junio de 2023 valor razonable)														
Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	4,165	3,383	-	-	1,424	1,291	216	181	25,885	25,818	-	-	31,690	30,673
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	9,899	7,703	-	-	9,899	7,703

Scotiabank-Montos nacionales en operaciones derivadas (Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2023)												
Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
<b>Con fines de negociación</b>												
Posición USD	2,454	2,879	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	26	26	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	1	1	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	12	12	360	345	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	9	9	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	30	30	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	181	181	1,345	1,057	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	2,660	3,342	678	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	33,002	32,338	363,284	356,368	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	668	667	3,982	3,791	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
<b>Con fines de cobertura</b>												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	62,448	3,500	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	597	482	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	154,336	42,658	-	196,994
Créditos a entidades financieras	15,738	171	-	15,909
Créditos a entidades gubernamentales	13,830	3,429	-	17,259
Créditos al consumo	32,665	-	-	32,665
Créditos a la vivienda	195,027	11	5	195,043
<b>Total</b>	<b>411,596</b>	<b>46,269</b>	<b>5</b>	<b>457,870</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	4,231	1	-	4,232
Créditos al consumo	703	-	-	703
Créditos a la vivienda	3,210	4	4	3,218
<b>Total</b>	<b>8,144</b>	<b>5</b>	<b>4</b>	<b>8,153</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	7,981	1,404	0	9,385
Créditos a entidades financieras	57	0	0	57
Créditos al consumo	857	0	0	857
Créditos a la vivienda	8,926	30	7	8,963
<b>Total</b>	<b>17,821</b>	<b>1,434</b>	<b>7</b>	<b>19,262</b>

<b>Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)</b>	
Saldo al 31 de marzo de 2023	18,550
Reestructuras	160
Recuperaciones	(495)
Castigos y quitas	(672)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	1,800
Fluctuación Tipo Cambio	(81)
<b>Saldo al 30 de junio de 2023</b>	<b>19,262</b>

<b>Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)</b>		
Saldo al 31 de marzo de 2023		16,278
Más: Creación de reservas		40
Calificación		303
Menos: Adjudicaciones y otros		53
Castigos y quitas		649
Comercial	7	
Hipotecario	169	
Consumo	473	
Desliz cambiario		82
Saldo al 30 de junio de 2023		15,837

<b>Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>		
No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	9,960	14.48%
2	7,564	11.00%
3	7,048	10.25%
<b>Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos</b>		<b>24,572</b>

<b>Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito</b>	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	57.7%	63.8%	64.2%
Noroeste – Centro	12.1%	10.5%	10.4%
Norte	14.8%	13.2%	12.9%
Bajío	9.2%	7.3%	7.1%
Sur	6.2%	5.2%	5.4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	39.5%	51.0%	53.4%
Noroeste – Centro	17.8%	16.3%	15.9%
Norte	8.3%	6.1%	5.8%
Bajío	16.6%	13.0%	12.1%
Sur	17.8%	13.6%	12.8%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia (millones de pesos al 30 de junio de 2023)						
Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	397,208	826	100	471	331	1,728
Riesgo A2	72,818	731	29	196	30	986
Riesgo B1	9,009	89	38	54	19	200
Riesgo B2	7,672	8	50	31	73	162
Riesgo B3	6,399	47	23	34	74	178
Riesgo C1	2,887	23	36	63	49	171
Riesgo C2	3,638	78	28	88	223	417
Riesgo D	8,044	749	50	267	1,311	2,377
Riesgo E	11,352	5,813	631	292	1,736	8,472
<b>Total</b>	<b>519,027</b>	<b>8,364</b>	<b>985</b>	<b>1,496</b>	<b>3,846</b>	<b>14,691</b>
<b>Exceso</b>						<b>1,146</b>
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>15,837</b>

## NOTAS:

- 1). Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 30 de junio de 2023.
- 2). La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	7
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		25
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		5
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		1,109
<b>Total</b>	<b>\$</b>	<b>1,146</b>

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

<b>Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,709	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>11,209,692</b>	<b>1,709</b>	

<b>Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	4,751	1,070
Pagos anticipados	(1,141)	(257)
Comisiones cobradas por anticipado	494	110
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	731	164
Plan de pensiones	1,006	226
Provisiones y otros	896	162
Otros	(752)	(74)
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>5,985</b>	<b>1,401</b>

Al 30 de junio de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.



Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de junio de 2023)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	7,313	3,035	-	10,348
Largo	-	-	9,500	3,947	-	13,447
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>16,813</b>	<b>6,982</b>	<b>-</b>	<b>23,795</b>
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.91%	10.89%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	8,186	-	13	560	1,759	10,518
Largo	-	-	-	377	-	377
<b>Total</b>	<b>8,186</b>	<b>-</b>	<b>13</b>	<b>937</b>	<b>1,759</b>	<b>10,895</b>
Tasa Promedio	5.84%	0.00%	6.41%	5.64%	5.83%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>8,186</b>	<b>-</b>	<b>16,826</b>	<b>7,919</b>	<b>1,759</b>	<b>34,690</b>

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 2023.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 jun 2022	31 mar 2023	30 jun 2023
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>53.2%</b>	<b>48.1%</b>	<b>51.2%</b>
Metropolitano	22.5%	21.5%	24.8%
Noroeste – Centro	11.4%	9.0%	9.1%
Norte	7.6%	6.7%	6.9%
Bajío	6.0%	5.1%	4.8%
Sur	5.7%	5.8%	5.6%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>46.2%</b>	<b>42.8%</b>	<b>40.3%</b>
Metropolitano	18.0%	19.9%	16.3%
Noroeste - Centro	5.8%	4.4%	4.0%
Norte	9.4%	7.6%	7.3%
Bajío	6.8%	5.3%	6.6%
Sur	6.2%	5.6%	6.1%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>99.4%</b>	<b>90.9%</b>	<b>91.5%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>0.6%</b>	<b>9.1%</b>	<b>8.5%</b>

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional Tasa Promedio (millones de pesos al 30 de junio de 2023)	Pesos	Dólares
	Depósitos a la vista (incluye ahorro)	5.73%
Depósitos a plazo	9.99%	0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)	30 jun 2023
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	98
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(9)
Resultado por valuación de divisas	(1,380)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	1,754
Resultado por compraventa de divisas	662
Costos de transacción	(2)
<b>Total</b>	<b>1,123</b>

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)					
Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MX0QSC1N0016	3,640	2,093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MX0QSC1N0024	5,460	3,360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032	-	3,455,000,000	11.3
<b>Total de Obligaciones Subordinadas</b>				<b>8,908,000,000</b>	

## Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99-SCOTIAB 04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB 05-21	4,842,100	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	484,210,000
99-SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99-SCOTIAB 08-21	802,900	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,290,000
99-SCOTIAB 09-21	3,938,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	393,820,000
99-SCOTIAB 10-21	3,841,300	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,130,000
99-SCOTIAB 01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093	MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB 02-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99-SCOTIAB 03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546	iShares MSCI China ETF	36,975,000
99_SCOTIAB_04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99_SCOTIAB_06-22	1,826,500	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	182,650,000
99_SCOTIAB_07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_08-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_09-22	490,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,000,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-22	14-nov-25	1,093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1,092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
<b>Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2023</b>						<b>2,948,680,000</b>

# CAPITALIZACIÓN

<b>Scotiabank</b> <b>Integración del Capital</b> <b>Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios.</b> <b>(millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	49,837
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	14,520
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	<b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	77,826
<b>Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,402
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	-

22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	9,125
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	8,482
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	643
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>	10,527
29	<b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>	67,299
<b>Capital adicional de nivel 1: instrumentos</b>		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,581
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,581
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 región 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	<b>Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	3,581
<b>Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1</b>	-
44	<b>Capital adicional de nivel 1 (AT1)</b>	3,581
45	<b>Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)</b>	70,881
<b>Capital de nivel 2: instrumentos y reservas</b>		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,791
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	1,109
51	<b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>	4,900
<b>Capital de nivel 2: ajustes regulatorios</b>		
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	<b>Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2</b>	-
58	<b>Capital de nivel 2 (T2)</b>	4,900
59	<b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>	75,780
60	<b>Activos ponderados por riesgo totales</b>	456,829
<b>Razones de capital y suplementos</b>		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.73%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.52%

63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.59%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.83%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	7.73%
<b>Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)</b>		
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
<b>Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)</b>		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
<b>Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2</b>		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	1,109
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,030
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	-
<b>Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)</b>		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-



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

Referencia	Descripción
1	Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
2	Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3	Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones.
5	No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6	Suma de los conceptos 1 a 5.
7	No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8	Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9	Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10*	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.
12*	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como 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*	<p>El monto de la inversión en cualquier acción propia que:</p> <p>la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</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.</p>
17*	<p>Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</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*	<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 las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</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*	<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 las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</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*	<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	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	<b>Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.</b>
	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.	
O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.	
P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.	
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	<b>Ajustes nacionales considerados:</b> 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.
	<b>Ajustes nacionales considerados:</b>
56	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.

<b>Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>		
Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
<b>Activo</b>		
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	72,528
BG2	Cuentas de Margen	1,244
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	154,219
BG4	Deudores por reporto	130
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	41,589
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(971)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	472,309
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	15,997
BG11	Bienes adjudicados (neto)	452
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,355
BG13	Inversiones permanentes	3,849
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	5,942
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,462
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,805
	Activos Intangibles (neto)	4,521
<b>Pasivo</b>		
BG17	Captación tradicional	508,655
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	34,690
	Valores Asignados por liquidar	2,801
BG19	Acreedores por reporto	70,647
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	4,239
BG22	Instrumentos financieros derivados	38,377
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	22,573
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	576
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,059
	Pasivos por arrendamiento	1,907

	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,054
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,043
<b>Capital contable</b>		
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	64,356
<b>Cuentas de orden</b>		
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	255,252
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	472,902
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	74,425
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	9,246
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	4,239
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,525
BG41	Otras cuentas de registro	1,860,300

<b>Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General</b>				
<b>Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto</b>				
<b>(millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>				
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
<b>ACTIVO</b>				
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,402	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,402
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	



9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18		
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19		
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	-	
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	1,109	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,109
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	8,482	BG 16 Activos Intangibles \$4,521 más Gastos de Instalación \$3,961
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	643	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 643
<b>PASIVO</b>				
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	3,581	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,581
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	3,791	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,791
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	-	

<b>CAPITAL CONTABLE</b>				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	49,837	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$49,837
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	645	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$645
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	13,875	BG 30 Reservas de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$275) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$477) más Resultado Neto \$5,515
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	-	
<b>CUENTAS DE ORDEN</b>				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
<b>CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL</b>				
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

46	Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
47	El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
48	Derogado

<b>Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales (millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>		
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	56,334	4,507
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	938	75
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA 's	3,119	249
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA 's o con rendimiento referido al INPC	50	4
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	6,104	488
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,100	88
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	94	8
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	20	2
<b>Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo</b>		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	18	1
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%)	826	66
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,452	356
Grupo III (ponderados al 25%)	1	-
Grupo III (ponderados al 50%)	336	27
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	257	21

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%)	3,200	256
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	196	16
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	27	2
Grupo VI (ponderados al 20%)	3,103	248
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,188	175
Grupo VI (ponderados al 30%)	8,345	668
Grupo VI (ponderados al 40%)	9,104	728
Grupo VI (ponderados al 50%)	37,005	2,960
Grupo VI (ponderados al 70%)	27	2
Grupo VI (ponderados al 75%)	22,444	1,796
Grupo VI (ponderados al 85%)	9,729	778
Grupo VI (ponderados al 100%)	53,350	4,268
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	129	10
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	17,664	1,413
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	14	1
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	10,628	850
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	114,858	9,189
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	104	8
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,640	131
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%)	504	40
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%)	8,064	645
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,708	297
Grupo IX (ponderados al 100%)	30,256	2,420
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	35	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,100	248
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	17	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	12	1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	43,729	3,498

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

Al 30 de junio del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

Scotiabank- Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio		
Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
	Tratamiento regulatorio	
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"



8	Monto reconocido en el capital regulatorio	13,468,335,561
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
	<b>Rendimientos / dividendos</b>	
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación de dividendos	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.
24	Condiciones de convertibilidad	N.A.
25	Grado de convertibilidad	N.A.
26	Tasa de conversión	N.A.
27	Tipo de convertibilidad del instrumento	N.A.
28	Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad	N.A.
29	Emisor del instrumento	Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30	Cláusula de disminución de valor (Write-Down)	No
31	Condiciones para disminución de valor	N.A.
32	Grado de baja de valor	N.A.
33	Temporalidad de la baja de valor	N.A.
34	Mecanismos de disminución de valor temporal	N.A.
35	Posición de subordinación en caso de liquidación	Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36	Características de incumplimiento	NO
37	Descripción de características de incumplimiento	NO

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

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

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

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

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

**Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto (millones de pesos al 30 de junio de 2023)**

Referencia	RUBRO	Jun-23 <sup>1)</sup> T	Mar-23 T-1	Dic-22 T-2
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	7,585	7,638	7,719
1a	No aplica			
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	456,829	459,745	475,011
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	1.63%	1.63%	1.6%
3a	No aplica			
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	809,032	814,737	807,899
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	0.94%	0.94%	0.94%
5a	No aplica			
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%

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

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

<b>Scotiabank</b>		
<b>Composición del Suplemento al Capital Neto</b>		
<b>(millones de pesos al 30 de junio de 2023)</b>		
Referencia		Monto
	<b>Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes</b>	
1	Capital Fundamental	67,299
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	3,581
3	Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros	-
4	Otros ajustes	-
5	<b>Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto</b>	<b>3,581</b>
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	4,900
7	Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año	-
8	"Capital complementario no elegible, como Suplemento al Capital Neto emitido por la institución en tenencia de terceros	
9	Otros ajustes	-
10	<b>Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales</b>	<b>4,900</b>
11	<b>Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio</b>	<b>75,780</b>
	<b>Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio</b>	
12	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos	-
13	"Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco los cuales no son subordinados a pasivos excluidos, pero que cumplen con todos los demás requisitos de la hoja de términos de Suplemento al Capital Neto	
14	Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores.	No aplica
15	Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022	No aplica
16	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia sistémica local en resolución	No aplica
17	<b>Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes</b>	<b>-</b>
	<b>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de deducciones	75,780
19	Deducciones de exposiciones que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto (no aplicable a una institución de importancia sistémica local con un solo punto de entrada).	No aplica
20	Deducciones de inversiones en otros pasivos elegibles de Suplemento al Capital Neto	-
21	Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto	-
22	Suplemento al Capital Neto después de deducciones	75,780
	<b>"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto"</b>	
23	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto4	456,829

24	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	809,032
<b>Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos</b>		
25	"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	16.59%
26	"Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	9.37%
27	Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	14.73%
28	"Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más requerimiento por suplemento de capital contracíclico más requerimientos por suplemento al capital neto, expresado como porcentaje de APSRT)	2.23%
29	" Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital	0.60%
30	Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco	0.00%
31	Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto	1.63%

<b>Scotiabank</b>		
<b>Composición del Suplemento al Capital Neto</b>		
Referencia	Explicación	
<b>Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes</b>		
1	El Capital Fundamental calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.	
2	Capital Básico No Fundamental. Esta línea proporcionará información sobre el Capital No Fundamental, calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.	
3	Los instrumentos de capital Básico No Fundamental emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.	
4	Otros elementos del Capital Básico No Fundamental que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.	
5	<b>Instrumentos de Capital Básico No Fundamental de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como línea 2 menos líneas 3 y 4.</b>	
6	Capital Complementario, calculado con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 5 y 2 Bis 7.	
7	Porción amortizada de Instrumentos de Capital Complementario donde el vencimiento remanente es mayor a un año. Esta línea reconoce que, en tanto el plazo remanente de un instrumento de capital complementario sea mayor al requerimiento de vencimiento residual de un año, el monto total podrá ser incluido en el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales, incluso si el instrumento es parcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento. Solo el monto no reconocido en el capital regulatorio, que cumpla con todos los criterios de elegibilidad del Suplemento al Capital Neto deberá ser reportados en esta línea.	
8	Instrumentos de capital complementario emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles para el Suplemento al Capital Neto. De acuerdo con la fracción IV, del artículo 2 Bis 5 de la CUB y los Anexos 1-R y 1-S, para cumplir con los requerimientos mínimos de Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales hasta el 31 de diciembre de 2021	
9	Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.	
10	<b>Instrumentos de capital Complementario elegibles de Suplemento al Capital Neto de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como: línea 6 - línea 7 - línea 8 - línea 9.</b>	
11	<b>Suplemento al Capital Neto surgido del capital regulatorio para ser calculado como: línea 1 + línea 5 + línea 10.</b>	
<b>Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio</b>		
12	Instrumentos externos del Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por la institución y deuda subordinada excluida. El monto reportado en esta línea debe cumplir los requerimientos de subordinación señalados en el Anexo 1-R o Anexo 1-S.	

13	Instrumentos externos emitidos directamente por institución que no son subordinados a pasivos excluidos, pero cumplen los otros requisitos de los Anexos 1-R o 1-S.
14	El monto reportado en la línea 13, después de la aplicación de los límites superiores 2.5% y 3.5% mostrados en el penúltimo párrafo de la sección 11 de la hoja de términos del TLAC
15	Instrumentos externos de TLAC emitidos con fines de financiamiento previo al 1 de enero de 2022. Montos emitidos después del 1 de enero de 2022 no son elegibles para efectos de Suplemento al Capital Neto y no deben ser reportados aquí. <b>No aplica.</b>
16	Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar una institución de importancia sistémica local en resolución, sujeta a las condiciones mostradas en el segundo párrafo de la sección 7 de la hoja de términos de TLAC. <b>No aplica.</b>
17	Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13
<b>Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes</b>	
18	Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.
19	Deducciones de exposiciones de la institución de importancia sistémica local que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto. Todos los montos reportados en esta línea deben corresponder a deducciones aplicadas después de los ajustes adecuados acordados por el grupo de administración de crisis (CMG) (siguiendo el penúltimo párrafo de la sección 3 de la hoja de términos de TLAC, el CMG debe discutir y, donde sea adecuado y consistente con la estrategia de resolución, acordar la asignación de las deducciones).
20	"Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. <b>No aplica</b>
21	Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.
22	"El Suplemento al Capital Neto (como puede ser el caso) después de deducciones. Para ser calculado como: línea 18 - línea 20 – línea 21.
<b>"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto</b>	
23	APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.
24	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.
<b>Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos</b>	
25	Indicador Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto), para ser calculada como línea 22 dividido entre línea 23.
26	"Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento), para ser calculado como línea 22 entre línea 24.
27	Capital Fundamental (como porcentaje de APSRT) disponible después de cumplir con el requerimiento mínimo de capital y requerimiento Suplemento al Capital Neto de la institución. Para ser calculado como índice de capital fundamental adecuado, menos cualquier capital social (como un porcentaje de APSRT) usado para cumplir el capital fundamental, el capital básico, y el capital total mínimo, así como el requerimiento de Suplemento al Capital Neto.
28	Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más suplemento de capital contracíclico más requerimiento por suplemento para institución de importancia sistémica local, expresado como un porcentaje de APSRT). Calculado como la suma de: i) el suplemento de conservación de capital de la institución de importancia sistémica local; el requerimiento por suplemento contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local; y iii) los requerimientos por suplemento al capital neto.
29	"El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan al suplemento por conservación de capital), de acuerdo al nivel de importancia sistémica local.
30	El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con requerimientos por suplemento de capital contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local).
31	El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con al requerimiento para absorción de pérdidas mayores.



## Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

## Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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



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

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

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

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

## **Riesgo de mercado**

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 30 de junio de 2023 fue de \$24.75 millones y su promedio durante el segundo trimestre de 2023 fue de \$24.55 millones mismo que corresponde a un 0.032% del capital neto (\$76,930 millones a mayo 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Junio 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,051,403	1,018,768
Mercado de Dinero	62,082	60,194
Tipo de cambio		
Cash	2,955	3,102
Derivados	115,120	145,732
Capitales		
Derivados	9,933	10,976

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Junio 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	27.78	20.39
Tipo de cambio	7.09	19.68
Capitales	-	0.01
<b>VaR Global</b>	<b>24.90</b>	<b>24.55</b>

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 2023 muestra una pérdida máxima de \$332.8 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado “Error de diciembre” y México 1997 por el efecto de la “crisis del rublo” y la crisis financiera asiática.

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

## Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica<sup>1</sup> 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.

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

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

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

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

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

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US)	95,965	75,104
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,452	113,922

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el segundo trimestre de 2023 de 140% y 108% respectivamente.

<sup>2</sup> Cifras previas al cierre de junio 2023.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen 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  $\pm 100$  puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(1,286)	(1,125)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(369)	(369)

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender <sup>1)</sup>	80,255	79,504
Derivados de Cobertura	80,124	78,282

<sup>1)</sup> 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 2023 y el promedio del segundo trimestre del 2023 fueron \$2,676 millones y \$2,731 millones, respectivamente.

## Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre corresponde a \$24 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del segundo trimestre de 2023, el Banco mantiene \$583 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

## Información metodológica

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

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

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

<b>Métricas Riesgo de Crédito<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras al 30 de junio 2023)</b>	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.35%	2.95%
Consumo	3.76%	12.30%
Cartera Comercial	0.63%	4.07%
<b>Total</b>	<b>0.73%</b>	<b>4.17%</b>

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

<b>Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras a millones al 30 de junio 2023)</b>	E <sup>2)</sup>	PI	SP
Hipotecas	198,260	1.85%	17.13%
Consumo	51,092	4.77%	72.17%
Cartera Comercial	277,367	1.75%	44.33%

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

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

## Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

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



## Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

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

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

## Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de junio 2023 y en promedio durante el segundo trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.74% y 0.74% respectivamente.

## Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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



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

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

## **Riesgo Operacional**

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

## **Metodología general**

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

## **Políticas para la gestión de riesgo operacional**

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

## **Evaluación de riesgo operacional**

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

## **Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional**

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

## **Niveles de tolerancia de riesgo Operacional**

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

## **Indicadores clave de riesgo (KRI)**

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

## Riesgo Legal

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

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

## Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

## Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de abril - junio 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$59.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$197.9 millones, donde \$4.8 millones corresponden a riesgo operacional y \$193.1 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

## Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

**Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)**  
**Periodo Reportado: abril 2023 – junio 2023 (T2 2023)**  
**Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez<sup>3</sup>**

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T2 2023		Calculo Consolidado T2 2023	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	98,689.92	No aplica	98,689.92
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>					
2	Financiamiento minorista no garantizado	166,954.61	13,457.38	166,954.61	13,457.38
3	Financiamiento estable	96,746.98	6,436.61	96,746.98	6,436.61
4	Financiamiento menos estable	70,207.63	7,020.76	70,207.63	7,020.76
5	Financiamiento mayorista no garantizado	236,483.43	87,342.37	236,483.43	87,342.37
6	Depósitos operacionales	126,643.05	30,936.12	126,643.05	30,936.12
7	Depósitos no operacionales	105,035.94	51,601.80	105,035.94	51,601.80
8	Deuda no garantizada	4804.441467	4804.441467	4804.441467	4804.441467
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	875.001	No aplica	875.001
10	Requerimientos adicionales:	244,696.10	17,865.74	244,696.10	17,865.74
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,782.97	5,302.23	7,782.97	5,302.23
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	236,913.13	12,563.51	236,913.13	12,563.51
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	19.15243333	19.15243333	19.15243333	19.15243333
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,575.06	2,575.06	2,575.06	2,575.06
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	122,134.69	No aplica	122,134.69
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	3,073.07	225.5545556	3,073.07	225.5545556
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	48,127.51	31,799.30	48,127.51	31,799.30
19	Otras entradas de efectivo	17,841.98	17,841.98	17,841.98	17,841.98
20	<b>TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	69,042.56	49,866.84	69,042.56	49,866.84
<b>Importe ajustado</b>					
21	<b>TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES</b>	No aplica	98,689.92	No aplica	98,689.92
22	<b>TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	72,267.86	No aplica	72,267.86
23	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]</b>	No aplica	140.12	No aplica	140.12

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

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

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

### **Durante junio 2023, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):<sup>4</sup>**

#### Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$61,855 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$34,168 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$2,676 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$12,856 millones.

#### Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$19,611 millones y por operaciones de call money de \$12,644 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$17,021 millones.

#### Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$109,918 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$53,664 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$46,815 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$7,174 millones y \$2,266 millones en títulos de nivel 2.

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

**Promedio del primer trimestre 2023: 133% – promedio del segundo trimestre 2023: 140%** El coeficiente de cobertura de liquidez creció 700 pb respecto del primer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$5,959 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$6,651 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$20,406 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$24,342 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$8,979, millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables<sup>5</sup>;

<sup>4</sup> 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.

<sup>5</sup> Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

<b>Evolución de Activos Líquidos T2-2023</b>	Abril	Mayo	Junio
Efectivo	8%	8%	6%
Reservas en el Banco Central	28%	43%	43%
Nivel 1	62%	48%	49%
Nivel 2ª	2%	1%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
<b>Total de Activos Líquidos Ponderados</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

<b>Concentración de fuentes de Financiamiento</b>	Abril	Mayo	Junio
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	46%	48%	43%
Depósitos a plazo			
Del público en general	37%	37%	39%
Mercado de dinero	8%	8%	6%
Títulos de crédito emitidos	1%	1%	2%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	4%	3%	6%
De largo plazo	3%	3%	4%
<b>Total</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

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

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

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

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

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

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

<b>Exposición Potencial Futura (junio 2023)</b> <b>(Cifras en millones de pesos)</b>	
Con contrato de compensación	3,111
Sin contrato de compensación	9,320
Posibles llamadas de margen (junio 2023)	
Colateral en Tránsito	49
Downgrade (junio 2023)	
Baja calificación 3 niveles	2,676

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

<b>Scotiabank-Exposición en Derivados</b> <b>(cifras en millones de pesos)</b>	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,051,403
Tipo de cambio	115,120
Capitales	9,933
<b>Total</b>	<b>1,176,456</b>

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el segundo trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -7.06% al cierre de junio del 2023 y en promedio durante segundo trimestre del 2023 fue de -5.83%.

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 <sup>6</sup>	Límite MM
Concepto	
Concentración de Depósitos (MXN)	9,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	175 USD

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

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

<sup>6</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

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.

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

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

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

Descripción <sup>7</sup>	Promedio T2 2023	Junio 2023
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	45,298	51,080
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	179,024	184,855
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	45	41
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	41	39
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	45	41
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	41	39

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

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

Los resultados al cierre de junio 2023 y el promedio del segundo trimestre de 2023 son:

Scotiabank <sup>8</sup>	Posición (Cierre) <sup>9</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	95,965	75,104
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,452	113,922

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.

<sup>7</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

<sup>8</sup> Sujeto a excepciones para algunos nombres.

<sup>9</sup> Cifras previas al cierre de junio 2023.



## II. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de 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 2023, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del segundo trimestre 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

Periodo Reportado: segundo trimestre del 2023  
 Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto<sup>10</sup>

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas					
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE											
1	Capital:	80,525.93	0.00	0.00	0.00	80,525.93	80,525.93	0.00	0.00	0.00	80,525.93
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	80,525.93	0.00	0.00	0.00	80,525.93	80,525.93	0.00	0.00	0.00	80,525.93
3	Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	Depósitos minoristas:	0.00	202,161.87	2,312.00	20.41	188,593.37	0.00	202,161.87	2,312.00	20.41	188,593.37
5	Depósitos estables.	0.00	89,925.51	1,004.06	10.91	86,394.00	0.00	89,925.51	1,004.06	10.91	86,394.00
6	Depósitos menos estables.	0.00	112,236.36	1,307.93	9.50	102,199.37	0.00	112,236.36	1,307.93	9.50	102,199.37
7	Financiamiento mayorista:	0.00	344,727.40	40,344.97	16,131.87	154,811.12	0.00	344,727.40	40,344.97	16,131.87	154,811.12
8	Depósitos operacionales.	0.00	21,082.51	0.00	0.00	10,541.26	0.00	21,082.51	0.00	0.00	10,541.26
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	323,644.89	40,344.97	16,131.87	144,269.87	0.00	323,644.89	40,344.97	16,131.87	144,269.87
10	Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11	Otros pasivos:	0.00	30,008.12	0.00	3,903.21	3,903.21	0.00	30,008.12	0.00	3,903.21	3,903.21
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	30,008.12	0.00	3,903.21	3,903.21	0.00	30,008.12	0.00	3,903.21	3,903.21
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	80,525.93	576,897.39	42,656.97	20,055.49	427,833.63	80,525.93	576,897.39	42,656.97	20,055.49	427,833.63
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	6,415.82	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	6,415.82
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	120,236.35	36,600.13	309,590.18	341,079.24	0.00	120,236.35	36,600.13	309,590.18	341,079.24
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	10,228.49	3,762.98	2,235.24	5,651.00	0.00	10,228.49	3,762.98	2,235.24	5,651.00
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	90,222.23	29,777.10	136,743.01	169,603.68	0.00	90,222.23	29,777.10	136,743.01	169,603.68
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	3,327.90	3,522.47	194,232.06	155,695.86	0.00	3,327.90	3,522.47	194,232.06	155,695.86
23	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	436.91	462.41	25,598.21	17,088.49	0.00	436.91	462.41	25,598.21	17,088.49

<sup>10</sup> Anexo 10 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple. Cifras Previas.

24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	16,894.63	0.00	1,978.09	10,128.69	0.00	16,894.63	0.00	1,978.09	10,128.69
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	45,757.71	548.32	4,673.13	37,737.43	0.00	45,757.71	548.32	4,673.13	37,737.43
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	2,183.30	0.00	0.00	1,855.80	No Aplica	2,183.30	0.00	0.00	1,855.80
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,505.68	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,505.68
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,952.25	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,952.25
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		43,574.41	548.32	4,673.13	30,423.69	0.00	43,574.41	548.32	4,673.13	30,423.69
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	242,647.55	0.00	0.00	12,132.38	No Aplica	242,647.55	0.00	0.00	12,132.38
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	397,364.87	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	397,364.87
34	<b>Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>107.67</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>107.67</b>

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

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

- **Fondeo Estable Disponible:**  
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$173,628 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$134,139 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$85,198 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$18,833 millones y \$14,496 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$4,829 millones.
- **Fondeo Estable Requerido:**  
Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$335,901 millones y por operaciones mercado de dinero de \$16,608 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,248 millones, deducciones de capital por \$10,527 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$12,970 millones.

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

**Promedio del primer trimestre del 2023: 108.14% – Promedio del segundo trimestre del 2023: 107.67%** El coeficiente de financiamiento neto incrementó 47pb respecto al primer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 9,061 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 1,880 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyeron \$2,789 millones.
- La evolución de la composición del Monto de Financiamiento Estable Disponible y del Monto de Financiamiento Estable Requerido.

<b>Monto Computable (MXN MM)</b>	Abril	Mayo	Junio
Financiamiento Estable Disponible	421,783	430,595	431,123
Financiamiento Estable Requerido	397,888	398,775	395,431
<b>Coficiente de Fondeo Estable Neto</b>	<b>106.01%</b>	<b>107.98%</b>	<b>109.03%</b>

d) El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación. Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:

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

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

## Posiciones en Acciones

Al cierre de junio de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$23 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.35) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	283,547	3.02	3.04	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	410,000	7.10	7.48	(0.38)
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	2,075	0.28	0.35	(0.07)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	2,500	1.39	1.14	0.25
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	5,000	2.58	2.62	(0.04)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,500	6.62	6.68	(0.06)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	23,300	2.09	2.12	(0.03)
<b>Total</b>			<b>729,922.00</b>	<b>23.08</b>	<b>23.43</b>	<b>(0.35)</b>

Al cierre del segundo trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.60 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	70,100	-	(0.09)	(0.09)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	125,453	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	112,332	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	34,064	-	(0.06)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	222,782	0.05	-	0.05

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	20,000	0.08	-	0.08
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	124,000	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	95	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	3,000	0.01	(0.03)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	17,116	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	989	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	9,600	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	700	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	401,750	0.05	(0.13)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	68,370	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	39,956	0.09	(0.04)	0.05
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	21,285	0.05	(0.02)	0.03
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	60,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	173,609	-	(0.21)	(0.21)
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	150,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	437	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	900	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,700	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,654	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	697	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-LAB-B	114,698	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	10,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	2,630	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	9,500	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	423,569	0.11	-	0.11
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	178,675	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	10,116	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	62,754	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	18,486	0.04	(0.05)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	155,200	0.09	(0.01)	0.08
Scotiabank	Pública	1-GFNORTE-O	42,621	0.02	(0.08)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	53,405	-	(0.06)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	71,108	0.12	-	0.12
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	76,242	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	50,000	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	100,000	0.05	-	0.05

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	825	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	9,200	0.49	-	0.49
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	2,201	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	400	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	5,693	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	2,296	-	(0.08)	(0.08)
<b>Total</b>			<b>3,061,408</b>	<b>1.59</b>	<b>(0.99)</b>	<b>0.60</b>

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

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

Al 30 de junio de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$7.54 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 5.55 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.99 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coefficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	24.95	-	24.95	22.23%	5.55
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	23.16	-	23.16	8.00%	1.85
Índices accionarios	1.79	-	1.79	4.00%	0.07
Requerimiento por riesgos específico	1.79	-	1.79	4.00%	0.07
<b>Total Requerimiento de capital</b>					<b>7.54</b>



**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-23	jun-23
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)	732,429	736,726
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,135)	(10,527)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	722,293	726,200
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	8,290	7,944
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	4,478	4,364
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo		
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(2,820)	(3,112)
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)	9,948	9,195
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	4,847	130
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(846)	(130)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	3
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)	4,002	3
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	248,799	255,252
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(170,305)	(181,618)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	78,495	73,634
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	68,783	70,881
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	814,737	809,032
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.44%	8.76%

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

Referencia	DESCRIPCION	mar-23	jun-23
1	Activos totales	778,865	778,445
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	(482)	(643)
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	(31,642)	(32,394)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(846)	(127)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	78,495	73,634
7	Otros ajustes	(9,653)	(9,884)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	814,737	809,032

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

Referencia	DESCRIPCION	mar-23	jun-23
1	Activos totales	778,865	778,445
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(41,589)	(41,589)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(4,847)	(130)
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	732,429	736,726

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

CONCEPTO/PERIODO	mar-23	jun-23	Variación
Capital Básico <sup>1)</sup>	68,783	70,881	2,097
Activos Ajustados <sup>2)</sup>	814,737	809,032	(5,705)
Razón de Apalancamiento <sup>3)</sup>	8.44%	8.76%	32 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

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

Cifras previas a la réplica de Banxico

### **Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de marzo a junio de 2023.**

El indicador se ubicó en 8.76%, 32pb superior respecto al trimestre anterior, debido a una mejora del capital nivel 1 (+26 pbs) por la utilidad del periodo, así como a la disminución en los activos ajustados (+6pb), principalmente por las partidas fuera del balance (\$4,861 millones o +5pb).

**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) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> 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.</li> <li><b>b)</b> La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.</li> <li><b>c)</b> El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.</li> <li><b>d)</b> 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.</li> <li><b>e)</b> 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.</li> </ul> <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.
	En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)
13	<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> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.</li> <li><b>b)</b> Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.</li> <li><b>c)</b> 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.</li> <li><b>d)</b> 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.</li> </ul> <p>El monto se debe registrar con signo negativo.</p>

14	Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
15	Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado. Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
16	Suma de las líneas 12 a 15
17	Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18	Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%. El monto se debe registrar con signo negativo.
19	Suma de las líneas 17 y 18
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
21	Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22	Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

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

### Agencias Calificadoras

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

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

### Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## **Fuentes internas y externas de liquidez**

Al 30 de junio del 2023, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$72,613 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$72,528 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

## **Inversiones relevantes en capital**

Al 30 de junio de 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



# Instrumentos Financieros Derivados

# I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

- 1) Manual de Operación de Derivados.
- 2) Política de 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.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de junio 2023 y en promedio para el segundo trimestre de 2023 es de:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>11</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	95,965	75,104
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,452	113,922

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

<sup>11</sup> Cifras previas al cierre de junio 2023.

## Inventario de modelos de derivados

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

### Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés	Opciones	Europea	<p>Caps, Floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.</li> </ul> $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$ <ul style="list-style-type: none"> <li>• 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.</li> </ul> $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
		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"> <li>• 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).</li> <li>• 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).</li> </ul>
	IRS	El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).	
	CCIRS	Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.	
Tipo de cambio	Opciones	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.
		Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
		Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
		Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente $S_T$ alcance un umbral preestablecido $H$ llamado barrera de la opción.
	Forward	Forward OTC	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.



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

## Instrumentos valuados a costo

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

## Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

## Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

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

## Sujetos de Crédito

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

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

## Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

## Idoneidad del Cliente

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

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

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

## Políticas de VaR

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

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

## b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

### Métodos y técnicas de Valuación:

#### Cálculo de Sensibilidades

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

#### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

#### Bonos de Tasa Flotante

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

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

#### Bonos Cupón Cero

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

## Riesgo de Crédito

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

## Sensibilidad del Pasivo

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

## Derivados de Tasas de Interés

### Swaps de Tasa de Interés

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

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

### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

### Futuros de Bono M

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

### Futuros de CETE

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

## Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

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

Durante el segundo trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

### **Cobertura de Flujos de efectivo:**

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

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

### **Cobertura de Valor Razonable:**

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

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

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

## **c. Información de Riesgos por el uso de Derivados**

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

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>12</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,452	113,922

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

<sup>12</sup> Cifras previas al cierre de junio 2023.

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:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	95,965	93,289	93,289	93,289
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(2,676)	(2,676)	(2,676)

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

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

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

### **Delta**

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

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

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

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

### **Gamma**

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

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



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

## **Vega**

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

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

## **Rho**

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

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

## **Theta**

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

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

## **Dividend Risk**

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

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

## II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2023:

<b>Scotiabank</b>	0-3 Meses	3 - 12 Meses	1 - 3 Años	3 - 5 Años	5 - 10 Años	10 - 30 Años	Total
Swaps	(67,208.03)	(87,150.30)	(205,016.86)	157,077.72	82,346.02	806,302.11	686,350.66
CCS	18,906.30	(3,522.27)	25.90	388.49	233.09	(12.95)	16,018.56
Caps&Floors	(258.99)	3,276.23	2,175.52	77.70	-	-	5,270.46
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total DERIVADOS</b>	<b>(48,560.72)</b>	<b>(87,396.34)</b>	<b>(202,815.44)</b>	<b>157,543.91</b>	<b>82,579.11</b>	<b>806,289.16</b>	<b>707,639.68</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (190.87) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (381.74) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (918.98) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	0.00	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.71	188.91	50.00	(35.38)	100.00	(70.76)	200.00	(141.53)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.04)	(0.74)	0.10	-	0.40	(0.02)	1.00	(0.04)
a FX %	Forwards	90.84	1,554.82	0.10	(155.48)	0.20	(310.96)	0.50	(777.41)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
<b>Total</b>					<b>(190.86)</b>		<b>(381.74)</b>		<b>(918.98)</b>

## 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 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options BNPIU5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	216,886.00	5,012.00	77,247.00
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options MCHI.OQ	335,934.00	4,076.00	88,017.00
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options NVDA.OQ	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>552,820.00</b>	<b>9,088.00</b>	<b>165,264.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

## Análisis de Stress

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

<b>Escenarios a la baja</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options BNPIU5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	(21,688.60)	(65,065.80)	(108,443.00)
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	(33,593.4)	(100,780.2)	(167,967)
Options MXSxAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>(55,282.00)</b>	<b>(165,846.00)</b>	<b>(276,410.00)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

<b>Escenarios al alza</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options BNPIU5.INDX	-	-	-
Options EEM.P	10,844.30	32,532.90	43,377.20
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options EZU.P	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	16,796.7	50,390.1	67,186.8
Options MXSXAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>27,641.00</b>	<b>82,923.00</b>	<b>110,564.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

<b>Scotiabank</b>	Monto
Probable	(55,282.00)
Poco Probable	(165,846.00)
Muy poco Probable	(276,410.00)

1). Cifras expresadas en pesos

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

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2023 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	333,000,000	(393,000,000)
CLIENTE 2	MXN	305,800,000	(107,200,000)
CLIENTE 3	MXN	31,200,000	(16,600,000)
CLIENTE 4	MXN	258,700,000	(361,300,000)
CLIENTE 5	USD	60,040,000	(53,710,000)
CLIENTE 6	USD	34,460,000	(26,000,000)
CLIENTE 7	USD	113,900,000	(328,200,000)
CLIENTE 8	USD	520,000	(270,000)
CLIENTE 9	USD	14,940,000	(3,380,000)
CLIENTE 10	USD	-	(400,000)
CLIENTE 11	USD	15,380,000	(19,420,000)
CLIENTE 12	MXN	74,900,000	(239,100,000)
CLIENTE 13	MXN	251,100,000	(256,900,000)
CLIENTE 14	MXN	550,700,000	(1,822,400,000)
CLIENTE 15	MXN	276,929,370	(353,789,203)
CLIENTE 16	MXN	4,000,000	-
CLIENTE 17	USD	5,720,000	(7,140,000)
CLIENTE 18	USD	860,000	(400,000)
CLIENTE 19	MXN	12,000,000	-
CLIENTE 20	USD	12,110,000	(10,040,000)
<b>TOTAL</b>		<b>2,356,259,370</b>	<b>(3,999,249,203)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
C80275	31/05/2023	Active		mxn/usd	1,095,458,541	53,437,002		418307
C80277	31/05/2023	Active		usd/mxn	53,437,002	1,095,458,541		418307
C85467	30/04/2023	Active		mxn/usd	1,805,000,000	100,000,000		418307
C85468	30/04/2023	Active		usd/mxn	100,000,000	1,805,000,000		418307
C86371	31/05/2023	Active		mxn/usd	541,410,000	30,000,000		418307
C86372	26/04/2023	Active		mxn/usd	721,880,000	40,000,000		418307
C86373	31/05/2023	Active		usd/mxn	30,000,000	541,410,000		418307
C86374	26/04/2023	Active		usd/mxn	40,000,000	721,880,000		418307
C87055	31/05/2023	Active		usd/mxn	70,000,000	1,265,600,000		418307
C87056	31/05/2023	Active		mxn/usd	1,265,600,000	70,000,000		418307
C87940	23/06/2023	Active		usd/mxn	30,000,000	512,100,000		418307
C87941	23/06/2023	Active		mxn/usd	512,100,000	30,000,000		418307
E81350	30/05/2023	Active	110,553,000	mxn			110,553,000	418196
E81400	30/05/2023	Active	110,553,000	mxn			110,553,000	418196
MNF318	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn		45,900,000		484237
MNF369	31/05/2023	Active	13,100,000	usd		13,100,000		484237
MNF399	30/06/2023	Active	122,395,833	mxn		122,395,833		484237
MNF502	22/05/2023	Active	72,888,896	mxn		72,888,896		484237
MNF503	22/05/2023	Active	36,444,448	mxn		36,444,448		484237
MNF504	22/05/2023	Active	36,444,448	mxn		36,444,448		484237
MNF505	22/05/2023	Active	91,111,104	mxn		91,111,104		484237
MNF506	22/05/2023	Active	158,479,852	mxn		158,479,852		484237
MNF508	16/06/2023	Active	150,000,000	mxn		150,000,000		484237
MNF509	16/06/2023	Active	500,000,000	mxn		500,000,000		484237
MNF510	16/06/2023	Active	500,000,000	mxn		500,000,000		484237
MWC198	12/04/2023	Active	60,511,951	mxn		60,511,951		484237
P16898	26/06/2023	Active	35,017,520	mxn			35,017,520	417998
P16900	29/05/2023	Active	1,000,000	mxn			1,000,000	417998
P16901	29/05/2023	Active	40,000,000	mxn			40,000,000	417998
P16906	29/05/2023	Active	1,000,000	mxn			1,000,000	417998
P16907	29/05/2023	Active	40,000,000	mxn			40,000,000	417998
P16919	26/06/2023	Active	35,017,520	mxn			35,017,520	417998
P16940	17/05/2023	Active	500,000,000	mxn			500,000,000	417998
P16941	17/05/2023	Active	500,000,000	mxn			500,000,000	417998
P16942	03/04/2023	Active	3,173,651	mxn			3,173,651	417998
P16944	25/05/2023	Active	31,005,002	mxn			31,005,002	417998
P16969	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn			45,900,000	417998
P16971	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn			45,900,000	26492
P17069	31/05/2023	Active	700,000,000	mxn			700,000,000	417998
P17070	31/05/2023	Active	700,000,000	mxn			700,000,000	417998
P17104	31/05/2023	Active	300,000,000	mxn			300,000,000	417998
P17105	31/05/2023	Active	300,000,000	mxn			300,000,000	417998
P17241	12/05/2023	Active	20,000,000	mxn			20,000,000	417998
P17242	12/05/2023	Active	20,000,000	mxn			20,000,000	26492
P17243	12/05/2023	Active	20,000,000	mxn			20,000,000	26492
P17974	10/06/2023	Active	47,860,875	usd			47,860,875	417998
P17975	10/06/2023	Active	47,860,875	usd			47,860,875	417998
P17977	10/06/2023	Active	10,662,938	usd			10,662,938	417998
P17978	10/06/2023	Active	10,662,938	usd			10,662,938	417998
P18111	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn			45,900,000	417998
P18121	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn			45,900,000	26492
P18140	10/06/2023	Active	3,554,313	usd			3,554,313	417998
P18141	10/06/2023	Active	3,554,313	usd			3,554,313	417998
P18143	10/06/2023	Active	15,953,625	usd			15,953,625	417998
P18144	10/06/2023	Active	15,953,625	usd			15,953,625	417998
P18146	30/06/2023	Active	30,000,000	mxn			30,000,000	417998
P18148	30/06/2023	Active	30,000,000	mxn			30,000,000	417998
P18149	30/06/2023	Active	30,000,000	mxn			30,000,000	417998
P18150	30/06/2023	Active	30,000,000	mxn			30,000,000	417998
SDR893	28/04/2023	Active	1,827,000	mxn	1,827,000	1,827,000		406503
SDR896	28/04/2023	Active	1,827,000	mxn	1,827,000	1,827,000		26492
SDS015	12/04/2023	Active	60,511,951	mxn	60,511,951	60,511,951		406503
SDS055	05/05/2023	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000		406503
SDS072	05/05/2023	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000		26492



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SDS097	30/05/2023	Active	11,266,751	mxn	11,266,751	11,266,751		406503
SDS113	30/05/2023	Active	11,266,751	mxn	11,266,751	11,266,751		26492
SDS114	10/04/2023	Active	19,098,085	mxn	19,098,085	19,098,085		406503
SDS127	10/04/2023	Active	19,098,085	mxn	19,098,085	19,098,085		26492
SDS183	19/06/2023	Active	1,577,000	mxn	1,577,000	1,577,000		406503
SDS211	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SDS213	19/06/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000		406503
SDS216	19/06/2023	Active	1,984,473	mxn	1,984,473	1,984,473		406503
SDS288	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SDS289	19/06/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000		26492
SDS292	22/05/2023	Active	224,882,428	mxn	224,882,428	224,882,428		406503
SDS294	22/05/2023	Active	224,882,428	mxn	224,882,428	224,882,428		406503
SDS295	19/06/2023	Active	1,984,473	mxn	1,984,473	1,984,473		26492
SDS296	22/05/2023	Active	156,160,657	mxn	156,160,657	156,160,657		406503
SDS297	22/05/2023	Active	156,160,657	mxn	156,160,657	156,160,657		406503
SDS304	19/06/2023	Active	1,577,000	mxn	1,577,000	1,577,000		26492
SDS316	22/05/2023	Active	224,882,428	mxn	224,882,428	224,882,428		484237
SDS320	22/05/2023	Active	156,160,657	mxn	156,160,657	156,160,657		484237
SDS331	30/06/2023	Active	18,594,420	mxn	18,594,420	18,594,420		406503
SDS338	22/05/2023	Active	26,995,429	mxn	26,995,429	26,995,429		26492
SDS339	29/06/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000		406503
SDS342	30/06/2023	Active	18,594,420	mxn	18,594,420	18,594,420		26492
SDS353	29/06/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000		26492
SDS404	22/05/2023	Active	26,995,429	mxn	26,995,429	26,995,429		406503
SDS578	25/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		484237
SDS579	25/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		484237
SDS582	24/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		484237
SDS593	10/05/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		406503
SDS599	30/06/2023	Active	4,625,000	mxn	4,625,000	4,625,000		406503
SDS604	10/05/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		26492
SDS635	30/06/2023	Active	4,625,000	mxn	4,625,000	4,625,000		26492
SDS653	30/05/2023	Active	14,439,055	mxn	14,439,055	14,439,055		406503
SDS696	30/05/2023	Active	14,439,055	mxn	14,439,055	14,439,055		26492
SDS952	02/06/2023	Active	1,100,000	mxn	1,100,000	1,100,000		406503
SDS959	02/06/2023	Active	1,100,000	mxn	1,100,000	1,100,000		26492
SDS998	26/06/2023	Active	1,820,000	mxn	1,820,000	1,820,000		406503
SdT001	26/06/2023	Active	1,820,000	mxn	1,820,000	1,820,000		26492
SdT035	30/06/2023	Active	2,349,299	mxn	2,349,299	2,349,299		406503
SdT036	16/06/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000		406503
SdT038	17/04/2023	Active	1,213,793	mxn	1,213,793	1,213,793		406503
SdT040	17/04/2023	Active	1,213,793	mxn	1,213,793	1,213,793		26492
SdT044	16/06/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000		26492
SdT058	10/04/2023	Active	868,621	usd	868,621	868,621		406503
SdT063	10/04/2023	Active	868,621	usd	868,621	868,621		26492
SdT087	29/04/2023	Active	11,299,000	mxn	11,299,000	11,299,000		406503
SdT089	30/06/2023	Active	2,349,299	mxn	2,349,299	2,349,299		26492
SdT097	29/04/2023	Active	11,299,000	mxn	11,299,000	11,299,000		26492
SdT122	10/04/2023	Active	16,632,087	mxn	16,632,087	16,632,087		406503
SdT137	10/04/2023	Active	16,632,087	mxn	16,632,087	16,632,087		26492
SdT170	25/06/2023	Active	259,600,000	mxn	259,600,000	259,600,000		418307
SdT185	10/05/2023	Active	18,281,919	mxn	18,281,919	18,281,919		406503
SdT198	10/05/2023	Active	18,281,919	mxn	18,281,919	18,281,919		26492
SdT199	26/06/2023	Active	4,081,727	mxn	4,081,727	4,081,727		406503
SdT200	22/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SdT206	26/06/2023	Active	4,081,727	mxn	4,081,727	4,081,727		26492
SdT210	22/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SdT242	30/06/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SdT243	22/06/2023	Active	122,000,000	mxn	122,000,000	122,000,000		417963
SdT276	23/06/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000		406503
SdT281	23/06/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000		26492
SdT287	30/06/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SdT290	30/06/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SdT310	30/06/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SdT380	02/06/2023	Active	10,100,000	mxn	10,100,000	10,100,000		406503

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SDT386	02/06/2023	Active	10,100,000	mxn	10,100,000	10,100,000		26492
SDT489	19/05/2023	Active	4,203,543	mxn	4,203,543	4,203,543		406503
SDT500	19/05/2023	Active	4,203,543	mxn	4,203,543	4,203,543		26492
SDT526	10/04/2023	Active	5,733,737	mxn	5,733,737	5,733,737		406503
SDT541	10/04/2023	Active	5,733,737	mxn	5,733,737	5,733,737		26492
SDT620	10/06/2023	Active	15,247,663	mxn	15,247,663	15,247,663		406503
SDT650	10/06/2023	Active	451,488	usd	451,488	451,488		406503
SDT677	10/06/2023	Active	15,247,663	mxn	15,247,663	15,247,663		26492
SDT696	12/06/2023	Active	18,013,133	mxn	18,013,133	18,013,133		406503
SDT700	14/04/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDT707	10/06/2023	Active	451,488	usd	451,488	451,488		26492
SDT719	12/06/2023	Active	18,013,133	mxn	18,013,133	18,013,133		26492
SDT792	31/05/2023	Active	652,115	mxn	652,115	652,115		406503
SDT794	17/04/2023	Active	375,000,000	mxn	375,000,000	375,000,000		418307
SDT812	17/04/2023	Active	375,000,000	mxn	375,000,000	375,000,000		418307
SDT867	31/05/2023	Active	652,115	mxn	652,115	652,115		26492
SDT891	28/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDT931	28/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDU027	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn	45,900,000	45,900,000		484237
SDU060	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn	45,900,000	45,900,000		406503
SDU131	25/06/2023	Active	259,600,000	mxn	259,600,000	259,600,000		418307
SDU306	10/04/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDU333	29/06/2023	Active	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000		418307
SDU377	28/04/2023	Active	625,000,000	mxn	625,000,000	625,000,000		418307
SDU502	05/04/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000		418307
SDU559	05/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDU630	05/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDU672	05/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDU726	11/05/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000		417963
SDU739	06/06/2023	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000		418307
SDU790	13/04/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDU798	15/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SDU826	06/06/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000		418307
SDU864	13/04/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDU876	06/06/2023	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000		418307
SDU939	18/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SDU969	14/04/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDU974	03/04/2023	Active	2,966,068	mxn	2,966,068	2,966,068		406503
SDU979	06/06/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000		418307
SDU983	03/04/2023	Active	2,966,068	mxn	2,966,068	2,966,068		26492
SDU989	21/04/2023	Active	194,957	mxn	194,957	194,957		406503
SDU992	21/04/2023	Active	194,957	mxn	194,957	194,957		26492
SDV009	21/04/2023	Active	3,805,043	mxn	3,805,043	3,805,043		406503
SDV011	21/04/2023	Active	3,805,043	mxn	3,805,043	3,805,043		26492
SDV012	17/04/2023	Active	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000		418307
SDV031	30/06/2023	Active	122,395,833	mxn	122,395,833	122,395,833		406503
SDV056	30/06/2023	Active	122,395,833	mxn	122,395,833	122,395,833		406503
SDV069	30/06/2023	Active	122,395,833	mxn	122,395,833	122,395,833		484237
SDV102	22/05/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		417963
SDV117	24/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDV202	24/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDV258	28/04/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000		406503
SDV273	28/04/2023	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000		26492
SDV284	26/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV297	09/05/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000		418307
SDV323	26/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDV349	27/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV357	07/06/2023	Active	155,000,000	mxn	155,000,000	155,000,000		418307
SDV388	09/05/2023	Active	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000		418307
SDV404	27/04/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDV459	23/06/2023	Active	16,000,000	mxn	16,000,000	16,000,000		26492
SDV476	27/04/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDV480	07/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV481	23/06/2023	Active	16,000,000	mxn	16,000,000	16,000,000		406503

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SDV490	04/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		406503
SDV517	04/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		26492
SDV544	28/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV581	02/05/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000		418307
SDV627	03/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV704	04/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV747	04/05/2023	Active	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000		418307
SDV781	04/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDV818	05/05/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000		418307
SDV849	12/05/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDV865	05/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDV913	10/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDV920	27/04/2023	Active	140,545,047	mxn	140,545,047	140,545,047		418307
SDV923	08/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDV957	10/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDV966	09/06/2023	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000		418307
SDV982	09/06/2023	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000		418307
SDV995	11/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW041	19/06/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDW067	09/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW069	15/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW090	12/04/2023	Active	8,250,000	mxn	8,250,000	8,250,000		406503
SDW099	12/04/2023	Active	8,250,000	mxn	8,250,000	8,250,000		406503
SDW105	10/05/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDW108	12/04/2023	Active	8,250,000	mxn	8,250,000	8,250,000		26492
SDW116	12/04/2023	Active	8,250,000	mxn	8,250,000	8,250,000		26492
SDW141	24/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		484237
SDW144	25/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		484237
SDW145	18/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW152	25/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		484237
SDW161	19/04/2023	Active	19,140,000	mxn	19,140,000	19,140,000		406503
SDW172	19/04/2023	Active	19,140,000	mxn	19,140,000	19,140,000		26492
SDW174	18/04/2023	Active	205,000,000	mxn	205,000,000	205,000,000		418307
SDW181	18/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW245	19/05/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000		418307
SDW253	03/05/2023	Active	13,037,209	mxn	13,037,209	13,037,209		406503
SDW257	03/05/2023	Active	13,037,209	mxn	13,037,209	13,037,209		26492
SDW259	03/04/2023	Active	9,916,667	mxn	9,916,667	9,916,667		406503
SDW269	03/04/2023	Active	9,916,667	mxn	9,916,667	9,916,667		26492
SDW285	19/05/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDW325	18/05/2023	Active	21,934,873	mxn	21,934,873	21,934,873		406503
SDW329	19/05/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDW343	13/04/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW345	18/05/2023	Active	21,934,873	mxn	21,934,873	21,934,873		26492
SDW360	23/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		406503
SDW362	19/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW369	23/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		26492
SDW379	28/04/2023	Active	2,795,000	mxn	2,795,000	2,795,000		406503
SDW384	28/04/2023	Active	2,795,000	mxn	2,795,000	2,795,000		26492
SDW403	31/05/2023	Active	13,100,000	usd	13,100,000	13,100,000		406503
SDW406	31/05/2023	Active	13,100,000	usd	13,100,000	13,100,000		406503
SDW412	22/05/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW417	31/05/2023	Active	13,100,000	usd	13,100,000	13,100,000		484237
SDW424	04/05/2023	Active	866,109	usd	866,109	866,109		406503
SDW430	04/05/2023	Active	866,109	usd	866,109	866,109		26492
SDW438	25/05/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDW447	30/05/2023	Active	4,646,272	mxn	4,646,272	4,646,272		406503
SDW448	30/05/2023	Active	4,646,272	mxn	4,646,272	4,646,272		26492
SDW453	24/05/2023	Active	13,500,000	mxn	13,500,000	13,500,000		406503
SDW463	24/05/2023	Active	13,500,000	mxn	13,500,000	13,500,000		26492
SDW467	25/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW517	26/04/2023	Active	24,606,766	mxn	24,606,766	24,606,766		418307
SDW521	19/04/2023	Active	10,500,000	mxn	10,500,000	10,500,000		406503
SDW524	19/04/2023	Active	10,500,000	mxn	10,500,000	10,500,000		26492

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SDW535	31/05/2023	Active	27,727,000	mxn	27,727,000	27,727,000		406503
SDW541	31/05/2023	Active	27,727,000	mxn	27,727,000	27,727,000		26492
SDW544	25/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW567	26/05/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW587	18/06/2023	Active	931,845	mxn	931,845	931,845		406503
SDW594	18/06/2023	Active	931,845	mxn	931,845	931,845		26492
SDW603	25/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW629	25/05/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW647	12/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW653	01/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW669	27/06/2023	Active	6,031,359	mxn	6,031,359	6,031,359		406503
SDW672	12/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW677	02/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW678	27/06/2023	Active	6,031,359	mxn	6,031,359	6,031,359		26492
SDW693	12/06/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		418307
SDW701	22/06/2023	Active	45,900,000	mxn	45,900,000	45,900,000		406503
SDW708	02/06/2023	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000		418307
SDW722	26/06/2023	Active	2,695,482	mxn	2,695,482	2,695,482		406503
SDW738	26/06/2023	Active	2,695,482	mxn	2,695,482	2,695,482		26492
SDW787	04/05/2023	Active	285,209	usd	285,209	285,209		406503
SDW788	04/05/2023	Active	285,209	usd	285,209	285,209		26492
SDW803	08/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW805	24/04/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDW814	08/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW819	04/05/2023	Active	245,600	usd	245,600	245,600		26492
SDW821	04/05/2023	Active	245,600	usd	245,600	245,600		406503
SDW830	25/04/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		418307
SDW868	14/06/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SDW896	12/04/2023	Active	18,780,000	mxn	18,780,000	18,780,000		406503
SDW898	15/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW902	12/04/2023	Active	18,780,000	mxn	18,780,000	18,780,000		26492
SDW919	08/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW937	16/06/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000		418307
SDW957	19/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDW985	30/06/2023	Active	3,050,764	mxn	3,050,764	3,050,764		406503
SDW987	21/06/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000		418307
SDW990	30/06/2023	Active	3,050,764	mxn	3,050,764	3,050,764		26492
SDX008	28/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDX022	04/05/2023	Active	77,372	usd	77,372	77,372		406503
SDX032	04/05/2023	Active	77,372	usd	77,372	77,372		26492
SDX041	29/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		418307
SDX071	30/05/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000		418307
SDX390	28/06/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		418307
SDX461	23/05/2023	Active	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000		418307
SDX462	22/05/2023	Active	525,000,000	mxn	525,000,000	525,000,000		418307
SDY090	30/06/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000		406503
SDY110	30/06/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000		26492
SDY396	01/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SDY725	06/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SDY850	07/06/2023	Active	1,030,000,000	mxn	1,030,000,000	1,030,000,000		418307
SDY980	08/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SDY982	08/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SDZ165	09/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SDZ167	09/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SDZ727	31/05/2023	Active	1,406,138	mxn	1,406,138	1,406,138		406503
SDZ748	31/05/2023	Active	1,406,138	mxn	1,406,138	1,406,138		26492
SEA118	19/06/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000		418307
SEA120	19/06/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000		418307
SEA755	21/06/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		417963
SEA756	21/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SEB038	22/06/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000		417963
SEB912	29/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SEB914	29/06/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SED296	30/06/2023	Active	784,781	mxn	784,781	784,781		406503

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SED344	30/06/2023	Active	784,781	mxn	784,781	784,781		26492
SED862	12/04/2023	Active	28,782,835	mxn	28,782,835	28,782,835		418307
SEF942	30/06/2023	Active	473,107	usd	473,107	473,107		406503
SEG025	30/06/2023	Active	473,107	usd	473,107	473,107		26492
SFF722	12/06/2023	Active	1,732,217	usd	1,732,217	1,732,217		406503
SFF750	12/06/2023	Active	1,732,217	usd	1,732,217	1,732,217		26492
SFU197	12/06/2023	Active	4,535,817	mxn	4,535,817	4,535,817		406503
SFU229	12/06/2023	Active	4,535,817	mxn	4,535,817	4,535,817		26492
SFU607	12/04/2023	Active	28,782,835	mxn	28,782,835	28,782,835		418307
SFU608	12/04/2023	Active	28,782,835	mxn	28,782,835	28,782,835		484237
SGH756	03/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SGH910	03/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SGM425	26/04/2023	Active	425,000,000	mxn	425,000,000	425,000,000		417963
SGN102	27/04/2023	Active	635,000,000	mxn	635,000,000	635,000,000		418307
SGP382	11/05/2023	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000		417963
SGP685	15/05/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		418307
SGP690	15/05/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		418307
SGR087	23/05/2023	Active	494,000,000	mxn	494,000,000	494,000,000		418307
SGR128	23/05/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SGR327	24/05/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SGU361	07/06/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SGU672	08/06/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000		417963
SGV166	12/06/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SGV586	14/06/2023	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000		417963
SGV992	16/06/2023	Active	1,900,000,000	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000		418307
SGX016	23/06/2023	Active	1,040,000,000	mxn	1,040,000,000	1,040,000,000		418307
SGX041	23/06/2023	Active	1,040,000,000	mxn	1,040,000,000	1,040,000,000		418307
SGX052	23/06/2023	Active	1,040,000,000	mxn	1,040,000,000	1,040,000,000		418307
SHB151	11/04/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000		417963
SHB222	12/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SHB225	12/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SHC292	18/04/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SHC582	20/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SHC672	20/04/2023	Active	890,000,000	mxn	890,000,000	890,000,000		417963
SHC800	21/04/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		417963
SHC834	24/04/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SHD823	01/05/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SHD958	12/04/2023	Active	60,511,951	mxn	60,511,951	60,511,951		406503
SHD959	12/04/2023	Active	60,511,951	mxn	60,511,951	60,511,951		484237
SHE405	04/05/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000		417963
SHE871	09/05/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000		417963
SHG368	19/05/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000		417963
SHH013	12/04/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000		406503
SHH055	12/04/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000		26492
SHH624	30/05/2023	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000		418307
SHK353	05/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		406503
SHK354	10/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		406503
SHK355	11/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		406503
SHK397	05/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		26492
SHK398	10/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		26492
SHK399	11/04/2023	Active	500,000	usd	500,000	500,000		26492
SHK871	03/04/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		418307
SHK872	03/04/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		418307
SHL076	27/06/2023	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000		417963
SHN855	04/04/2023	Active	18,411,017	mxn	18,411,017	18,411,017		406503
SHN856	04/04/2023	Active	18,411,017	mxn	18,411,017	18,411,017		26492
SHO124	27/04/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SHO305	15/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		406503
SHO306	16/05/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		406503
SHO308	22/05/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000		406503
SHO309	22/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		406503
SHO310	10/05/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000		406503
SHO311	11/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		406503
SHO313	12/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		406503



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SHO333	10/05/2023	Active	11,000,000	mxn	11,000,000	11,000,000		26492
SHO334	11/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		26492
SHO335	22/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		26492
SHO340	22/05/2023	Active	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000		26492
SHO346	16/05/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		26492
SHO347	15/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		26492
SHO348	12/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		26492
SHO353	19/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		406503
SHO360	19/05/2023	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000		26492
SHO819	16/05/2023	Active	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000		418307
SHO820	16/05/2023	Active	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000		418307
SHP345	14/04/2023	Active	11,046,610	mxn	11,046,610	11,046,610		406503
SHP363	14/04/2023	Active	11,046,610	mxn	11,046,610	11,046,610		26492
SHP373	05/05/2023	Active	700,000,000	mxn	700,000,000	700,000,000		417963
SHP375	05/05/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000		418307
SHP476	12/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		406503
SHP479	12/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		26492
SHP862	22/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		406503
SHP969	22/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		26492
SHQ132	24/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		406503
SHQ150	24/04/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000		26492
SHQ942	22/05/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000		418307
SHR315	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SHR324	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SHR419	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SHR431	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SHR573	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SHR587	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SHR664	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		406503
SHR667	15/05/2023	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000		26492
SHR963	12/04/2023	Active	2,720,000	mxn	2,720,000	2,720,000		406503
SHR971	12/04/2023	Active	2,720,000	mxn	2,720,000	2,720,000		26492
SHS460	05/06/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SHS558	05/06/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000		417963
SHS580	05/06/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SHT334	26/04/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000		406503
SHT335	26/04/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000		26492
SHU525	27/06/2023	Active	1,830,000,000	mxn	1,830,000,000	1,830,000,000		418307
SHU689	05/04/2023	Active	3,020,000,000	mxn	3,020,000,000	3,020,000,000		418307
SHU690	28/06/2023	Active	3,800,000,000	mxn	3,800,000,000	3,800,000,000		418307
SHX070	31/05/2023	Active	7,750,181	mxn	7,750,181	7,750,181		406503
SHX075	31/05/2023	Active	7,750,181	mxn	7,750,181	7,750,181		26492
SHY617	08/05/2023	Active	4,500,000	usd	4,500,000	4,500,000		406503
SHY623	07/06/2023	Active	1,480,000	mxn	1,480,000	1,480,000		406503
SHY624	08/05/2023	Active	4,500,000	usd	4,500,000	4,500,000		26492
SHY626	07/06/2023	Active	1,480,000	mxn	1,480,000	1,480,000		26492
SHY664	03/05/2023	Active	3,320,000,000	mxn	3,320,000,000	3,320,000,000		418307
SHZ709	30/06/2023	Active	8,609,729	mxn	8,609,729	8,609,729		406503
SHZ732	30/06/2023	Active	8,609,729	mxn	8,609,729	8,609,729		26492
SIA584	16/06/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000		406503
SIA641	16/06/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000		26492
SIA663	15/05/2023	Active	1,620,000,000	mxn	1,620,000,000	1,620,000,000		418307
SIB182	23/05/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000		406503
SIB198	23/05/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000		26492
SIB547	28/05/2023	Active	60,000,000	usd	60,000,000	60,000,000		418307
SIC130	28/06/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000		406503
SIC144	28/06/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000		26492
SID503	01/06/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000		417963
SID841	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SID850	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SID858	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIE085	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIE086	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIE087	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SIE251	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIE295	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIE616	16/05/2023	Active	46,250,000	usd	46,250,000	46,250,000		418307
SIE742	16/05/2023	Active	2,463,018	usd	2,463,018	2,463,018		418307
SIE750	16/05/2023	Active	2,463,018	usd	2,463,018	2,463,018		418307
SIF040	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIF046	13/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIF056	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIF083	07/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIF091	12/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		406503
SIF144	08/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIF148	13/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIF150	09/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIF152	07/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIF153	12/06/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000		26492
SIH156	20/06/2023	Active	3,600,000,000	mxn	3,600,000,000	3,600,000,000		418307
SIK104	12/05/2023	Active	50,610,817	usd	50,610,817	50,610,817		418307
SIK105	12/05/2023	Active	50,610,817	usd	50,610,817	50,610,817		418307

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2091840	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2091842	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2091848	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2091850	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2092584	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092586	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092587	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092588	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092590	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092591	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092592	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092594	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092595	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092596	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092598	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092599	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092600	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092602	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092603	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092604	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092606	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092607	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092608	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092610	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092611	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092848	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092850	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092851	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092852	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092854	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092855	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092856	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092858	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092859	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092860	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092862	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092863	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092864	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092866	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092867	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092868	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092870	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092871	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2092872	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092874	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2092875	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,256
2093611	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093613	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093614	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2093615	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093617	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093618	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093619	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093621	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093622	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093623	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093625	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093626	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093627	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093629	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093630	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093631	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093633	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093634	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093635	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093637	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093638	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093639	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093641	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093642	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093699	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093701	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093702	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093703	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093705	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093706	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093707	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093709	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093710	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093711	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093713	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093714	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093715	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093717	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093718	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093719	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093721	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093722	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093723	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093725	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093726	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2093727	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093729	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2093730	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,163
2094242	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094246	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094250	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094290	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094294	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094298	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2094810	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094812	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094814	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094816	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094818	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094826	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094828	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094830	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094832	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2094834	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2096199	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096201	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096202	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,965
2096203	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096205	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096206	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,965
2096235	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096237	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096238	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,965
2096239	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096241	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2096242	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,965
2096449	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2096451	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096452	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13.846
2096453	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096455	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096456	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13.846
2096557	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096559	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096560	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13.846
2096561	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096563	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2096564	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13.846
2097924	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097926	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097927	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097929	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097939	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097941	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097942	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2097944	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2098295	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098297	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098298	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098299	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098301	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098302	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098303	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098305	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098306	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098319	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098321	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098322	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098323	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098325	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098326	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098327	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098329	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2098330	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20.631
2098351	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098353	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098355	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098357	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098359	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098361	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2098375	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2098377	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2098378	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12.379
2098455	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098457	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098458	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	973
2098459	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098461	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098462	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	973
2098467	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098469	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098470	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	973
2098471	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098473	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25.000
2098474	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	973
2098491	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098493	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098494	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46.973
2098495	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098497	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098498	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46.973
2098499	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098501	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098502	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46.973
2098515	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098517	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098518	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46.973
2098519	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098521	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2098522	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46.973
2098523	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2098525	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2098526	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,973
2098555	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098557	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098558	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098559	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098561	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098562	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098563	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098565	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098566	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098567	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098569	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098570	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098571	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098573	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098574	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098595	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098597	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098598	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098599	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098601	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098602	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098603	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098605	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098606	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098607	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098609	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098610	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098611	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098613	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2098614	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,260
2098633	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098635	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098636	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098637	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098639	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098640	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098641	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098643	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098644	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098645	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098647	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098648	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098649	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098651	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098652	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098653	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098655	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098656	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,090
2098802	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098804	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098817	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098819	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098820	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098837	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098839	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098840	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098857	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098859	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2099004	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2099006	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2099007	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,927
2099008	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2099010	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2099011	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,927
2099024	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2099026	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2099027	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,902
2099028	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2099030	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2099031	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,902
2099372	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099374	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2099375	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099377	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099402	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099404	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099405	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099407	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099432	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099434	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099435	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099436	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099438	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099439	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099472	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099474	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099475	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099476	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099478	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099479	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099524	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099526	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099527	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099528	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099530	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099531	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099532	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099534	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099535	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099560	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099562	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099563	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099564	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099566	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099567	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099568	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099570	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099571	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099584	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099586	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099587	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099588	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099590	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099591	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099608	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099610	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099611	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099612	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099614	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099615	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099692	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099694	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099695	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099696	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099698	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099699	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099700	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099702	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099703	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099728	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099730	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099731	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099732	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099734	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099735	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099736	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099738	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099739	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2100132	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100134	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100135	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100137	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100138	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100140	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100162	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100164	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2100165	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100167	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100168	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100170	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100192	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100194	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100195	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100196	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100198	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100199	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100200	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100202	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100203	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100216	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100218	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100219	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100220	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100222	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100223	FX	03/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100224	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100226	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100227	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100309	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100311	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100312	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100313	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100315	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100316	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100317	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100319	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100320	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100345	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100347	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100348	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100349	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100351	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100352	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100353	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100355	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100356	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100369	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	196,116
2100370	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	196,116
2100373	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	196,116
2100374	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	196,116
2100386	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100388	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100389	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100391	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100392	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100394	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100404	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100406	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100407	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100409	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100410	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100412	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2100587	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100589	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100590	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,805
2100591	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100593	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100594	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,805
2100607	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100609	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100610	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,805
2100611	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100613	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2100614	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,805
2100628	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2100629	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2100630	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2100636	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2100637	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2100638	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2100912	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100914	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100915	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100916	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100918	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100919	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100920	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100922	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100923	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100924	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100926	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100927	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100928	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100930	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100931	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100932	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100934	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100935	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100960	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100962	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100963	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100964	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100966	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100967	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100968	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100970	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100971	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100972	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100974	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100975	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100976	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100978	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100979	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2100980	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100982	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100983	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,990
2101002	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101004	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101005	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101007	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101008	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101010	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101011	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101013	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101014	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101016	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101017	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101019	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101038	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101040	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101041	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101043	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101044	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101046	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101047	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101049	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101050	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101052	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101053	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101055	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101066	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101068	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101078	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101080	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101093	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101095	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101096	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,375
2101109	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101111	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2101112	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,375
2101119	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101121	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101122	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101124	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101131	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101133	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101134	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101136	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101143	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101145	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101146	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101148	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101149	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101151	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101152	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101154	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101155	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101157	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101158	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101160	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101191	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101193	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101194	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101196	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101206	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101208	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101218	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101220	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101242	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101246	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101250	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101286	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101290	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101294	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101323	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101325	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101327	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101335	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101337	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101339	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2101343	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2101345	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2101346	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2101348	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2101369	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101371	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101372	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101373	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101375	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101376	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101377	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101379	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101380	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101381	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101383	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101384	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101385	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101387	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101388	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101409	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101411	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101412	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101413	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101415	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101416	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101417	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101419	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101420	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101421	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101423	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101424	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101425	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101427	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101428	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,625
2101461	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101463	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101464	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101465	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101467	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101468	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101469	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101471	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101472	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101473	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101475	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101476	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101477	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101479	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101480	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101481	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101483	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101484	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101485	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101487	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101488	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101489	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101491	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101492	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101493	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101495	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101496	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101497	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101499	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2101500	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,816
2101505	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101507	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101508	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101509	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101511	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101512	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101513	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101515	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101516	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101529	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101531	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101532	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101533	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101535	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101536	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101537	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101539	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101540	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101553	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101555	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101556	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101557	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101559	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101560	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101561	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101563	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101564	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101577	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101579	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101580	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101581	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101583	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101584	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101585	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101587	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101588	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101605	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101607	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101608	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101609	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101611	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101612	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101613	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101615	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101616	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101633	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101635	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101636	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101637	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101639	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101640	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101641	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101643	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101644	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101657	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101659	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101660	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101661	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101663	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101664	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101665	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101667	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101668	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101681	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101683	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101684	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101685	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101687	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101688	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101689	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101691	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101692	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101701	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101703	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101704	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101705	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101707	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101708	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101709	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101711	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101712	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101713	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101715	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101716	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101717	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101719	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101720	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101721	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101723	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101724	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101797	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101798	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101799	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101800	FX	18/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101801	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101802	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101803	FX	08/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101804	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101805	FX	22/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101806	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101807	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101808	FX	04/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101809	FX	11/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101810	FX	18/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101811	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101812	FX	01/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101813	FX	08/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101814	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101815	FX	22/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101816	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2101889	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101891	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101892	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101894	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101895	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101897	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101898	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101900	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101901	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101903	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101904	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101906	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101907	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101909	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101910	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101912	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101913	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101915	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101916	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101918	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101919	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101921	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101922	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101924	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101925	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101927	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101928	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101930	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101931	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101933	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101934	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101936	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101937	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101939	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101940	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101942	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101943	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101945	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101946	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101948	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101949	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101951	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101952	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101954	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101955	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101957	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101958	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101960	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101961	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2101963	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2101964	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2101966	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2101967	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101969	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101970	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101971	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101973	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101974	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101975	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101977	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101978	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101979	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101981	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101982	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101983	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101985	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101986	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101987	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101989	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101990	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101991	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101993	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101994	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102007	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102009	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102010	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102011	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102013	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102014	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102015	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102017	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102018	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102019	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102021	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102022	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102023	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102025	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102026	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102027	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102029	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102030	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102031	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102033	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102034	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102047	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2102049	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2102050	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2102052	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2102134	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102136	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102137	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102139	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102140	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102142	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102143	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102145	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102146	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102148	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102149	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102151	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102152	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102154	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102155	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102157	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102158	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102160	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102161	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102163	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102164	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102166	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102167	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102169	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102170	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102172	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102209	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102211	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102212	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102214	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102215	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102217	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102218	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102220	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102221	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102223	FX	05/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102224	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102226	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102227	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102229	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102230	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102232	FX	25/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102233	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102235	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102236	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102238	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102239	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102241	FX	15/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102242	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102244	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102245	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102247	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102255	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102257	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102258	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,683
2102259	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102261	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102262	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,683
2102263	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102265	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102266	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,683
2102279	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102281	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102282	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3.683
2102283	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102285	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102286	FX	17/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3.683
2102287	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102289	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102290	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3.683
2102299	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102301	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102302	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102304	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102439	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102441	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102505	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102507	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2102571	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102573	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102574	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102576	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102577	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102579	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102580	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102582	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102661	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102663	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102664	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102666	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102667	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102669	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102670	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102672	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2102781	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102783	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102784	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102786	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102787	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102789	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102790	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102792	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102793	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102795	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102796	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102798	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102799	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102801	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102832	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102834	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102835	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102837	FX	05/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102838	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102840	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102841	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102843	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102844	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102846	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102847	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102849	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102850	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102852	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2102893	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875.000
2102895	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875.000
2102896	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	42.424
2102897	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875.000
2102899	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875.000
2102900	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	42.424
2102941	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63.000
2102943	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63.000
2102944	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3.055
2102945	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63.000
2102947	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63.000
2102948	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3.055
2102989	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.000
2102991	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102992	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	291
2102993	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2102995	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2102996	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	291
2103037	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2103039	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2103040	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,600
2103041	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2103043	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2103044	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,600
2103133	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2103135	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2103136	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,370
2103137	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2103139	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2103140	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,370
2103157	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103159	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103160	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103161	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103163	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103164	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103165	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103167	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103168	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103185	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103187	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103188	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103189	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103191	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103192	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103193	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103195	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103196	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,328
2103197	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2103199	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2103200	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2103202	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2103209	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103211	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103212	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103214	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103215	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103217	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103218	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103220	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103221	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103223	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103224	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103226	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103227	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103229	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103230	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103232	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103392	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103395	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103398	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103401	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103404	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103407	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103410	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103413	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103416	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103419	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103422	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103425	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103428	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103536	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103539	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103542	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103545	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103548	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103551	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103554	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103557	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103560	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103563	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103566	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103569	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103572	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103670	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103672	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103673	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103675	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103676	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103678	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103679	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103681	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2103714	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103716	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103717	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12.379
2103718	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103720	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103721	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7.902
2103722	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103724	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103725	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7.902
2103735	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103737	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103738	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103740	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2103765	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103767	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103768	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103769	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103771	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103772	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103773	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103775	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103776	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103777	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103779	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103780	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103781	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103783	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103784	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103785	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103787	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103788	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103789	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103791	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103792	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103793	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103795	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103796	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103797	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103799	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103800	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103801	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103803	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103804	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103845	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103847	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103848	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103849	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103851	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103852	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103853	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103855	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103856	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103857	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103859	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103860	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103861	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103863	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103864	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.557
2103865	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2103867	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103868	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,557
2103869	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103871	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103872	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,557
2103873	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103875	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103876	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,557
2103877	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103879	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103880	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,557
2103881	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103883	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103884	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,557
2103925	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103927	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103928	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103929	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103931	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103932	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103933	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103935	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103936	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103937	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103939	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103940	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103941	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103943	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103944	FX	19/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103945	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103947	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103948	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103949	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103951	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103952	FX	02/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103953	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103955	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103956	FX	09/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103957	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103959	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103960	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103961	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103963	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2103964	FX	23/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,114
2103981	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103983	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103984	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103986	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103987	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103989	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103990	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2103992	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104002	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104006	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104010	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104050	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104054	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104058	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104089	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104091	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104092	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104094	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104095	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104097	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104098	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104100	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104109	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104111	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104112	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104114	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104115	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104117	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104118	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104120	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104121	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104123	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104124	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104126	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104127	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104129	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104130	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104132	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2104133	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104135	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104136	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104138	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104139	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104141	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104142	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104144	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104145	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104147	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104148	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104150	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104163	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2104165	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2104166	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5.927
2104167	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2104169	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2104170	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5.927
2104183	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104185	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104186	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.944
2104191	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104193	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104194	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.944
2104247	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104249	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104250	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.944
2104255	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104257	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104258	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.944
2104330	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104332	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104333	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104335	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104336	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.000.000
2104338	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.000.000
2104339	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.000.000
2104341	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.000.000
2104342	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104344	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104345	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104347	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.000.000
2104360	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104362	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104363	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104365	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104366	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104368	FX	12/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104369	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104371	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2104372	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104374	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104375	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.077
2104376	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104378	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104379	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.077
2104380	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104382	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104383	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.077
2104384	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104386	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104387	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.077
2104420	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104422	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104423	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2.077
2104424	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2104426	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104427	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104428	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104430	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104431	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104432	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104434	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104435	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104492	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104494	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104495	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104496	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104498	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104499	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104500	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104502	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104503	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104504	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104506	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104507	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104508	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104510	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104511	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104512	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104514	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	977,000
2104515	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	38,219
2104540	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104542	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104543	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104544	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104546	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104547	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104548	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104550	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104551	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104552	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104554	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104555	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104556	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104558	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104559	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104560	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104562	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	875,000
2104563	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	34,229
2104588	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104590	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104591	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104592	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104594	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104595	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104596	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104598	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104599	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104600	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104602	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104603	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104604	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104606	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104607	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104608	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104610	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	63,000
2104611	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,465
2104636	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104638	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104639	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104640	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104642	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104643	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104644	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104646	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104647	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104648	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104650	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104651	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104652	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104654	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104655	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104658	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104658	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,000
2104659	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	235
2104684	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104686	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104687	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104688	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104690	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104691	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104692	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104694	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104695	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104696	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104698	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104699	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104700	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104702	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104703	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104704	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104706	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	33,000
2104707	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,291
2104716	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104718	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104719	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104720	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104722	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104723	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104728	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104730	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104731	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,842
2104732	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104734	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104735	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,842
2104736	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104738	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104739	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104764	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104766	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104767	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,842
2104768	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104770	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104771	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,842
2104772	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104774	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104775	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104796	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104798	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104799	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104801	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104802	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104804	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104805	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104807	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104808	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104810	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104811	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104813	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104832	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104834	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104835	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104837	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104838	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104840	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104841	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104843	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104844	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104846	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104847	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104849	FX	21/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104874	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2104876	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2104877	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104879	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2104881	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104882	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104883	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104884	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104886	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104887	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104888	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104890	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104891	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104892	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104894	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104895	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104896	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104898	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104899	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104900	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104902	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104903	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104904	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104906	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104907	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104908	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104910	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104911	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104912	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104914	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104915	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105057	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105058	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105059	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105060	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105062	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105063	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105064	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105066	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105067	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105068	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105070	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105071	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105072	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105074	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105075	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105076	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105078	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105079	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105080	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105082	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105083	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105084	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105086	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105087	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105088	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105090	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105091	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105232	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2105234	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2105235	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2105237	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2105239	FX	12/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105240	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105241	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105242	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105244	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105245	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105246	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105248	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105249	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105275	FX	12/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105276	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105277	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105278	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105280	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105281	FX	10/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105282	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105284	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105285	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.882
2105343	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105345	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105373	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105375	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2105536	FX	11/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105537	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105538	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105540	FX	18/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105541	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105542	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105544	FX	25/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105545	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105546	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105548	FX	02/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105549	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105550	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105551	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105553	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105554	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105555	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105557	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105558	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105560	FX	23/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105561	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105562	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105563	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105565	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105566	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105567	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105569	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105570	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105571	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105573	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105574	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11.290
2105575	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105577	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105578	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11.290
2105580	FX	11/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105581	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105582	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105584	FX	18/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105585	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105586	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105588	FX	25/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105589	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105590	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.761
2105592	FX	02/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105593	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105594	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105595	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105597	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105598	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105599	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105601	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105602	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.732
2105604	FX	23/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105605	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105606	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105607	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105609	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105610	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105611	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105613	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105614	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10.541
2105615	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105617	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105618	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11.290
2105619	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105621	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300.000
2105622	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11.290
2105708	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105709	FX	03/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105710	FX	03/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105712	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105713	FX	10/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105714	FX	10/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105716	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105717	FX	17/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105718	FX	17/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105720	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105721	FX	24/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105722	FX	24/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105724	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105725	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105726	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105728	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105729	FX	08/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105730	FX	08/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105732	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105736	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105737	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105738	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105740	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105744	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105748	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105749	FX	03/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105750	FX	03/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105752	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105753	FX	10/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105754	FX	10/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105756	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105757	FX	17/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105758	FX	17/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105760	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105761	FX	24/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105762	FX	24/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105764	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105765	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105766	FX	28/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105768	FX	08/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105769	FX	08/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105770	FX	08/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105772	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105776	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105777	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105778	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8.475
2105780	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105784	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150.000
2105841	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105844	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105847	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105850	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105853	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105856	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105859	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105862	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105865	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105868	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105871	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105874	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2105877	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106141	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106144	FX	11/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106147	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106150	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106153	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106156	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106159	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106162	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106165	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106168	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106171	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106174	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106177	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100.000
2106314	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106316	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106317	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106318	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106320	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106321	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106322	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106324	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106325	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106326	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106328	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106329	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106330	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106332	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106333	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106334	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106336	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106337	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106338	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106340	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106341	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,016
2106342	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106344	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106345	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,016
2106346	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106348	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106349	FX	02/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106350	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106352	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106353	FX	09/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106354	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106356	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106357	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,368
2106358	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106360	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106361	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106362	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106364	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106365	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106366	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106368	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106369	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,737
2106370	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106372	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106373	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,016
2106374	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106376	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106377	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,016
2106464	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106466	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106467	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106469	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106470	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106472	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106473	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106475	FX	23/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106476	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106478	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106479	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106481	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106484	FX	03/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106485	FX	03/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106486	FX	04/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106489	FX	05/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106490	FX	10/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106493	FX	11/04/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106494	FX	12/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106496	FX	13/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106498	FX	14/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106500	FX	17/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106502	FX	18/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106504	FX	19/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106506	FX	20/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106508	FX	21/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889
2106510	FX	24/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888,889

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106512	FX	25/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888.889
2106514	FX	26/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888.889
2106516	FX	27/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888.889
2106518	FX	28/04/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	888.889
2106582	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106584	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106585	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.630
2106586	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106588	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106589	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.630
2106618	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106620	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106621	FX	16/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.630
2106622	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106624	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50.000
2106625	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1.630
2106670	FX	17/05/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2106672	FX	07/06/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2106674	FX	17/05/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2106676	FX	07/06/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500.000
2106678	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2106679	FX	24/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2106680	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	979.000
2106682	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	430.000
2106684	FX	24/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2106685	FX	24/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200.000
2106686	FX	07/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	979.000
2106688	FX	14/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	430.000
2106708	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106710	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106711	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.956
2106712	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106714	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106715	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.819
2106716	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106718	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106719	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.812
2106720	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106722	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106723	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.812
2106740	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106742	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106743	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.956
2106744	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106746	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106747	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.819
2106748	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106750	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106751	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.812
2106752	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106754	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250.000
2106755	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6.812
2106772	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400.000
2106774	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400.000
2106775	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16.216
2106796	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400.000
2106798	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400.000
2106799	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16.216
2106878	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106880	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106881	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.516
2106883	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106884	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106885	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.516
2106886	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106888	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106889	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.516
2106890	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106892	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106893	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.516
2106894	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106896	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500
2106897	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4.516
2106898	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142.500

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106900	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106901	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106902	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106904	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106905	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106906	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106908	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106909	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106926	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106928	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106929	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106931	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106932	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106933	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106934	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106936	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106937	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106938	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106940	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106941	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106942	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106944	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106945	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106946	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106948	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106949	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106950	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106952	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106953	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106954	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106956	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106957	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106974	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106976	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106977	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106979	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106980	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106981	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106982	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106984	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106985	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106986	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106988	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106989	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106990	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106992	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106993	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106994	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106996	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2106997	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2106998	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107000	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107001	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107002	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107004	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107005	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107022	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107024	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107025	FX	15/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107027	FX	22/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107028	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107029	FX	22/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107030	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107032	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107033	FX	26/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107034	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107036	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107037	FX	05/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107038	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107040	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107041	FX	12/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107042	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107044	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107045	FX	16/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107046	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107048	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107049	FX	26/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107050	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107052	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107053	FX	30/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107136	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107138	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107139	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107141	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107142	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107144	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107145	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107147	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107148	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107150	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107157	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107159	FX	30/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107160	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107162	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107163	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107165	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107166	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107168	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107169	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107171	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107316	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107318	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107319	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107340	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107342	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107343	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107402	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107404	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107414	FX	31/05/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107416	FX	29/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107426	FX	25/05/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,000,000
2107525	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107529	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107533	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107537	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107573	FX	06/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107577	FX	13/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107581	FX	20/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107585	FX	27/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107690	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107692	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107693	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2107714	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107716	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107717	FX	28/06/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023033103112	BO	EURUSD	04/03/2023	3,000,000	1.09	(3,264,726)
2023033103113	BO	EURUSD	04/03/2023	500,000	1.09	(543,397)
2023033103009	S	EURMXN	04/04/2023	(1,800,000)	19.60	35,272,440
2023033103010	B	EURMXN	04/11/2023	1,800,000	19.63	(35,336,566)
2023041003672	BO	EURMXN	04/11/2023	2,000,000	19.75	(39,491,768)
2023041103207	BO	EURUSD	04/12/2023	2,000,000	1.09	(2,180,656)
2023032803636	BO	EURMXN	04/13/2023	141,285	19.85	(2,803,922)
2023041403216	S	EURMXN	04/17/2023	(25,000,000)	19.82	495,523,603
2022070603179	BO	EURUSD	04/21/2023	50,000	1.04	(52,009)
2023041103371	BO	EURMXN	04/26/2023	141,280	19.90	(2,811,435)
2023042403295	S	EURMXN	04/26/2023	(30,000)	19.87	596,064
2023042503648	BO	EURUSD	04/26/2023	4,000,000	1.10	(4,389,568)
2023042603590	B	EURUSD	04/27/2023	31,000,000	1.10	(34,206,082)
2023042603591	S	EURUSD	04/28/2023	(31,000,000)	1.10	34,207,880
2023042703680	B	EURMXN	05/02/2023	770,000	19.90	(15,324,617)
2023042703260	S	EURMXN	05/02/2023	(770,000)	19.91	15,329,545
2023051203081	BO	EURUSD	05/15/2023	2,000,000	1.09	(2,174,424)
2023051203687	BO	EURUSD	05/15/2023	9,000,000	1.09	(9,766,737)
2023041403217	B	EURMXN	05/17/2023	25,000,000	19.98	(499,540,275)
2023051503447	S	EURMXN	05/17/2023	(25,000,000)	19.06	476,615,000
2022070603180	BO	EURUSD	05/19/2023	50,000	1.04	(52,111)
2023052503009	BO	EURUSD	05/25/2023	1,800,000	1.07	(1,928,086)
2023042403296	B	EURMXN	05/26/2023	30,000	20.03	(600,853)
2023052403151	S	EURMXN	05/26/2023	(30,000)	19.16	574,785
2023060203008	B	EURUSD	06/06/2023	1,000,000	1.07	(1,074,840)
2023060203089	B	EURUSD	06/06/2023	1,000,000	1.07	(1,072,690)
2023060203153	B	EURUSD	06/06/2023	1,000,000	1.07	(1,072,960)
2023060203178	B	EURUSD	06/06/2023	1,000,000	1.07	(1,072,500)
2023060203048	S	EURUSD	06/06/2023	(1,000,000)	1.07	1,073,520
2023060203125	S	EURUSD	06/06/2023	(1,000,000)	1.07	1,072,210
2023060203133	S	EURUSD	06/06/2023	(1,000,000)	1.07	1,072,520
2023060203248	S	EURUSD	06/06/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,500
2023060503003	B	EURUSD	06/07/2023	1,000,000	1.07	(1,068,350)
2023060503059	B	EURUSD	06/07/2023	1,000,000	1.07	(1,072,200)
2023060503126	B	EURUSD	06/07/2023	1,000,000	1.07	(1,071,310)
2023060503129	B	EURUSD	06/07/2023	1,000,000	1.07	(1,070,640)
2023060503293	B	EURUSD	06/07/2023	1,000,000	1.07	(1,071,000)
2023060503047	S	EURUSD	06/07/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,360
2023060503058	S	EURUSD	06/07/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,860
2023060503064	S	EURUSD	06/07/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,820
2023060503142	S	EURUSD	06/07/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,260
2023060503216	S	EURUSD	06/07/2023	(1,000,000)	1.07	1,071,550
2023060603382	S	EURMXN	06/07/2023	(30,000)	18.60	558,134
2023060603209	B	EURUSD	06/08/2023	1,000,000	1.07	(1,069,590)
2023060603110	S	EURUSD	06/08/2023	(1,000,000)	1.07	1,068,540
2023060703101	B	EURUSD	06/09/2023	1,000,000	1.07	(1,070,920)
2023060703103	B	EURUSD	06/09/2023	1,000,000	1.07	(1,070,680)
2023060703134	B	EURUSD	06/09/2023	1,000,000	1.07	(1,070,530)
2023060703141	B	EURUSD	06/09/2023	1,000,000	1.07	(1,070,900)
2023060703115	S	EURUSD	06/09/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,210
2023060703138	S	EURUSD	06/09/2023	(3,000,000)	1.07	3,213,000
2023060803568	BO	EURUSD	06/09/2023	5,000,000	1.08	(5,386,155)
2023060803087	B	EURUSD	06/12/2023	1,000,000	1.08	(1,077,040)
2023060803492	B	EURUSD	06/12/2023	1,000,000	1.08	(1,077,940)
2023060803516	B	EURUSD	06/12/2023	1,000,000	1.08	(1,077,750)
2023060803068	S	EURUSD	06/12/2023	(1,000,000)	1.08	1,077,170
2023060803135	S	EURUSD	06/12/2023	(1,000,000)	1.08	1,077,740
2023060803203	S	EURUSD	06/12/2023	(1,000,000)	1.08	1,077,920
2023061203063	BO	EURUSD	06/12/2023	2,000,000	1.07	(2,149,976)
2023060903041	B	EURUSD	06/13/2023	1,000,000	1.08	(1,077,230)
2023060903097	B	EURUSD	06/13/2023	1,000,000	1.08	(1,075,520)
2023060903108	B	EURUSD	06/13/2023	1,000,000	1.08	(1,075,620)
2023060903109	B	EURUSD	06/13/2023	1,000,000	1.08	(1,075,600)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060903094	S	EURUSD	06/13/2023	(1,000,000)	1.08	1,076,360
2023060903101	S	EURUSD	06/13/2023	(1,000,000)	1.08	1,075,810
2023060903121	S	EURUSD	06/13/2023	(1,000,000)	1.08	1,075,620
2023060903123	S	EURUSD	06/13/2023	(1,000,000)	1.08	1,075,620
2023061203137	B	EURUSD	06/14/2023	1,000,000	1.07	(1,074,680)
2023061203325	S	EURUSD	06/14/2023	(1,000,000)	1.07	1,074,740
2022070603181	BO	EURUSD	06/15/2023	238,000	1.04	(248,498)
2023061503153	B	EURUSD	06/20/2023	1,000,000	1.09	(1,092,500)
2023061503154	B	EURUSD	06/20/2023	1,000,000	1.09	(1,092,500)
2023061503155	B	EURUSD	06/20/2023	1,000,000	1.09	(1,092,480)
2023061503113	S	EURUSD	06/20/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,270
2023061503114	S	EURUSD	06/20/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,230
2023061503123	S	EURUSD	06/20/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,170
2023062003209	B	EURUSD	06/22/2023	1,000,000	1.09	(1,090,010)
2023062003213	B	EURUSD	06/22/2023	1,000,000	1.09	(1,090,060)
2023062003265	S	EURUSD	06/22/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,500
2023062003267	S	EURUSD	06/22/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,520
2023052403152	B	EURMXN	06/26/2023	30,000	19.33	(579,953)
2023062303396	B	EURUSD	06/27/2023	1,000,000	1.09	(1,089,270)
2023062303237	S	EURUSD	06/27/2023	(1,000,000)	1.09	1,088,550
2023062603150	B	EURUSD	06/28/2023	1,000,000	1.09	(1,091,290)
2023062603203	B	EURUSD	06/28/2023	1,000,000	1.09	(1,091,010)
2023062603135	S	EURUSD	06/28/2023	(1,000,000)	1.09	1,090,740
2023062603234	S	EURUSD	06/28/2023	(1,000,000)	1.09	1,090,130
2023062703292	B	EURUSD	06/29/2023	1,000,000	1.10	(1,096,000)
2023062703258	S	EURUSD	06/29/2023	(1,000,000)	1.10	1,096,300
2023062803029	B	EURUSD	06/30/2023	1,000,000	1.09	(1,091,860)
2023062803094	B	EURUSD	06/30/2023	1,000,000	1.09	(1,091,920)
2023062803033	S	EURUSD	06/30/2023	(1,000,000)	1.09	1,092,800
2023062803097	S	EURUSD	06/30/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,400
2023042503647	BO	GBPUSD	04/26/2023	5,700,000	1.24	(7,074,167)
2023040403039	BO	JPYMXN	04/05/2023	10,000,000	0.14	(1,367,780)
2022052703777	BO	USDMXN	04/03/2023	880,000	20.85	(18,347,439)
2022053103022	SO	USDMXN	04/03/2023	(1,450)	20.81	30,176
2023011303852	BO	USDMXN	04/03/2023	50,000	19.02	(950,955)
2023011703707	BO	USDMXN	04/03/2023	20,000	18.98	(379,520)
2023020103708	BO	USDMXN	04/03/2023	1,000,000	18.83	(18,833,110)
2023030103313	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.33	(10,054,857)
2023030103466	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.23	(9,999,841)
2023030203444	B	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.22	(9,992,874)
2023030203548	B	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.21	(9,985,092)
2023030603411	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.08	(9,914,628)
2023030603465	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.09	(9,918,026)
2023030703561	BO	USDMXN	04/03/2023	550,000	18.21	(10,017,452)
2023030703591	SO	USDMXN	04/03/2023	(1,600)	18.21	29,138
2023030803195	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.06	(9,904,109)
2023030903545	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.17	(9,966,285)
2023031003322	B	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.42	(10,103,249)
2023031003799	B	USDMXN	04/03/2023	548,400	18.56	(10,175,929)
2023031503451	BO	USDMXN	04/03/2023	548,400	19.00	(10,419,726)
2023031503434	SO	USDMXN	04/03/2023	(402,000)	19.09	7,673,928
2023033003392	B	USDMXN	04/03/2023	2,000,000	18.10	(36,200,000)
2023033003394	B	USDMXN	04/03/2023	1,000,000	18.10	(18,101,400)
2023033003625	B	USDMXN	04/03/2023	244,000	18.10	(4,416,742)
2023033003631	B	USDMXN	04/03/2023	2,463,922	18.11	(44,616,200)
2023033003634	B	USDMXN	04/03/2023	2,137,531	18.11	(38,713,038)
2023033003043	S	USDMXN	04/03/2023	(190,000,000)	18.15	3,448,500,000
2023033003398	S	USDMXN	04/03/2023	(3,000,000)	18.10	54,294,900
2023033003578	S	USDMXN	04/03/2023	(200,000)	18.11	3,622,180
2023033003595	S	USDMXN	04/03/2023	(250,000)	18.12	4,529,130
2023033103090	B	USDMXN	04/03/2023	50,000,000	18.02	(901,000,000)
2023033103100	B	USDMXN	04/03/2023	30,000,000	18.02	(540,485,400)
2023033103151	B	USDMXN	04/03/2023	83,203,905	18.03	(1,500,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052703814	BO	USDMXN	04/04/2023	109,819	20.84	(2,288,421)
2022053003445	BO	USDMXN	04/04/2023	768,733	20.74	(15,947,344)
2022060603107	BO	USDMXN	04/04/2023	131,782	20.68	(2,725,468)
2022062403438	B	USDMXN	04/04/2023	219,636	21.04	(4,620,738)
2022062703027	BO	USDMXN	04/04/2023	109,818	20.95	(2,301,178)
2022081003641	BO	USDMXN	04/04/2023	101,415	20.89	(2,118,111)
2022081003650	BO	USDMXN	04/04/2023	101,415	20.82	(2,111,608)
2022081203462	BO	USDMXN	04/04/2023	101,415	20.75	(2,104,062)
2022082403498	BO	USDMXN	04/04/2023	893,219	20.83	(18,602,719)
2022091203098	B	USDMXN	04/04/2023	1,572,877	20.56	(32,332,871)
2022092003110	BO	USDMXN	04/04/2023	2,700,000	20.72	(55,940,555)
2022111003560	B	USDMXN	04/04/2023	2,500,000	19.91	(49,772,285)
2022122303346	BO	USDMXN	04/04/2023	2,300,000	19.77	(45,476,525)
2023010603724	BO	USDMXN	04/04/2023	370,240	19.46	(7,203,203)
2023010603766	SO	USDMXN	04/04/2023	(240)	19.42	4,662
2023011103362	BO	USDMXN	04/04/2023	40,000	19.30	(772,178)
2023011203118	B	USDMXN	04/04/2023	2,953,101	19.18	(56,635,643)
2023011703710	BO	USDMXN	04/04/2023	30,000	18.98	(569,308)
2023013103793	B	USDMXN	04/04/2023	5,000,000	19.05	(95,248,930)
2023030903343	SO	USDMXN	04/04/2023	(220,000)	18.17	3,996,892
2023030903549	SO	USDMXN	04/04/2023	(185)	18.14	3,365
2023031003049	SO	USDMXN	04/04/2023	(150,000)	18.50	2,774,852
2023031003462	SO	USDMXN	04/04/2023	(2,621)	18.47	48,391
2023031303248	SO	USDMXN	04/04/2023	(245,500)	18.84	4,625,549
2023031503660	SO	USDMXN	04/04/2023	(9)	19.03	177
2023031603521	S	USDMXN	04/04/2023	(50,000,000)	18.86	942,867,550
2023031703530	SO	USDMXN	04/04/2023	(354,000)	18.96	6,712,507
2023033103091	S	USDMXN	04/04/2023	(50,000,000)	18.02	901,185,000
2023033103101	S	USDMXN	04/04/2023	(30,000,000)	18.02	540,597,000
2023033103152	S	USDMXN	04/04/2023	(83,186,601)	18.03	1,500,000,000
2023033103153	S	USDMXN	04/04/2023	(17,304)	18.04	312,246
2023033103530	S	USDMXN	04/04/2023	(56,000,000)	18.06	1,011,360,000
2023033103548	S	USDMXN	04/04/2023	(20,000,000)	18.06	361,200,000
2023033103643	S	USDMXN	04/04/2023	(4,450,000)	18.03	80,233,500
2023033103691	S	USDMXN	04/04/2023	(4,000,000)	18.02	72,080,000
2023040303077	B	USDMXN	04/04/2023	100,000,000	18.03	(1,803,000,000)
2022040803474	BO	USDMXN	04/05/2023	500	21.45	(10,724)
2022040803264	SO	USDMXN	04/05/2023	(159,000)	21.49	3,416,994
2022040803468	SO	USDMXN	04/05/2023	(250)	21.43	5,358
2022060203393	BO	USDMXN	04/05/2023	55,000	20.78	(1,143,023)
2022110303433	B	USDMXN	04/05/2023	34,228	20.24	(692,643)
2022112303210	B	USDMXN	04/05/2023	1,100,000	19.84	(21,824,420)
2022112903191	BO	USDMXN	04/05/2023	2,000,000	19.61	(39,213,754)
2022113003404	B	USDMXN	04/05/2023	1,721,804	19.82	(34,121,702)
2022122803060	B	USDMXN	04/05/2023	700,000	19.81	(13,863,576)
2023011003386	B	USDMXN	04/05/2023	60,000	19.37	(1,162,203)
2023011303680	B	USDMXN	04/05/2023	977,000	19.03	(18,588,338)
2023011703711	BO	USDMXN	04/05/2023	20,000	18.98	(379,613)
2023012403614	B	USDMXN	04/05/2023	166,320	19.05	(3,168,323)
2023021003654	BO	USDMXN	04/05/2023	60,000	18.87	(1,132,479)
2023021403667	B	USDMXN	04/05/2023	977,000	18.70	(18,266,653)
2023021703656	BO	USDMXN	04/05/2023	60,000	18.52	(1,111,224)
2023022003318	BO	USDMXN	04/05/2023	60,000	18.54	(1,112,694)
2023022703460	BO	USDMXN	04/05/2023	42,800	18.53	(793,294)
2023022803711	BO	USDMXN	04/05/2023	22,000	18.45	(405,864)
2023022803836	BO	USDMXN	04/05/2023	60,000	18.42	(1,105,233)
2023030203530	BO	USDMXN	04/05/2023	70,750	18.21	(1,288,180)
2023030203689	BO	USDMXN	04/05/2023	231,000	18.23	(4,210,595)
2023030203690	BO	USDMXN	04/05/2023	800	18.24	(14,590)
2023030603349	BO	USDMXN	04/05/2023	68,950	18.11	(1,248,776)
2023030603469	BO	USDMXN	04/05/2023	39,400	18.09	(712,834)
2023031003548	B	USDMXN	04/05/2023	50,000,000	18.52	(926,050,500)
2023031003072	SO	USDMXN	04/05/2023	(190,000)	18.45	3,505,031

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023031003244	SO	USDMXN	04/05/2023	(150,000)	18.50	2,775,528
2023031003464	SO	USDMXN	04/05/2023	(2,656)	18.47	49,049
2023031303250	SO	USDMXN	04/05/2023	(240,000)	18.85	4,523,326
2023031303340	SO	USDMXN	04/05/2023	(659)	18.93	12,477
2023031603277	S	USDMXN	04/05/2023	(5,000,000)	18.96	94,806,760
2023031703674	S	USDMXN	04/05/2023	(1,000,000)	18.96	18,964,764
2023032203259	B	USDMXN	04/05/2023	144,000	18.58	(2,674,852)
2023032303617	B	USDMXN	04/05/2023	521,960	18.68	(9,748,803)
2023032403216	BO	USDMXN	04/05/2023	70,000	18.54	(1,298,126)
2023032403352	B	USDMXN	04/05/2023	74,465	18.51	(1,378,485)
2023032703248	BO	USDMXN	04/05/2023	66,272	18.41	(1,219,919)
2023032703563	B	USDMXN	04/05/2023	130,564	18.38	(2,399,842)
2023032803595	BO	USDMXN	04/05/2023	33,024	18.25	(602,758)
2023032903278	BO	USDMXN	04/05/2023	60,790	18.13	(1,102,255)
2023032903280	BO	USDMXN	04/05/2023	38,456	18.12	(696,899)
2023040303078	S	USDMXN	04/05/2023	(100,000,000)	18.03	1,803,360,000
2023040303168	S	USDMXN	04/05/2023	(888,889)	18.13	16,111,378
2023040303264	S	USDMXN	04/05/2023	(5,000,000)	18.13	90,630,000
2023040303348	S	USDMXN	04/05/2023	(500,000)	18.10	9,050,050
2023040303480	S	USDMXN	04/05/2023	(4,520,382)	18.11	81,873,157
2022091403253	BO	USDMXN	04/10/2023	200,000	20.70	(4,139,482)
2022111003747	BO	USDMXN	04/10/2023	150,000	19.87	(2,980,803)
2023010603595	B	USDMXN	04/10/2023	150,000	19.45	(2,917,959)
2023012403191	BO	USDMXN	04/10/2023	10,000	19.06	(190,595)
2023021003474	BO	USDMXN	04/10/2023	250,000	18.88	(4,720,235)
2023021403247	B	USDMXN	04/10/2023	125,000	18.75	(2,343,459)
2023031003460	SO	USDMXN	04/10/2023	(344,546)	18.49	6,369,138
2023031303339	BO	USDMXN	04/10/2023	166	18.97	(3,142)
2023031303638	BO	USDMXN	04/10/2023	935	19.09	(17,847)
2023031303254	SO	USDMXN	04/10/2023	(35,000)	18.86	660,106
2023031303528	SO	USDMXN	04/10/2023	(210,000)	18.95	3,979,475
2023031703453	SO	USDMXN	04/10/2023	(341,000)	18.94	6,459,171
2023032203471	B	USDMXN	04/10/2023	110,000	18.53	(2,038,298)
2023032203678	S	USDMXN	04/10/2023	(337,000)	18.70	6,300,647
2023032903534	BO	USDMXN	04/10/2023	50,000	18.12	(906,235)
2023033103543	BO	USDMXN	04/10/2023	56,000,000	18.08	(1,012,597,600)
2023040303170	S	USDMXN	04/10/2023	(888,889)	18.14	16,126,924
2023040403378	S	USDMXN	04/10/2023	(300,000)	18.11	5,433,480
2023040403483	S	USDMXN	04/10/2023	(1,464,641)	18.12	26,542,949
2023040403485	S	USDMXN	04/10/2023	(360,655)	18.12	6,535,936
2023040403487	S	USDMXN	04/10/2023	(386,378)	18.12	7,001,818
2023040403553	S	USDMXN	04/10/2023	(707,000)	18.14	12,824,181
2022052703815	BO	USDMXN	04/11/2023	109,819	20.87	(2,291,580)
2022053003446	BO	USDMXN	04/11/2023	768,733	20.77	(15,969,875)
2022060603108	BO	USDMXN	04/11/2023	131,782	20.71	(2,729,122)
2022062403440	B	USDMXN	04/11/2023	219,636	21.07	(4,626,764)
2022062703029	BO	USDMXN	04/11/2023	109,818	20.98	(2,304,310)
2022081003642	BO	USDMXN	04/11/2023	101,415	20.91	(2,120,829)
2022081003653	BO	USDMXN	04/11/2023	101,415	20.85	(2,114,313)
2022081203463	BO	USDMXN	04/11/2023	101,415	20.77	(2,106,783)
2022082403499	BO	USDMXN	04/11/2023	893,219	20.85	(18,627,628)
2023010603723	BO	USDMXN	04/11/2023	540,350	19.48	(10,526,675)
2023010603768	SO	USDMXN	04/11/2023	(350)	19.45	6,808
2023011103364	BO	USDMXN	04/11/2023	40,000	19.33	(773,205)
2023011103516	BO	USDMXN	04/11/2023	200,000	19.26	(3,852,474)
2023011203113	B	USDMXN	04/11/2023	2,953,101	19.20	(56,708,328)
2023012403192	BO	USDMXN	04/11/2023	10,000	19.06	(190,634)
2023031003450	SO	USDMXN	04/11/2023	(300,000)	18.48	5,544,114
2023031003453	SO	USDMXN	04/11/2023	(68,000)	18.48	1,256,648
2023031003463	SO	USDMXN	04/11/2023	(669)	18.49	12,372
2023031303530	SO	USDMXN	04/11/2023	(210,000)	18.95	3,979,126
2023031303639	SO	USDMXN	04/11/2023	(8,923)	19.08	170,209
2023032303485	SO	USDMXN	04/11/2023	(361,000)	18.66	6,735,996

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023040303349	B	USDMXN	04/11/2023	500.000	18.12	(9,061,044)
2023040303173	S	USDMXN	04/11/2023	(888,889)	18.14	16,124,622
2023041003001	B	USDMXN	04/11/2023	1,500.000	18.24	(27,360,662)
2023041003185	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,200
2023041003188	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,246
2023041003190	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,200
2023041003192	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,108
2023041003194	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,138
2023041003196	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,200
2023041003198	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,215
2023041003200	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,338
2023041003202	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,477
2023041003204	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,477
2023041003206	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,431
2023041003208	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.16	2,793,385
2023041003212	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,277
2023041003214	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,200
2023041003216	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,600
2023041003219	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,661
2023041003221	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,708
2023041003223	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,754
2023041003225	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,738
2023041003227	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,754
2023041003229	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,800
2023041003231	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,861
2023041003233	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,661
2023041003236	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,677
2023041003238	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,677
2023041003240	S	USDMXN	04/11/2023	(153,846)	18.15	2,792,692
2022060103109	SO	USDMXN	04/12/2023	(290,214)	21.02	6,100,955
2022060703172	SO	USDMXN	04/12/2023	(293,043)	20.82	6,099,778
2022062903538	SO	USDMXN	04/12/2023	(280,000)	21.28	5,957,814
2022062903541	SO	USDMXN	04/12/2023	(11,175)	21.28	237,798
2022070503257	SO	USDMXN	04/12/2023	(285,886)	21.69	6,200,993
2022112303611	B	USDMXN	04/12/2023	2,000.000	19.84	(39,681,046)
2022121403438	SO	USDMXN	04/12/2023	(210,000)	20.10	4,219,962
2022121403472	SO	USDMXN	04/12/2023	(88,589)	20.16	1,786,031
2023011303682	B	USDMXN	04/12/2023	977.000	19.06	(18,617,342)
2023013103608	B	USDMXN	04/12/2023	35,000.000	19.06	(667,250,885)
2023021003311	BO	USDMXN	04/12/2023	84,596	18.95	(1,603,115)
2023021003326	BO	USDMXN	04/12/2023	1,588	18.89	(29,993)
2023021403669	B	USDMXN	04/12/2023	977,000	18.72	(18,292,881)
2023021603260	BO	USDMXN	04/12/2023	63,600	18.79	(1,195,083)
2023022703461	BO	USDMXN	04/12/2023	34,000	18.56	(631,041)
2023022703462	BO	USDMXN	04/12/2023	8,800	18.55	(163,226)
2023022803804	BO	USDMXN	04/12/2023	77,400	18.44	(1,427,093)
2023022803832	BO	USDMXN	04/12/2023	100,000	18.44	(1,844,317)
2023030303598	BO	USDMXN	04/12/2023	134,400	18.09	(2,431,535)
2023030603470	BO	USDMXN	04/12/2023	116,600	18.12	(2,112,375)
2023030703362	BO	USDMXN	04/12/2023	28,100	18.21	(511,692)
2023030803585	BO	USDMXN	04/12/2023	21,600	18.10	(390,918)
2023031003507	BO	USDMXN	04/12/2023	65,100	18.55	(1,207,578)
2023031003671	SO	USDMXN	04/12/2023	(200,000)	18.57	3,713,964
2023031003794	SO	USDMXN	04/12/2023	(6,471)	18.58	120,246
2023031303705	BO	USDMXN	04/12/2023	21,400	19.06	(407,784)
2023031303109	SO	USDMXN	04/12/2023	(180,000)	18.93	3,407,707
2023031303338	SO	USDMXN	04/12/2023	(823)	18.96	15,604
2023031303676	SO	USDMXN	04/12/2023	(91,000)	19.07	1,735,327
2023031303701	SO	USDMXN	04/12/2023	(289)	19.03	5,502
2023032703557	BO	USDMXN	04/12/2023	64,000	18.41	(1,178,383)
2023032803589	BO	USDMXN	04/12/2023	82,400	18.28	(1,506,301)
2023032903271	BO	USDMXN	04/12/2023	105,610	18.16	(1,917,834)
2023033103842	BO	USDMXN	04/12/2023	128,670	18.06	(2,323,254)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023040303175	S	USDMXN	04/12/2023	(888,889)	18.14	16,128,018
2023041003553	B	USDMXN	04/12/2023	397,000	18.15	(7,205,828)
2023041003556	B	USDMXN	04/12/2023	97,000	18.15	(1,760,870)
2023041003559	B	USDMXN	04/12/2023	265,000	18.15	(4,810,174)
2023041003563	B	USDMXN	04/12/2023	258,000	18.15	(4,683,139)
2022052403446	S	USDMXN	04/13/2023	(358,051)	21.14	7,570,431
2022060703173	SO	USDMXN	04/13/2023	(365,086)	20.82	7,600,790
2022061403362	SO	USDMXN	04/13/2023	(340,000)	21.94	7,457,948
2022061403363	SO	USDMXN	04/13/2023	(6,510)	21.89	142,493
2022062103363	SO	USDMXN	04/13/2023	(354,000)	21.43	7,584,735
2022062103364	SO	USDMXN	04/13/2023	(775)	21.40	16,597
2022102503669	B	USDMXN	04/13/2023	2,436,766	20.52	(49,999,569)
2022110303435	B	USDMXN	04/13/2023	34,228	20.27	(693,701)
2022111003748	BO	USDMXN	04/13/2023	150,000	19.88	(2,982,473)
2022113003406	B	USDMXN	04/13/2023	1,721,804	19.85	(34,174,728)
2023010303397	B	USDMXN	04/13/2023	3,565,688	19.76	(70,445,995)
2023010603611	B	USDMXN	04/13/2023	150,000	19.48	(2,922,394)
2023011703695	B	USDMXN	04/13/2023	1,595,103	18.99	(30,297,093)
2023012303254	BO	USDMXN	04/13/2023	70,000	19.09	(1,336,629)
2023021003655	BO	USDMXN	04/13/2023	60,000	18.90	(1,134,245)
2023021403398	BO	USDMXN	04/13/2023	100,000	18.73	(1,872,813)
2023021603528	S	USDMXN	04/13/2023	(200,000)	18.67	3,734,012
2023021603532	S	USDMXN	04/13/2023	(1,399,938)	18.67	26,137,507
2023021703657	BO	USDMXN	04/13/2023	60,000	18.55	(1,112,950)
2023022003319	BO	USDMXN	04/13/2023	60,000	18.57	(1,114,433)
2023022303698	SO	USDMXN	04/13/2023	(598,054)	18.54	11,086,693
2023022803835	BO	USDMXN	04/13/2023	60,000	18.45	(1,107,026)
2023030203508	B	USDMXN	04/13/2023	200,000	18.23	(3,645,536)
2023030303407	BO	USDMXN	04/13/2023	60,000	18.15	(1,089,099)
2023031303110	SO	USDMXN	04/13/2023	(340,000)	18.92	6,432,311
2023031303337	SO	USDMXN	04/13/2023	(1,511)	18.96	28,658
2023031403446	SO	USDMXN	04/13/2023	(100,000)	19.23	1,922,597
2023031503658	BO	USDMXN	04/13/2023	655	19.09	(12,510)
2023031503611	SO	USDMXN	04/13/2023	(132,000)	19.08	2,518,045
2023032103393	S	USDMXN	04/13/2023	(100,000)	18.75	1,875,059
2023032103479	S	USDMXN	04/13/2023	(3,603,835)	18.73	67,483,899
2023032103488	S	USDMXN	04/13/2023	(2,487,924)	18.72	46,583,639
2023032303488	B	USDMXN	04/13/2023	319,568	18.68	(5,968,561)
2023032703558	BO	USDMXN	04/13/2023	16,297	18.42	(300,126)
2023033003579	B	USDMXN	04/13/2023	200,000	18.15	(3,629,920)
2023033003632	S	USDMXN	04/13/2023	(2,463,922)	18.14	44,707,011
2023033103549	B	USDMXN	04/13/2023	20,000,000	18.09	(361,850,000)
2023040303178	S	USDMXN	04/13/2023	(888,889)	18.15	16,131,958
2022013103100	B	USDMXN	04/14/2023	668,280	22.46	(15,008,352)
2022030703253	SO	USDMXN	04/14/2023	(100,000)	22.76	2,275,892
2022032403643	B	USDMXN	04/14/2023	637,235	21.65	(13,798,326)
2022041303527	SO	USDMXN	04/14/2023	(158,750)	21.14	3,356,206
2022051703190	BO	USDMXN	04/14/2023	3,200,000	21.33	(68,260,227)
2022101303273	BO	USDMXN	04/14/2023	200,000	20.66	(4,132,634)
2022110703299	B	USDMXN	04/14/2023	250,000	20.03	(5,007,447)
2022110703617	BO	USDMXN	04/14/2023	100,000	20.03	(2,003,437)
2022111603487	BO	USDMXN	04/14/2023	1,000,000	19.84	(19,842,498)
2023011803542	BO	USDMXN	04/14/2023	25,000	19.13	(478,191)
2023012303255	BO	USDMXN	04/14/2023	30,000	19.10	(572,950)
2023012403193	BO	USDMXN	04/14/2023	80,000	19.07	(1,525,933)
2023013003607	BO	USDMXN	04/14/2023	500,000	19.02	(9,511,049)
2023020203495	B	USDMXN	04/14/2023	300,000	18.90	(5,669,527)
2023031003601	SO	USDMXN	04/14/2023	(175,000)	18.62	3,258,393
2023031403090	SO	USDMXN	04/14/2023	(175,000)	19.21	3,361,422
2023031503659	BO	USDMXN	04/14/2023	31	19.09	(586)
2023031503612	SO	USDMXN	04/14/2023	(115,000)	19.08	2,193,703
2023040303181	S	USDMXN	04/14/2023	(888,889)	18.15	16,136,085
2023041003002	S	USDMXN	04/14/2023	(1,500,000)	18.25	27,377,894

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110403374	BO	USDMXN	04/17/2023	284.000	20.12	(5,715,438)
2022110403591	BO	USDMXN	04/17/2023	447	20.14	(9,004)
2022111003691	BO	USDMXN	04/17/2023	500.000	19.92	(9,958,135)
2022111003705	SO	USDMXN	04/17/2023	(867)	19.89	17,248
2023012503190	BO	USDMXN	04/17/2023	60.000	19.07	(1,144,029)
2023020103624	BO	USDMXN	04/17/2023	10.000	19.03	(190,300)
2023031603345	SO	USDMXN	04/17/2023	(350,000)	18.92	6,621,038
2023031603430	SO	USDMXN	04/17/2023	(126,679)	18.97	2,402,472
2023032903176	B	USDMXN	04/17/2023	5,230,309	18.18	(95,107,439)
2023032903492	S	USDMXN	04/17/2023	(240,000)	18.16	4,359,396
2023040303183	S	USDMXN	04/17/2023	(888,889)	18.16	16,145,870
2023041303548	B	USDMXN	04/17/2023	1,000,000	18.02	(18,020,000)
2023041303550	B	USDMXN	04/17/2023	10,000,000	18.02	(180,209,000)
2023041303614	B	USDMXN	04/17/2023	1,000,000	18.01	(18,010,000)
2023041303247	S	USDMXN	04/17/2023	(222,242)	18.03	4,005,979
2023041303249	S	USDMXN	04/17/2023	(230,604)	18.02	4,156,495
2023041303251	S	USDMXN	04/17/2023	(249,363)	18.02	4,494,519
2023041303253	S	USDMXN	04/17/2023	(254,723)	18.02	4,590,745
2023041303256	S	USDMXN	04/17/2023	(236,535)	18.02	4,262,881
2023041303258	S	USDMXN	04/17/2023	(218,389)	18.02	3,935,457
2023041303260	S	USDMXN	04/17/2023	(244,668)	18.02	4,408,991
2023041303262	S	USDMXN	04/17/2023	(236,090)	18.02	4,254,696
2023041303266	S	USDMXN	04/17/2023	(256,446)	18.02	4,622,260
2023041303269	S	USDMXN	04/17/2023	(244,880)	18.02	4,413,742
2023041303429	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	17.99	35,980,000
2023041303439	S	USDMXN	04/17/2023	(400,000)	18.00	7,200,520
2023041303494	S	USDMXN	04/17/2023	(1,000,000)	18.01	18,010,570
2023041303559	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,038,000
2023041303561	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,036,800
2023041303563	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,036,400
2023041303565	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,036,200
2023041303569	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,036,200
2023041303571	S	USDMXN	04/17/2023	(2,000,000)	18.02	36,036,400
2023041303575	S	USDMXN	04/17/2023	(707,000)	18.02	12,736,888
2022052703816	BO	USDMXN	04/18/2023	109,819	20.90	(2,294,740)
2022053003447	BO	USDMXN	04/18/2023	768,733	20.80	(15,992,421)
2022060603109	BO	USDMXN	04/18/2023	131,782	20.74	(2,732,836)
2022062403445	B	USDMXN	04/18/2023	219,636	21.10	(4,633,539)
2022062703028	BO	USDMXN	04/18/2023	109,818	21.01	(2,307,443)
2022081003643	BO	USDMXN	04/18/2023	101,415	20.94	(2,123,579)
2022081003652	BO	USDMXN	04/18/2023	101,415	20.88	(2,117,049)
2022081203464	BO	USDMXN	04/18/2023	101,415	20.80	(2,109,508)
2022082403502	B	USDMXN	04/18/2023	893,219	20.86	(18,629,363)
2023011103365	BO	USDMXN	04/18/2023	40.000	19.36	(774,256)
2023012503191	BO	USDMXN	04/18/2023	40.000	19.07	(762,828)
2023020103625	BO	USDMXN	04/18/2023	10.000	19.03	(190,336)
2023022803833	BO	USDMXN	04/18/2023	100.000	18.46	(1,846,444)
2023031503523	B	USDMXN	04/18/2023	21,772,311	19.08	(415,449,575)
2023031603350	SO	USDMXN	04/18/2023	(250,000)	18.93	4,731,393
2023031603432	SO	USDMXN	04/18/2023	(207,966)	18.97	3,944,365
2023033003626	S	USDMXN	04/18/2023	(244,000)	18.16	4,430,099
2023040303186	S	USDMXN	04/18/2023	(888,889)	18.17	16,148,931
2023040503403	BO	USDMXN	04/18/2023	150.000	18.13	(2,720,096)
2023041003186	B	USDMXN	04/18/2023	153,846	18.19	(2,798,201)
2023041403236	S	USDMXN	04/18/2023	(2,000,000)	18.06	36,120,000
2023041403477	S	USDMXN	04/18/2023	(707,000)	18.03	12,746,008
2023041403486	S	USDMXN	04/18/2023	(23,116,736)	18.03	416,806,308
2023041403663	S	USDMXN	04/18/2023	(100,000)	18.03	1,802,572
2022051303542	B	USDMXN	04/19/2023	154,157	21.52	(3,318,038)
2022062203454	B	USDMXN	04/19/2023	32,971	21.26	(700,973)
2022062303474	B	USDMXN	04/19/2023	412,232	21.23	(8,752,760)
2022062803493	SO	USDMXN	04/19/2023	(412,278)	21.26	8,763,867
2022070603471	BO	USDMXN	04/19/2023	46	21.84	(1,005)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022111503632	B	USDMXN	04/19/2023	405,747	19.92	(8,080,726)
2022111703231	BO	USDMXN	04/19/2023	923,315	19.97	(18,442,322)
2022111703724	B	USDMXN	04/19/2023	1,624,862	19.96	(32,426,805)
2022111803566	B	USDMXN	04/19/2023	301,976	19.98	(6,032,693)
2022112903717	B	USDMXN	04/19/2023	97,476	19.72	(1,922,028)
2023010403583	BO	USDMXN	04/19/2023	578,874	19.75	(11,434,159)
2023011903681	BO	USDMXN	04/19/2023	41,347	19.35	(799,990)
2023012603538	B	USDMXN	04/19/2023	381,524	19.08	(7,279,708)
2023012703505	BO	USDMXN	04/19/2023	40,000	19.05	(762,026)
2023020103648	B	USDMXN	04/19/2023	57,451	18.88	(1,084,504)
2023021003317	BO	USDMXN	04/19/2023	40,000	18.95	(757,809)
2023021003327	BO	USDMXN	04/19/2023	3,092	18.92	(58,489)
2023021003695	BO	USDMXN	04/19/2023	777,567	18.90	(14,696,645)
2023021003710	B	USDMXN	04/19/2023	204,089	18.90	(3,856,375)
2023021403671	B	USDMXN	04/19/2023	977,000	18.75	(18,318,468)
2023021703750	B	USDMXN	04/19/2023	18,468	18.56	(342,726)
2023021703782	B	USDMXN	04/19/2023	24,624	18.56	(456,964)
2023022103714	BO	USDMXN	04/19/2023	132,379	18.65	(2,469,410)
2023031503438	BO	USDMXN	04/19/2023	18,950	19.16	(363,001)
2023031503641	BO	USDMXN	04/19/2023	5,050	19.10	(96,458)
2023031603684	BO	USDMXN	04/19/2023	50,150	18.86	(945,614)
2023031603353	SO	USDMXN	04/19/2023	(240,000)	18.94	4,544,760
2023031603435	SO	USDMXN	04/19/2023	(4,298)	18.97	81,519
2023032203257	B	USDMXN	04/19/2023	63,600	18.63	(1,184,588)
2023032203473	B	USDMXN	04/19/2023	46,000	18.55	(853,387)
2023032303614	B	USDMXN	04/19/2023	75,200	18.73	(1,408,559)
2023032703235	BO	USDMXN	04/19/2023	400,000	18.42	(7,368,313)
2023032703332	BO	USDMXN	04/19/2023	45,000	18.45	(830,088)
2023032803590	BO	USDMXN	04/19/2023	13,600	18.31	(248,951)
2023032903273	BO	USDMXN	04/19/2023	87,480	18.18	(1,590,810)
2023032903470	BO	USDMXN	04/19/2023	63,385	18.16	(1,151,034)
2023033103841	BO	USDMXN	04/19/2023	266,630	18.08	(4,820,946)
2023040303594	BO	USDMXN	04/19/2023	168,000	18.13	(3,045,874)
2023040303188	S	USDMXN	04/19/2023	(888,889)	18.17	16,152,267
2023041103432	BO	USDMXN	04/19/2023	182,644	18.20	(3,324,414)
2023041203265	BO	USDMXN	04/19/2023	221,252	18.09	(4,002,272)
2023041703274	B	USDMXN	04/19/2023	1,000,000	18.11	(18,113,800)
2023041703108	S	USDMXN	04/19/2023	(5,000,000)	18.13	90,665,000
2023041703396	S	USDMXN	04/19/2023	(707,000)	18.08	12,779,732
2023041803477	S	USDMXN	04/19/2023	(5,100,000)	18.05	92,076,641
2022050203330	BO	USDMXN	04/20/2023	4,170,000	21.94	(91,475,331)
2022051903492	BO	USDMXN	04/20/2023	260,000	21.28	(5,531,962)
2022110303437	B	USDMXN	04/20/2023	34,228	20.29	(694,603)
2022111003749	BO	USDMXN	04/20/2023	150,000	19.91	(2,986,340)
2022113003408	B	USDMXN	04/20/2023	1,721,804	19.87	(34,220,782)
2023010603615	B	USDMXN	04/20/2023	150,000	19.51	(2,926,162)
2023012703504	BO	USDMXN	04/20/2023	50,000	19.02	(951,211)
2023013103359	BO	USDMXN	04/20/2023	20,000	19.00	(380,072)
2023021003656	BO	USDMXN	04/20/2023	60,000	18.93	(1,135,793)
2023021703658	BO	USDMXN	04/20/2023	60,000	18.57	(1,114,460)
2023022003321	BO	USDMXN	04/20/2023	60,000	18.60	(1,115,954)
2023022103458	B	USDMXN	04/20/2023	144,000	18.60	(2,678,733)
2023022803837	BO	USDMXN	04/20/2023	60,000	18.48	(1,108,500)
2023030203510	B	USDMXN	04/20/2023	200,000	18.26	(3,651,190)
2023030303409	BO	USDMXN	04/20/2023	60,000	18.18	(1,090,596)
2023031603358	SO	USDMXN	04/20/2023	(300,000)	18.94	5,683,251
2023031603436	SO	USDMXN	04/20/2023	(9,363)	18.97	177,608
2023032103395	S	USDMXN	04/20/2023	(100,000)	18.78	1,877,667
2023032403139	BO	USDMXN	04/20/2023	300,000	18.63	(5,590,364)
2023032403366	B	USDMXN	04/20/2023	147,965	18.57	(2,747,131)
2023032703559	BO	USDMXN	04/20/2023	16,297	18.44	(300,532)
2023032903217	BO	USDMXN	04/20/2023	478,000	18.19	(8,695,885)
2023032903229	BO	USDMXN	04/20/2023	394	18.19	(7,174)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023033103687	SO	USDMXN	04/20/2023	(126,000)	18.08	2,277,641
2023040303190	S	USDMXN	04/20/2023	(888,889)	18.17	16,155,262
2023040303596	SO	USDMXN	04/20/2023	(126,000)	18.20	2,292,792
2023041803197	B	USDMXN	04/20/2023	1,000,000	18.05	(18,052,800)
2023041803478	B	USDMXN	04/20/2023	5,100,000	18.06	(92,099,370)
2023041803500	B	USDMXN	04/20/2023	2,500,000	18.06	(45,137,500)
2023041803107	S	USDMXN	04/20/2023	(1,000,000)	18.07	18,073,900
2023041803526	S	USDMXN	04/20/2023	(6,673,564)	18.04	120,420,449
2023041803534	S	USDMXN	04/20/2023	(707,000)	18.04	12,757,037
2023041803540	S	USDMXN	04/20/2023	(967,800)	18.04	17,462,499
2023041803623	S	USDMXN	04/20/2023	(107,600)	18.05	1,941,657
2023041803625	S	USDMXN	04/20/2023	(41,600)	18.05	750,687
2023041803627	S	USDMXN	04/20/2023	(39,600)	18.05	714,591
2023041803629	S	USDMXN	04/20/2023	(39,600)	18.04	714,580
2023041803631	S	USDMXN	04/20/2023	(39,600)	18.04	714,578
2023041803633	S	USDMXN	04/20/2023	(28,216)	18.05	509,175
2023041803635	S	USDMXN	04/20/2023	(200,000)	18.05	3,609,186
2022042103295	SO	USDMXN	04/21/2023	(158,750)	21.57	3,424,700
2022070603456	SO	USDMXN	04/21/2023	(231)	21.82	5,050
2022110703301	B	USDMXN	04/21/2023	250,000	20.05	(5,013,682)
2023011303433	B	USDMXN	04/21/2023	1,000,000	19.10	(19,095,837)
2023012703430	B	USDMXN	04/21/2023	6,700,000	19.05	(127,616,863)
2023012703506	BO	USDMXN	04/21/2023	60,000	19.06	(1,143,467)
2023013103361	BO	USDMXN	04/21/2023	30,000	19.01	(570,215)
2023031603620	SO	USDMXN	04/21/2023	(182,682)	18.85	3,442,670
2023031703154	SO	USDMXN	04/21/2023	(215,000)	19.08	4,101,733
2023031703473	SO	USDMXN	04/21/2023	(1,265)	19.00	24,029
2023033103688	SO	USDMXN	04/21/2023	(126,000)	18.08	2,278,086
2023040303192	S	USDMXN	04/21/2023	(888,889)	18.18	16,160,293
2023040403238	SO	USDMXN	04/21/2023	(542,000)	18.21	9,868,706
2023041003323	BO	USDMXN	04/21/2023	700,000	18.20	(12,743,206)
2023041203189	BO	USDMXN	04/21/2023	150,000	18.11	(2,717,085)
2023041303046	BO	USDMXN	04/21/2023	3,459	18.05	(62,439)
2023041903037	B	USDMXN	04/21/2023	1,000,000	18.05	(18,050,460)
2023041903045	S	USDMXN	04/21/2023	(1,000,000)	18.05	18,048,530
2023041903316	S	USDMXN	04/21/2023	(707,000)	18.04	12,754,987
2022042503395	BO	USDMXN	04/24/2023	500,000	21.67	(10,836,550)
2022052503469	SO	USDMXN	04/24/2023	(385,000)	21.14	8,140,307
2022061003340	SO	USDMXN	04/24/2023	(115,000)	21.21	2,439,596
2022112303208	B	USDMXN	04/24/2023	1,100,000	19.91	(21,904,460)
2022122803064	B	USDMXN	04/24/2023	700,000	19.88	(13,913,530)
2023011003580	B	USDMXN	04/24/2023	199,000	19.43	(3,867,303)
2023013103360	BO	USDMXN	04/24/2023	50,000	19.02	(950,898)
2023020103626	BO	USDMXN	04/24/2023	20,000	19.06	(381,102)
2023032103512	SO	USDMXN	04/24/2023	(200,000)	18.75	3,750,264
2023032103528	SO	USDMXN	04/24/2023	(116,918)	18.75	2,191,933
2023032803255	S	USDMXN	04/24/2023	(100,000)	18.34	1,833,951
2023033003693	B	USDMXN	04/24/2023	500,000	18.17	(9,085,554)
2023033003681	S	USDMXN	04/24/2023	(1,000,000)	18.16	18,160,770
2023040303195	S	USDMXN	04/24/2023	(888,889)	18.19	16,172,835
2023040403379	B	USDMXN	04/24/2023	300,000	18.16	(5,448,922)
2023041003564	S	USDMXN	04/24/2023	(258,000)	18.20	4,695,151
2023042003280	S	USDMXN	04/24/2023	(707,000)	18.01	12,733,494
2023042003398	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,288
2023042003400	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,288
2023042003402	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,168
2023042003404	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,252
2023042003406	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,204
2023042003408	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,216
2023042003410	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,216
2023042003412	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,234
2023042003414	S	USDMXN	04/24/2023	(60,000)	18.00	1,080,216
2023042003491	S	USDMXN	04/24/2023	(863,393)	18.01	15,553,255

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042003494	S	USDMXN	04/24/2023	(581,200)	18.02	10,470,550
2023042003519	S	USDMXN	04/24/2023	(157,902)	18.02	2,845,220
2023042003521	S	USDMXN	04/24/2023	(159,638)	18.02	2,876,485
2023042003524	S	USDMXN	04/24/2023	(165,436)	18.02	2,981,620
2023042003526	S	USDMXN	04/24/2023	(173,603)	18.02	3,128,361
2023042003528	S	USDMXN	04/24/2023	(166,616)	18.02	3,002,320
2023042003530	S	USDMXN	04/24/2023	(171,229)	18.02	3,085,632
2023042003532	S	USDMXN	04/24/2023	(174,164)	18.02	3,138,714
2023042003534	S	USDMXN	04/24/2023	(175,459)	18.03	3,162,929
2023042003536	S	USDMXN	04/24/2023	(186,653)	18.03	3,364,663
2023042003538	S	USDMXN	04/24/2023	(171,966)	18.03	3,099,962
2022052703817	BO	USDMXN	04/25/2023	23,706	20.92	(496,035)
2022052703818	BO	USDMXN	04/25/2023	86,113	20.93	(1,802,739)
2022053003448	BO	USDMXN	04/25/2023	768,733	20.83	(16,014,964)
2022060603110	BO	USDMXN	04/25/2023	131,318	20.77	(2,726,962)
2022060603372	BO	USDMXN	04/25/2023	464	20.89	(9,692)
2022062403449	B	USDMXN	04/25/2023	219,636	21.12	(4,638,909)
2022062703030	BO	USDMXN	04/25/2023	109,430	21.04	(2,302,413)
2022062703221	BO	USDMXN	04/25/2023	388	21.13	(8,200)
2022081003644	BO	USDMXN	04/25/2023	101,031	20.97	(2,118,284)
2022081003654	BO	USDMXN	04/25/2023	101,031	20.90	(2,111,766)
2022081003691	BO	USDMXN	04/25/2023	768	20.99	(16,116)
2022081203465	BO	USDMXN	04/25/2023	101,031	20.83	(2,104,252)
2022081203735	BO	USDMXN	04/25/2023	385	20.81	(8,012)
2022082403506	B	USDMXN	04/25/2023	893,219	20.88	(18,653,222)
2022102403524	BO	USDMXN	04/25/2023	804,100	20.63	(16,586,348)
2022120503512	SO	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	20.20	2,020,244
2023020103627	BO	USDMXN	04/25/2023	60,000	19.06	(1,143,522)
2023021003091	B	USDMXN	04/25/2023	572,730	18.94	(10,850,062)
2023021003094	B	USDMXN	04/25/2023	482,639	18.94	(9,140,021)
2023021603537	S	USDMXN	04/25/2023	(964,545)	18.71	18,049,036
2023022203462	BO	USDMXN	04/25/2023	100,000	18.54	(1,854,121)
2023022303524	BO	USDMXN	04/25/2023	250,000	18.53	(4,633,076)
2023030203549	S	USDMXN	04/25/2023	(548,400)	18.28	10,026,325
2023030203551	S	USDMXN	04/25/2023	(38,024)	18.28	695,164
2023030203560	S	USDMXN	04/25/2023	(808,442)	18.29	14,785,316
2023030303326	BO	USDMXN	04/25/2023	250,000	18.20	(4,548,833)
2023031003784	SO	USDMXN	04/25/2023	(211,000)	18.65	3,935,836
2023031003796	SO	USDMXN	04/25/2023	(699)	18.63	13,015
2023031303654	BO	USDMXN	04/25/2023	100,000	19.15	(1,914,739)
2023031603617	BO	USDMXN	04/25/2023	231,774	18.87	(4,373,492)
2023032203280	SO	USDMXN	04/25/2023	(95,000)	18.65	1,772,151
2023032203314	SO	USDMXN	04/25/2023	(226)	18.65	4,221
2023032303490	B	USDMXN	04/25/2023	135,524	18.72	(2,536,943)
2023032303681	BO	USDMXN	04/25/2023	1,324	18.73	(24,804)
2023032303640	SO	USDMXN	04/25/2023	(175,000)	18.75	3,281,233
2023032703579	B	USDMXN	04/25/2023	350,000	18.46	(6,459,338)
2023032903532	BO	USDMXN	04/25/2023	69,800	18.18	(1,269,132)
2023040303197	S	USDMXN	04/25/2023	(888,889)	18.20	16,177,138
2023040503404	BO	USDMXN	04/25/2023	150,000	18.16	(2,723,915)
2023041003189	B	USDMXN	04/25/2023	153,846	18.21	(2,802,276)
2023041003560	S	USDMXN	04/25/2023	(265,000)	18.20	4,823,509
2023042103304	B	USDMXN	04/25/2023	1,000,000	17.99	(17,992,460)
2023042103311	B	USDMXN	04/25/2023	500,000	17.99	(8,996,025)
2023042103376	B	USDMXN	04/25/2023	500,000	17.99	(8,992,500)
2023042103491	B	USDMXN	04/25/2023	162,600	18.00	(2,927,467)
2023042103493	B	USDMXN	04/25/2023	258,000	18.00	(4,645,135)
2023042103170	S	USDMXN	04/25/2023	(1,000,000)	18.01	18,013,540
2023042103312	S	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	17.99	1,799,010
2023042103314	S	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	17.99	1,799,010
2023042103317	S	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	17.99	1,799,020
2023042103319	S	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	17.99	1,799,000
2023042103322	S	USDMXN	04/25/2023	(100,000)	17.99	1,799,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042103487	S	USDMXN	04/25/2023	(707,000)	18.00	12,725,929
2022052403129	SO	USDMXN	04/26/2023	(287,000)	21.25	6,099,138
2022052603151	SO	USDMXN	04/26/2023	(72)	21.12	1,527
2022060703174	SO	USDMXN	04/26/2023	(292,230)	20.87	6,098,775
2022122903315	B	USDMXN	04/26/2023	6,000,000	19.80	(118,787,696)
2023011003582	B	USDMXN	04/26/2023	172,000	19.44	(3,343,838)
2023012403445	BO	USDMXN	04/26/2023	4,147,657	19.16	(79,457,279)
2023013103773	B	USDMXN	04/26/2023	3,609,868	19.12	(69,028,087)
2023021403673	B	USDMXN	04/26/2023	977,000	18.78	(18,344,078)
2023030703581	B	USDMXN	04/26/2023	1,584,323	18.30	(28,989,496)
2023031403538	BO	USDMXN	04/26/2023	1,750,043	18.79	(32,883,714)
2023032103493	B	USDMXN	04/26/2023	200,722	18.77	(3,768,056)
2023032103617	BO	USDMXN	04/26/2023	84,300	18.76	(1,581,464)
2023032203255	B	USDMXN	04/26/2023	38,600	18.65	(720,010)
2023032303578	BO	USDMXN	04/26/2023	42,500	18.71	(795,147)
2023032303621	B	USDMXN	04/26/2023	37,600	18.76	(705,205)
2023032403590	BO	USDMXN	04/26/2023	57,200	18.57	(1,062,001)
2023032403726	BO	USDMXN	04/26/2023	59,200	18.56	(1,098,702)
2023032703335	BO	USDMXN	04/26/2023	19,100	18.48	(352,903)
2023032803392	B	USDMXN	04/26/2023	400,000	18.37	(7,346,828)
2023032803577	B	USDMXN	04/26/2023	630,013	18.32	(11,544,965)
2023032903272	BO	USDMXN	04/26/2023	31,700	18.21	(577,230)
2023032903469	BO	USDMXN	04/26/2023	31,700	18.18	(576,418)
2023040303199	S	USDMXN	04/26/2023	(888,889)	18.20	16,178,667
2023041103381	SO	USDMXN	04/26/2023	(3,841,000)	18.23	70,011,543
2023041103435	S	USDMXN	04/26/2023	(9,052,369)	18.23	164,999,296
2023041203261	BO	USDMXN	04/26/2023	29,692	18.12	(537,967)
2023041303047	SO	USDMXN	04/26/2023	(616)	18.07	11,130
2023041403622	BO	USDMXN	04/26/2023	145,000	18.05	(2,617,626)
2023041703010	BO	USDMXN	04/26/2023	30,588	18.12	(554,181)
2023041703550	BO	USDMXN	04/26/2023	200,000	18.10	(3,620,058)
2023041803523	B	USDMXN	04/26/2023	3,624,121	18.07	(65,494,062)
2023041803527	B	USDMXN	04/26/2023	6,673,564	18.07	(120,590,678)
2023041803634	B	USDMXN	04/26/2023	28,216	18.07	(509,934)
2023042403265	B	USDMXN	04/26/2023	11,340,000	18.01	(204,283,296)
2023042403356	B	USDMXN	04/26/2023	1,000,000	17.99	(17,989,170)
2023042403315	S	USDMXN	04/26/2023	(50,000,000)	18.01	900,265,000
2023042403348	S	USDMXN	04/26/2023	(50,000,000)	18.00	899,885,000
2023042403418	S	USDMXN	04/26/2023	(1,000,000)	17.98	17,976,650
2023042403572	S	USDMXN	04/26/2023	(707,000)	17.97	12,704,861
2022060103318	SO	USDMXN	04/27/2023	(360,292)	21.03	7,577,889
2022061403305	SO	USDMXN	04/27/2023	(345,455)	21.94	7,577,999
2022062903256	SO	USDMXN	04/27/2023	(355,739)	21.37	7,600,920
2022082403016	BO	USDMXN	04/27/2023	250,000	20.93	(5,231,998)
2022110303439	B	USDMXN	04/27/2023	34,228	20.32	(695,493)
2022111003750	BO	USDMXN	04/27/2023	150,000	19.93	(2,990,165)
2022113003410	B	USDMXN	04/27/2023	1,721,804	19.91	(34,278,651)
2022122903307	BO	USDMXN	04/27/2023	8,400,000	19.81	(166,370,769)
2022122903495	BO	USDMXN	04/27/2023	31,363	19.85	(622,670)
2023010603617	B	USDMXN	04/27/2023	150,000	19.53	(2,930,051)
2023012703436	B	USDMXN	04/27/2023	7,067,323	19.07	(134,764,771)
2023020103629	BO	USDMXN	04/27/2023	50,000	19.04	(951,910)
2023020203577	BO	USDMXN	04/27/2023	10,000	18.98	(189,777)
2023021003657	BO	USDMXN	04/27/2023	60,000	18.96	(1,137,341)
2023021703659	BO	USDMXN	04/27/2023	60,000	18.60	(1,115,964)
2023022003320	BO	USDMXN	04/27/2023	60,000	18.62	(1,117,467)
2023022803838	BO	USDMXN	04/27/2023	60,000	18.50	(1,109,975)
2023030203512	B	USDMXN	04/27/2023	200,000	18.28	(3,656,122)
2023030303408	BO	USDMXN	04/27/2023	60,000	18.20	(1,092,063)
2023032103397	S	USDMXN	04/27/2023	(100,000)	18.80	1,880,250
2023032403362	B	USDMXN	04/27/2023	74,699	18.59	(1,388,907)
2023032403104	SO	USDMXN	04/27/2023	(75,000)	18.71	1,403,053
2023032703560	BO	USDMXN	04/27/2023	16,297	18.47	(300,927)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023032703581	B	USDMXN	04/27/2023	400.000	18.46	(7,384,428)
2023040303201	S	USDMXN	04/27/2023	(888,889)	18.20	16,181,698
2023041003415	BO	USDMXN	04/27/2023	2,000.000	18.22	(36,449,700)
2023041003557	S	USDMXN	04/27/2023	(97,000)	18.21	1,766,523
2023041403664	B	USDMXN	04/27/2023	100.000	18.07	(1,806,522)
2023042503133	B	USDMXN	04/27/2023	199,437	18.07	(3,603,234)
2023042503186	B	USDMXN	04/27/2023	1,000.000	18.07	(18,068,300)
2023042503328	B	USDMXN	04/27/2023	1,000.000	18.12	(18,117,750)
2023042503488	B	USDMXN	04/27/2023	17,747,436	18.11	(321,372,353)
2023042503208	S	USDMXN	04/27/2023	(293,000)	18.07	5,295,237
2023042503211	S	USDMXN	04/27/2023	(1,000,000)	18.06	18,060,430
2023042503222	S	USDMXN	04/27/2023	(707,000)	18.06	12,768,986
2023042503499	S	USDMXN	04/27/2023	(3,747,436)	18.11	67,876,371
2023042703779	B	USDMXN	04/27/2023	3,800.000	18.03	(68,514,000)
2021111603441	SO	USDMXN	04/28/2023	(100,000)	22.65	2,264,528
2022030703254	SO	USDMXN	04/28/2023	(75,000)	22.81	1,710,940
2022042703307	SO	USDMXN	04/28/2023	(158,750)	21.99	3,491,411
2022110703303	B	USDMXN	04/28/2023	250.000	20.08	(5,020,556)
2022110703618	BO	USDMXN	04/28/2023	75,000	20.09	(1,506,548)
2022111103377	BO	USDMXN	04/28/2023	100,000	20.12	(2,011,833)
2023011003584	B	USDMXN	04/28/2023	138,000	19.45	(2,683,887)
2023011803541	BO	USDMXN	04/28/2023	25,000	19.18	(479,486)
2023012703105	BON	USDMXN	04/28/2023	100,000,000	19.05	(1,904,660,000)
2023012703108	BON	USDMXN	04/28/2023	100,000,000	19.05	(1,904,660,000)
2023012703697	BO	USDMXN	04/28/2023	530,000	19.09	(10,116,835)
2023012703077	SON	USDMXN	04/28/2023	(200,000,000)	19.04	3,807,660,000
2023020203499	B	USDMXN	04/28/2023	300,000	18.95	(5,684,521)
2023020203576	BO	USDMXN	04/28/2023	20,000	18.98	(379,626)
2023031003618	SO	USDMXN	04/28/2023	(125,000)	18.67	2,333,501
2023031403088	SO	USDMXN	04/28/2023	(125,000)	19.26	2,407,218
2023031603197	BO	USDMXN	04/28/2023	548,500	19.24	(10,551,680)
2023031603541	BO	USDMXN	04/28/2023	548,300	19.01	(10,423,501)
2023031703280	BO	USDMXN	04/28/2023	548,400	19.07	(10,456,310)
2023032103345	BO	USDMXN	04/28/2023	550,000	18.87	(10,378,181)
2023032103434	B	USDMXN	04/28/2023	548,500	18.79	(10,308,293)
2023032103538	SO	USDMXN	04/28/2023	(1,600)	18.77	30,025
2023032203121	B	USDMXN	04/28/2023	500,000	18.69	(9,345,370)
2023032203312	SO	USDMXN	04/28/2023	(100)	18.66	1,867
2023032303603	B	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.74	(10,276,987)
2023032703254	B	USDMXN	04/28/2023	548,500	18.51	(10,151,463)
2023032703467	B	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.47	(10,129,293)
2023032703442	SO	USDMXN	04/28/2023	(100)	18.46	1,846
2023032803035	B	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.38	(10,081,172)
2023032803443	B	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.36	(10,068,421)
2023032903162	BO	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.23	(9,998,598)
2023032903493	B	USDMXN	04/28/2023	240,000	18.20	(4,368,813)
2023032903502	BO	USDMXN	04/28/2023	308,400	18.20	(5,611,513)
2023033103556	BO	USDMXN	04/28/2023	548,400	18.10	(9,923,804)
2023040303589	BO	USDMXN	04/28/2023	100,000	18.19	(1,819,325)
2023040303203	S	USDMXN	04/28/2023	(888,889)	18.21	16,182,231
2023041003554	S	USDMXN	04/28/2023	(397,000)	18.21	7,230,435
2023041303572	B	USDMXN	04/28/2023	2,000,000	18.06	(36,124,082)
2023041803588	SO	USDMXN	04/28/2023	(25,000)	18.08	452,005
2023042403316	B	USDMXN	04/28/2023	50,000,000	18.01	(900,676,645)
2023042403349	B	USDMXN	04/28/2023	50,000,000	18.01	(900,296,645)
2023042503470	BON	USDMXN	04/28/2023	200,000,000	18.10	(3,620,000,000)
2023042503477	SON	USDMXN	04/28/2023	(200,000,000)	18.10	3,620,000,000
2023042603048	B	USDMXN	04/28/2023	1,000,000	18.14	(18,138,880)
2023042603130	BON	USDMXN	04/28/2023	200,000,000	19.04	(3,807,660,000)
2023042603134	BO	USDMXN	04/28/2023	0	18.13	(92,110,000)
2023042603136	BO	USDMXN	04/28/2023	0	18.13	(92,110,000)
2023042603137	BON	USDMXN	04/28/2023	200,000,000	18.10	(3,620,000,000)
2023042603139	BO	USDMXN	04/28/2023	0	18.13	(5,100,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042603079	S	USDMXN	04/28/2023	(1,000,000)	18.13	18,129,820
2023042603132	SO	USDMXN	04/28/2023	0	18.13	182,560,000
2023042603131	SON	USDMXN	04/28/2023	(100,000,000)	19.05	1,904,660,000
2023042603133	SON	USDMXN	04/28/2023	(100,000,000)	19.05	1,904,660,000
2023042603135	SON	USDMXN	04/28/2023	(200,000,000)	18.10	3,620,000,000
2023042603138	SO	USDMXN	04/28/2023	0	18.13	5,100,000
2023042703780	S	USDMXN	04/28/2023	(3,800,000)	18.04	68,533,000
2022092003182	BO	USDMXN	05/02/2023	2,500,000	20.83	(52,080,420)
2022111003562	B	USDMXN	05/02/2023	4,100,000	20.01	(82,049,089)
2022122303348	BO	USDMXN	05/02/2023	2,300,000	19.88	(45,718,659)
2023011003479	B	USDMXN	05/02/2023	930,000	19.46	(18,095,381)
2023012503354	BO	USDMXN	05/02/2023	20,000	19.16	(383,215)
2023013003154	BON	USDMXN	05/02/2023	100,000,000	19.11	(1,910,900,000)
2023013003155	BON	USDMXN	05/02/2023	100,000,000	19.11	(1,910,900,000)
2023013003473	BO	USDMXN	05/02/2023	40,000	19.10	(763,978)
2023013003136	SON	USDMXN	05/02/2023	(200,000,000)	19.09	3,818,900,000
2023020103712	BO	USDMXN	05/02/2023	50,000	18.97	(948,378)
2023020203578	BO	USDMXN	05/02/2023	20,000	19.00	(379,911)
2023030103309	BO	USDMXN	05/02/2023	100,000	18.39	(1,839,233)
2023031603543	BO	USDMXN	05/02/2023	100	18.97	(1,897)
2023031603437	SO	USDMXN	05/02/2023	(100)	19.01	1,901
2023032903533	BO	USDMXN	05/02/2023	70,000	18.21	(1,274,630)
2023040303205	S	USDMXN	05/02/2023	(888,889)	18.22	16,194,480
2023040403554	B	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.22	(12,880,918)
2023040503405	BO	USDMXN	05/02/2023	150,000	18.19	(2,727,774)
2023041003191	B	USDMXN	05/02/2023	153,846	18.24	(2,806,321)
2023041003525	BO	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.24	(12,897,236)
2023041103427	BO	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.25	(12,901,548)
2023041203108	BO	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.12	(12,807,991)
2023041303129	BO	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.09	(12,792,258)
2023041303576	B	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.07	(12,778,361)
2023041403478	B	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.08	(12,785,928)
2023041403482	BO	USDMXN	05/02/2023	36,159	18.11	(654,878)
2023041703397	B	USDMXN	05/02/2023	707,000	18.13	(12,818,364)
2023041703407	SO	USDMXN	05/02/2023	(496,200)	18.17	9,013,647
2023041703507	SO	USDMXN	05/02/2023	(118,800)	18.13	2,154,064
2023042603087	BON	USDMXN	05/02/2023	200,000,000	18.14	(3,628,000,000)
2023042603121	SON	USDMXN	05/02/2023	(200,000,000)	18.15	3,630,000,000
2023042603688	SON	USDMXN	05/02/2023	(200,000,000)	18.15	3,630,000,000
2023042703059	B	USDMXN	05/02/2023	1,000,000	18.08	(18,082,450)
2023042703076	BO	USDMXN	05/02/2023	0	18.07	(14,000,000)
2023042703077	BON	USDMXN	05/02/2023	200,000,000	18.15	(3,630,000,000)
2023042703144	B	USDMXN	05/02/2023	1,000,000	18.07	(18,072,170)
2023042703153	B	USDMXN	05/02/2023	1,000,000	18.07	(18,072,210)
2023042703163	B	USDMXN	05/02/2023	1,000,000	18.07	(18,072,650)
2023042703165	B	USDMXN	05/02/2023	2,000,000	18.07	(36,146,020)
2023042703177	B	USDMXN	05/02/2023	2,000,000	18.07	(36,145,580)
2023042703200	B	USDMXN	05/02/2023	1,000,000	18.07	(18,072,680)
2023042703672	B	USDMXN	05/02/2023	1,080,529	18.05	(19,500,920)
2023042703675	B	USDMXN	05/02/2023	820,919	18.05	(14,814,719)
2023042703073	S	USDMXN	05/02/2023	(1,000,000)	18.07	18,068,900
2023042703075	SON	USDMXN	05/02/2023	(200,000,000)	18.14	3,628,000,000
2023042703078	SO	USDMXN	05/02/2023	0	18.07	16,000,000
2023042703194	S	USDMXN	05/02/2023	(7,958,744)	18.07	143,826,437
2023042703205	S	USDMXN	05/02/2023	(1,904,368)	18.07	34,420,683
2023042703346	S	USDMXN	05/02/2023	(6,600,000)	18.06	119,213,820
2023042703597	S	USDMXN	05/02/2023	(103,600)	18.05	1,869,876
2023042703729	S	USDMXN	05/02/2023	(2,037,738)	18.05	36,772,546
2023042803085	BON	USDMXN	05/02/2023	200,000,000	19.09	(3,818,900,000)
2023042803089	BO	USDMXN	05/02/2023	0	18.04	(107,000,000)
2023042803090	BO	USDMXN	05/02/2023	0	18.04	(107,000,000)
2023042803087	SO	USDMXN	05/02/2023	0	18.04	211,100,000
2023042803086	SON	USDMXN	05/02/2023	(100,000,000)	19.11	1,910,900,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042803088	SON	USDMXN	05/02/2023	(100,000,000)	19.11	1,910,900,000
2023021403675	B	USDMXN	05/03/2023	977,000	18.80	(18,368,439)
2023032803394	B	USDMXN	05/03/2023	400,000	18.39	(7,356,380)
2023032803650	BO	USDMXN	05/03/2023	29,050	18.34	(532,872)
2023032903210	BO	USDMXN	05/03/2023	21,550	18.24	(393,139)
2023032903274	BO	USDMXN	05/03/2023	204,120	18.23	(3,721,992)
2023033003271	BO	USDMXN	05/03/2023	37,850	18.21	(689,235)
2023033103843	BO	USDMXN	05/03/2023	132,060	18.13	(2,394,196)
2023040303584	BO	USDMXN	05/03/2023	30,000	18.18	(545,467)
2023040303207	S	USDMXN	05/03/2023	(888,889)	18.22	16,196,053
2023040403462	BO	USDMXN	05/03/2023	44,950	18.22	(818,961)
2023041103437	BO	USDMXN	05/03/2023	25,612	18.26	(467,585)
2023041203260	BO	USDMXN	05/03/2023	304,312	18.14	(5,521,398)
2023041203281	BO	USDMXN	05/03/2023	57,900	18.14	(1,050,490)
2023041203612	BO	USDMXN	05/03/2023	38,600	18.17	(701,220)
2023041303045	BO	USDMXN	05/03/2023	38,600	18.10	(698,574)
2023041703644	BO	USDMXN	05/03/2023	26,576	18.10	(481,028)
2023041803636	B	USDMXN	05/03/2023	200,000	18.10	(3,620,246)
2023041903318	BO	USDMXN	05/03/2023	31,056	18.10	(562,107)
2023042103568	BO	USDMXN	05/03/2023	178,476	18.03	(3,218,793)
2023042403437	BO	USDMXN	05/03/2023	30,184	18.00	(543,384)
2023042603278	SO	USDMXN	05/03/2023	(5,000,000)	18.12	90,622,540
2023042603383	SO	USDMXN	05/03/2023	(3,480,801)	18.12	63,056,121
2023042803534	S	USDMXN	05/03/2023	(100,000)	18.00	1,800,190
2023042803536	S	USDMXN	05/03/2023	(100,000)	18.00	1,800,140
2023042803538	S	USDMXN	05/03/2023	(100,000)	18.00	1,800,280
2023042803540	S	USDMXN	05/03/2023	(100,000)	18.00	1,800,380
2023042803542	S	USDMXN	05/03/2023	(100,000)	18.00	1,800,380
2022081003394	BO	USDMXN	05/04/2023	15,000,000	21.00	(314,947,875)
2022111003751	BO	USDMXN	05/04/2023	150,000	19.96	(2,993,990)
2022111103345	BO	USDMXN	05/04/2023	71,658	20.14	(1,443,325)
2022112903239	BO	USDMXN	05/04/2023	3,900,000	19.78	(77,157,912)
2022112903267	BO	USDMXN	05/04/2023	35,000	19.79	(692,566)
2022113003413	B	USDMXN	05/04/2023	1,754,307	19.93	(34,970,738)
2023010603619	B	USDMXN	05/04/2023	150,000	19.56	(2,934,044)
2023020103713	BO	USDMXN	05/04/2023	50,000	18.97	(948,735)
2023020203579	BO	USDMXN	05/04/2023	20,000	19.00	(380,053)
2023021003658	BO	USDMXN	05/04/2023	60,000	18.98	(1,138,889)
2023021703661	BO	USDMXN	05/04/2023	60,000	18.62	(1,117,458)
2023022003322	BO	USDMXN	05/04/2023	60,000	18.65	(1,118,969)
2023022803834	BO	USDMXN	05/04/2023	100,000	18.52	(1,852,057)
2023022803839	BO	USDMXN	05/04/2023	60,000	18.52	(1,111,448)
2023030303411	BO	USDMXN	05/04/2023	60,000	18.23	(1,093,530)
2023032703583	B	USDMXN	05/04/2023	400,000	18.49	(7,394,518)
2023040503694	BO	USDMXN	05/04/2023	29,211	18.39	(537,236)
2023042603478	BO	USDMXN	05/04/2023	16,000	18.14	(290,163)
2023050203621	B	USDMXN	05/04/2023	13,054,776	17.98	(234,707,510)
2023050203103	S	USDMXN	05/04/2023	(250,000)	18.06	4,515,150
2023050203105	S	USDMXN	05/04/2023	(250,000)	18.06	4,514,975
2023050203107	S	USDMXN	05/04/2023	(250,000)	18.06	4,513,800
2023050203109	S	USDMXN	05/04/2023	(250,000)	18.06	4,514,200
2023050203111	S	USDMXN	05/04/2023	(250,000)	18.06	4,514,175
2023050203358	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,413
2023050203360	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,315
2023050203363	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,315
2023050203365	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,184
2023050203367	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,184
2023050203369	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,175
2023050203371	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,192
2023050203374	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,388
2023050203376	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,388
2023050203378	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,372
2023050203380	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,372

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050203382	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,372
2023050203384	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,388
2023050203386	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,388
2023050203388	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,388
2023050203390	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,175
2023050203393	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,175
2023050203396	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,184
2023050203398	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,184
2023050203400	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,184
2023050203402	S	USDMXN	05/04/2023	(81,818)	18.02	1,474,200
2023050203568	S	USDMXN	05/04/2023	(44,436)	18.00	799,697
2023050203572	S	USDMXN	05/04/2023	(147,744)	18.00	2,658,907
2023050203576	S	USDMXN	05/04/2023	(254,858)	18.00	4,587,148
2023050203579	S	USDMXN	05/04/2023	(254,858)	18.00	4,587,156
2021112403367	SO	USDMXN	05/05/2023	(150,000)	23.45	3,516,863
2022050603510	SO	USDMXN	05/05/2023	(158,750)	21.51	3,414,464
2022052303161	BO	USDMXN	05/05/2023	690,000	21.21	(14,632,220)
2022060203394	BO	USDMXN	05/05/2023	55,000	20.91	(1,149,798)
2022110803169	B	USDMXN	05/05/2023	250,000	20.11	(5,027,837)
2023011003502	B	USDMXN	05/05/2023	445,673	19.46	(8,672,129)
2023011003506	B	USDMXN	05/05/2023	174,327	19.46	(3,392,143)
2023011003588	B	USDMXN	05/05/2023	788,000	19.47	(15,346,172)
2023011203111	B	USDMXN	05/05/2023	2,658,731	19.29	(51,292,797)
2023011303307	B	USDMXN	05/05/2023	1,874,373	19.17	(35,930,877)
2023012003450	BO	USDMXN	05/05/2023	2,608,735	19.22	(50,148,368)
2023012703698	BO	USDMXN	05/05/2023	460,000	19.11	(8,792,262)
2023020203581	BO	USDMXN	05/05/2023	30,000	19.01	(570,186)
2023040303597	BO	USDMXN	05/05/2023	67,500	18.19	(1,227,584)
2023040403034	BO	USDMXN	05/05/2023	200,000	18.11	(3,622,352)
2023041703406	SO	USDMXN	05/05/2023	(391,000)	18.18	7,107,138
2023050303534	S	USDMXN	05/05/2023	(400,000)	17.89	7,156,120
2023050303541	S	USDMXN	05/05/2023	(149,173)	17.89	2,668,108
2023050303543	S	USDMXN	05/05/2023	(149,173)	17.89	2,668,078
2023050303545	S	USDMXN	05/05/2023	(73,872)	17.89	1,321,289
2023050303547	S	USDMXN	05/05/2023	(73,872)	17.88	1,321,127
2023050303549	S	USDMXN	05/05/2023	(127,429)	17.88	2,278,864
2023050303551	S	USDMXN	05/05/2023	(127,429)	17.88	2,278,991
2023021403587	BO	USDMXN	05/08/2023	20,000	18.83	(376,687)
2023030303219	BO	USDMXN	05/08/2023	100,000	18.22	(1,822,034)
2023030303429	B	USDMXN	05/08/2023	50,000	18.21	(910,677)
2023041903442	SO	USDMXN	05/08/2023	(175,000)	18.10	3,168,190
2023041903443	SO	USDMXN	05/08/2023	(359,000)	18.13	6,507,332
2023042703128	BO	USDMXN	05/08/2023	70,700	18.10	(1,279,520)
2023042703746	BO	USDMXN	05/08/2023	60	18.07	(1,084)
2023050403027	B	USDMXN	05/08/2023	1,000,000	17.99	(17,990,230)
2023050403159	B	USDMXN	05/08/2023	1,000,000	17.95	(17,954,870)
2023050403359	B	USDMXN	05/08/2023	10,000,000	17.94	(179,361,000)
2023050403371	B	USDMXN	05/08/2023	10,000,000	17.93	(179,306,000)
2023050403536	B	USDMXN	05/08/2023	163,450	17.91	(2,927,563)
2023050403025	S	USDMXN	05/08/2023	(1,000,000)	17.97	17,974,920
2023050403169	S	USDMXN	05/08/2023	(582,000)	17.95	10,447,424
2023050403261	S	USDMXN	05/08/2023	(1,000,000)	17.95	17,950,000
2023050403357	S	USDMXN	05/08/2023	(5,000,000)	17.93	89,665,000
2023050403363	S	USDMXN	05/08/2023	(5,000,000)	17.93	89,660,000
2023050403373	S	USDMXN	05/08/2023	(4,000,000)	17.93	71,728,000
2023050403376	S	USDMXN	05/08/2023	(3,000,000)	17.93	53,784,000
2023050403450	S	USDMXN	05/08/2023	(237,000)	17.92	4,246,874
2023050403564	S	USDMXN	05/08/2023	(2,776,241)	17.91	49,714,702
2023050403566	S	USDMXN	05/08/2023	(387,209)	17.91	6,934,262
2022110703440	BO	USDMXN	05/09/2023	100,000	20.13	(2,012,541)
2022122803066	B	USDMXN	05/09/2023	1,700,000	19.93	(33,885,180)
2023011103569	BO	USDMXN	05/09/2023	100,000	19.42	(1,942,108)
2023012503355	BO	USDMXN	05/09/2023	30,000	19.19	(575,595)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023013003474	BO	USDMXN	05/09/2023	40,000	19.12	(764,991)
2023021403585	BO	USDMXN	05/09/2023	20,000	18.84	(376,760)
2023032403358	B	USDMXN	05/09/2023	147,965	18.63	(2,757,115)
2023032403583	SO	USDMXN	05/09/2023	(367,000)	18.61	6,829,723
2023032403724	SO	USDMXN	05/09/2023	(1,124)	18.60	20,903
2023040303265	B	USDMXN	05/09/2023	5,000,000	18.25	(91,235,451)
2023040503406	BO	USDMXN	05/09/2023	150,000	18.21	(2,731,492)
2023041003193	B	USDMXN	05/09/2023	153,846	18.27	(2,810,258)
2023041303440	B	USDMXN	05/09/2023	400,000	18.08	(7,233,941)
2023041403480	BO	USDMXN	05/09/2023	106,105	18.14	(1,924,327)
2023042503163	SO	USDMXN	05/09/2023	(265,000)	18.09	4,794,859
2023042703347	B	USDMXN	05/09/2023	6,600,000	18.09	(119,407,444)
2023050503047	B	USDMXN	05/09/2023	1,000,000	17.81	(17,805,860)
2023050503205	B	USDMXN	05/09/2023	1,000,000	17.76	(17,760,000)
2023050503114	S	USDMXN	05/09/2023	(418,000)	17.82	7,448,760
2023050503164	S	USDMXN	05/09/2023	(1,000,000)	17.80	17,800,050
2023050503214	S	USDMXN	05/09/2023	(250,000)	17.76	4,439,000
2023050503216	S	USDMXN	05/09/2023	(250,000)	17.76	4,438,875
2023050503218	S	USDMXN	05/09/2023	(250,000)	17.76	4,439,000
2023050503220	S	USDMXN	05/09/2023	(250,000)	17.76	4,439,000
2023050503348	S	USDMXN	05/09/2023	(5,000,000)	17.78	88,916,000
2023050503351	S	USDMXN	05/09/2023	(582,000)	17.78	10,346,098
2023050503573	S	USDMXN	05/09/2023	(149,173)	17.80	2,654,548
2023050503575	S	USDMXN	05/09/2023	(149,173)	17.80	2,654,593
2023050503578	S	USDMXN	05/09/2023	(73,872)	17.79	1,314,530
2023050503580	S	USDMXN	05/09/2023	(73,872)	17.79	1,314,434
2023050503582	S	USDMXN	05/09/2023	(127,429)	17.79	2,267,421
2023050503585	S	USDMXN	05/09/2023	(127,429)	17.79	2,267,459
2023050503714	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,876
2023050503716	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,864
2023050503718	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,864
2023050503720	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,851
2023050503723	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,845
2023050503725	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,864
2023050503727	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,851
2023050503729	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,857
2023050503731	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,864
2023050503733	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,857
2023050503735	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,851
2023050503737	S	USDMXN	05/09/2023	(61,500)	17.79	1,093,857
2023050903317	S	USDMXN	05/09/2023	(8,600,000)	17.77	152,822,000
2023050903323	S	USDMXN	05/09/2023	(3,800,000)	17.77	67,526,000
2022062903511	SO	USDMXN	05/10/2023	(280,000)	21.38	5,986,351
2022062903539	SO	USDMXN	05/10/2023	(426)	21.39	9,119
2022071903248	SO	USDMXN	05/10/2023	(277,000)	21.64	5,993,717
2022071903250	SO	USDMXN	05/10/2023	(213)	21.65	4,614
2022072603326	BO	USDMXN	05/10/2023	1,797	21.58	(38,777)
2022072603325	SO	USDMXN	05/10/2023	(280,000)	21.57	6,038,780
2023021403249	B	USDMXN	05/10/2023	125,000	18.86	(2,357,426)
2023021403677	B	USDMXN	05/10/2023	977,000	18.83	(18,393,403)
2023022703277	B	USDMXN	05/10/2023	25,000,000	18.65	(466,209,250)
2023030903621	BO	USDMXN	05/10/2023	107,690	18.30	(1,970,743)
2023031003858	BO	USDMXN	05/10/2023	470,000	18.69	(8,783,830)
2023031003869	SO	USDMXN	05/10/2023	(470,000)	18.69	8,785,168
2023032703281	B	USDMXN	05/10/2023	250,000	18.52	(4,629,290)
2023040303169	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,222,370)
2023040303171	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,221,901)
2023040303174	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.24	(16,216,316)
2023040303176	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.24	(16,216,434)
2023040303179	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.24	(16,217,136)
2023040303182	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,218,025)
2023040303185	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,218,096)
2023040303187	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,217,918)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023040303189	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,218,016)
2023040303191	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,217,900)
2023040303193	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,219,820)
2023040303196	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,223,029)
2023040303198	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,224,220)
2023040303200	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,222,638)
2023040303202	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,222,558)
2023040303204	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,219,980)
2023040303206	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,219,785)
2023040303208	B	USDMXN	05/10/2023	888,889	18.25	(16,218,247)
2023041003698	BO	USDMXN	05/10/2023	76,750	18.28	(1,402,771)
2023050803249	B	USDMXN	05/10/2023	1,000,000	17.81	(17,806,030)
2023050803298	S	USDMXN	05/10/2023	(250,000)	17.79	4,448,700
2023050803300	S	USDMXN	05/10/2023	(250,000)	17.79	4,448,550
2023050803308	S	USDMXN	05/10/2023	(250,000)	17.79	4,448,500
2023050803353	S	USDMXN	05/10/2023	(25,000,000)	17.79	444,830,000
2023050803364	S	USDMXN	05/10/2023	(250,000)	17.79	4,448,375
2023050803383	S	USDMXN	05/10/2023	(1,000,000)	17.79	17,786,680
2023050803620	S	USDMXN	05/10/2023	(1,000,000)	17.79	17,785,800
2023050803624	S	USDMXN	05/10/2023	(500,000)	17.79	8,893,050
2023050803626	S	USDMXN	05/10/2023	(500,000)	17.79	8,893,050
2023050803628	S	USDMXN	05/10/2023	(3,050,000)	17.79	54,247,300
2023050803630	S	USDMXN	05/10/2023	(1,120,000)	17.79	19,920,992
2023050803634	S	USDMXN	05/10/2023	(1,120,000)	17.79	19,920,992
2023050903318	B	USDMXN	05/10/2023	8,600,000	17.77	(152,846,080)
2023050903324	B	USDMXN	05/10/2023	3,800,000	17.77	(67,536,640)
2023050903367	S	USDMXN	05/10/2023	(102,216)	17.76	1,814,895
2022070503328	SO	USDMXN	05/11/2023	(245,186)	21.83	5,353,068
2022071903278	SO	USDMXN	05/11/2023	(247,033)	21.66	5,349,857
2022111003752	BO	USDMXN	05/11/2023	150,000	19.99	(2,997,815)
2022111103346	BO	USDMXN	05/11/2023	71,658	20.17	(1,445,126)
2022112303206	B	USDMXN	05/11/2023	6,450,000	19.98	(128,865,924)
2022113003417	B	USDMXN	05/11/2023	1,754,307	19.96	(35,022,122)
2023010603621	B	USDMXN	05/11/2023	150,000	19.59	(2,937,984)
2023021303621	BO	USDMXN	05/11/2023	50,000	18.91	(945,721)
2023021403399	BO	USDMXN	05/11/2023	100,000	18.83	(1,883,079)
2023021403586	BO	USDMXN	05/11/2023	10,000	18.85	(188,453)
2023021703660	BO	USDMXN	05/11/2023	60,000	18.65	(1,118,952)
2023022003323	BO	USDMXN	05/11/2023	60,000	18.67	(1,120,470)
2023022803840	BO	USDMXN	05/11/2023	60,000	18.55	(1,112,919)
2023030303410	BO	USDMXN	05/11/2023	60,000	18.25	(1,094,965)
2023032203253	B	USDMXN	05/11/2023	61,600	18.71	(1,152,374)
2023032803591	BO	USDMXN	05/11/2023	40,400	18.38	(742,677)
2023032903275	BO	USDMXN	05/11/2023	153,090	18.26	(2,795,803)
2023033103558	BO	USDMXN	05/11/2023	30,000	18.14	(544,227)
2023033103844	BO	USDMXN	05/11/2023	185,460	18.16	(3,367,564)
2023041103434	BO	USDMXN	05/11/2023	115,000	18.29	(2,102,964)
2023041203249	BO	USDMXN	05/11/2023	30,000	18.18	(545,382)
2023041203614	BO	USDMXN	05/11/2023	56,600	18.19	(1,029,782)
2023041303048	BO	USDMXN	05/11/2023	600	18.13	(10,876)
2023042103492	S	USDMXN	05/11/2023	(162,600)	18.07	2,938,147
2023042403436	BO	USDMXN	05/11/2023	26,100	18.03	(470,652)
2023042703405	BO	USDMXN	05/11/2023	112,984	18.10	(2,044,670)
2023042703699	BO	USDMXN	05/11/2023	96,168	18.09	(1,739,640)
2023050203759	BO	USDMXN	05/11/2023	62,452	18.00	(1,124,427)
2023050403451	B	USDMXN	05/11/2023	237,000	17.93	(4,249,521)
2023050903041	B	USDMXN	05/11/2023	1,000,000	17.76	(17,762,540)
2023050903060	B	USDMXN	05/11/2023	1,000,000	17.76	(17,757,830)
2023050903354	B	USDMXN	05/11/2023	1,000,000	17.76	(17,760,000)
2023050903491	B	USDMXN	05/11/2023	9,825,867	17.76	(174,536,289)
2023050903494	B	USDMXN	05/11/2023	456,603	17.77	(8,111,601)
2023050903146	S	USDMXN	05/11/2023	(1,000,000)	17.75	17,750,000
2023050903300	S	USDMXN	05/11/2023	(3,000,000)	17.78	53,328,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050903546	S	USDMXN	05/11/2023	(1,800,000)	17.76	31,959,000
2023051103073	B	USDMXN	05/11/2023	100,000,000	17.65	(1,765,000,000)
2023051103075	B	USDMXN	05/11/2023	100,000,000	17.65	(1,765,000,000)
2023051103040	S	USDMXN	05/11/2023	(100,000,000)	17.67	1,766,500,000
2023051103042	S	USDMXN	05/11/2023	(100,000,000)	17.68	1,767,500,000
2022051303483	S	USDMXN	05/12/2023	(158,750)	21.60	3,429,683
2022051603208	BO	USDMXN	05/12/2023	250,000	21.55	(5,388,200)
2022101303272	BO	USDMXN	05/12/2023	200,000	20.77	(4,154,901)
2022110803171	B	USDMXN	05/12/2023	250,000	20.14	(5,034,327)
2023011803540	BO	USDMXN	05/12/2023	25,000	19.23	(480,791)
2023012003451	BO	USDMXN	05/12/2023	491,031	19.25	(9,452,013)
2023013003402	B	USDMXN	05/12/2023	3,300,000	19.13	(63,130,109)
2023020203503	B	USDMXN	05/12/2023	300,000	19.00	(5,699,402)
2023021403588	BO	USDMXN	05/12/2023	50,000	18.85	(942,449)
2023032703137	B	USDMXN	05/12/2023	500,000	18.56	(9,281,500)
2023032703242	B	USDMXN	05/12/2023	500,000	18.54	(9,268,566)
2023040503407	BO	USDMXN	05/12/2023	150,000	18.22	(2,733,095)
2023041003195	B	USDMXN	05/12/2023	153,846	18.28	(2,812,005)
2023042003132	BO	USDMXN	05/12/2023	300,000	18.11	(5,433,375)
2023042103494	S	USDMXN	05/12/2023	(258,000)	18.07	4,663,040
2023050203359	B	USDMXN	05/12/2023	81,818	18.05	(1,476,978)
2023050503410	BO	USDMXN	05/12/2023	95,238	17.78	(1,693,186)
2023051003165	B	USDMXN	05/12/2023	2,000,000	17.62	(35,241,140)
2023051003205	B	USDMXN	05/12/2023	5,000,000	17.59	(87,925,000)
2023051003220	B	USDMXN	05/12/2023	5,000,000	17.58	(87,881,500)
2023051003309	B	USDMXN	05/12/2023	3,000,000	17.65	(52,962,000)
2023051003199	S	USDMXN	05/12/2023	(1,000,000)	17.59	17,594,650
2023051003202	S	USDMXN	05/12/2023	(500,000)	17.59	8,794,655
2023051003237	S	USDMXN	05/12/2023	(500,000)	17.57	8,785,300
2023051003312	S	USDMXN	05/12/2023	(3,000,000)	17.65	52,962,000
2023051003470	S	USDMXN	05/12/2023	(3,000,000)	17.57	52,710,000
2023051003542	S	USDMXN	05/12/2023	(500,000)	17.56	8,782,400
2023051003544	S	USDMXN	05/12/2023	(200,000)	17.56	3,512,960
2023051103041	B	USDMXN	05/12/2023	100,000,000	17.67	(1,766,840,000)
2023051103043	B	USDMXN	05/12/2023	100,000,000	17.68	(1,767,840,000)
2023051103084	BO	USDMXN	05/12/2023	10,000,000	17.63	(176,323,990)
2023051103133	BO	USDMXN	05/12/2023	10,000,000	17.63	(176,256,990)
2023051103015	S	USDMXN	05/12/2023	(164,000,000)	17.66	2,895,420,000
2022013103141	B	USDMXN	05/15/2023	668,195	22.59	(15,092,244)
2022030703256	SO	USDMXN	05/15/2023	(100,000)	23.03	2,302,544
2022032403647	B	USDMXN	05/15/2023	604,707	21.78	(13,167,797)
2022091403444	BO	USDMXN	05/15/2023	282,900	20.82	(5,890,735)
2022091403505	BO	USDMXN	05/15/2023	58	20.85	(1,210)
2022102503680	B	USDMXN	05/15/2023	282,958	20.63	(5,838,294)
2022110403289	BO	USDMXN	05/15/2023	282,958	20.23	(5,723,412)
2022110703619	BO	USDMXN	05/15/2023	100,000	20.15	(2,015,217)
2022111003724	BO	USDMXN	05/15/2023	479,199	20.00	(9,583,986)
2023030703583	B	USDMXN	05/15/2023	1,649,057	18.36	(30,270,418)
2023031003602	SO	USDMXN	05/15/2023	(175,000)	18.73	3,277,204
2023031403091	SO	USDMXN	05/15/2023	(175,000)	19.32	3,381,151
2023032103480	B	USDMXN	05/15/2023	3,603,835	18.84	(67,910,642)
2023032303484	S	USDMXN	05/15/2023	(1,349,460)	18.77	25,333,292
2023032303489	S	USDMXN	05/15/2023	(319,568)	18.79	6,004,715
2023032303491	S	USDMXN	05/15/2023	(135,524)	18.79	2,546,570
2023032303495	S	USDMXN	05/15/2023	(1,045,877)	18.80	19,665,003
2023032803575	B	USDMXN	05/15/2023	4,454,901	18.39	(81,937,646)
2023040403484	B	USDMXN	05/15/2023	1,464,641	18.25	(26,727,761)
2023041803524	S	USDMXN	05/15/2023	(3,624,121)	18.14	65,755,230
2023042003485	B	USDMXN	05/15/2023	2,156,760	18.11	(39,062,791)
2023042003495	B	USDMXN	05/15/2023	581,200	18.11	(10,527,344)
2023042503489	S	USDMXN	05/15/2023	(17,747,436)	18.18	322,584,840
2023042603589	BO	USDMXN	05/15/2023	86,000	18.22	(1,566,716)
2023042603495	S	USDMXN	05/15/2023	(397,000)	18.19	7,222,176



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042703278	BO	USDMXN	05/15/2023	141,000	18.13	(2,556,294)
2023042703280	BO	USDMXN	05/15/2023	74,301	18.13	(1,346,790)
2023050203622	S	USDMXN	05/15/2023	(13,054,776)	18.02	235,248,147
2023050203624	S	USDMXN	05/15/2023	(5,749,719)	18.02	103,592,182
2023050403555	B	USDMXN	05/15/2023	1,149,042	17.94	(20,610,624)
2023050403560	B	USDMXN	05/15/2023	1,981,322	17.94	(35,538,699)
2023050403565	B	USDMXN	05/15/2023	2,776,241	17.93	(49,786,510)
2023050903470	B	USDMXN	05/15/2023	2,472,027	17.78	(43,951,570)
2023051103016	B	USDMXN	05/15/2023	164,000,000	17.67	(2,897,092,800)
2023051103054	B	USDMXN	05/15/2023	10,000,000	17.68	(176,750,000)
2023051103056	B	USDMXN	05/15/2023	10,000,000	17.68	(176,800,000)
2023051103126	B	USDMXN	05/15/2023	582,000	17.64	(10,265,363)
2023051103059	S	USDMXN	05/15/2023	(10,000,000)	17.67	176,658,000
2023051103065	S	USDMXN	05/15/2023	(10,000,000)	17.66	176,571,000
2023051103074	S	USDMXN	05/15/2023	(100,000,000)	17.66	1,766,420,000
2023051103076	S	USDMXN	05/15/2023	(100,000,000)	17.66	1,766,420,000
2023051103286	S	USDMXN	05/15/2023	(582,000)	17.62	10,253,152
2023051103527	S	USDMXN	05/15/2023	(1,000,000)	17.59	17,590,370
2023051203208	B	USDMXN	05/15/2023	100,000,000	17.60	(1,760,000,000)
2023051203210	B	USDMXN	05/15/2023	100,000,000	17.60	(1,760,000,000)
2023051203066	S	USDMXN	05/15/2023	(74,000,000)	17.59	1,301,660,000
2023051203071	S	USDMXN	05/15/2023	(100,000,000)	17.61	1,761,000,000
2022110703441	BO	USDMXN	05/16/2023	100,000	20.15	(2,015,242)
2023012503356	BO	USDMXN	05/16/2023	20,000	19.21	(384,244)
2023013003472	BO	USDMXN	05/16/2023	40,000	19.15	(766,004)
2023020203580	BO	USDMXN	05/16/2023	20,000	19.05	(380,901)
2023021603588	BO	USDMXN	05/16/2023	50,000	18.80	(939,825)
2023032903320	BO	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	18.24	(18,243,331)
2023040503410	BO	USDMXN	05/16/2023	150,000	18.24	(2,735,284)
2023041003197	B	USDMXN	05/16/2023	153,846	18.29	(2,814,328)
2023041803621	BO	USDMXN	05/16/2023	103,591	18.15	(1,879,890)
2023051203040	B	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	17.58	(17,580,990)
2023051203063	B	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	17.62	(17,617,090)
2023051203067	B	USDMXN	05/16/2023	74,000,000	17.59	(1,301,911,600)
2023051203068	B	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	17.62	(17,620,510)
2023051203072	B	USDMXN	05/16/2023	100,000,000	17.61	(1,761,340,000)
2023051203202	B	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	17.61	(17,613,270)
2023051203308	B	USDMXN	05/16/2023	1,000,000	17.62	(17,615,240)
2023051203050	S	USDMXN	05/16/2023	(2,000,000)	17.57	35,137,900
2023051203051	S	USDMXN	05/16/2023	(1,000,000)	17.58	17,575,390
2023051203209	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000,000)	17.60	1,760,355,000
2023051203211	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000,000)	17.60	1,760,355,000
2023051203279	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000)	17.63	1,763,210
2023051203281	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000)	17.63	1,763,260
2023051203283	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000)	17.63	1,763,270
2023051203286	S	USDMXN	05/16/2023	(100,000)	17.63	1,763,210
2023051203379	S	USDMXN	05/16/2023	(1,000,000)	17.60	17,599,250
2023051203384	S	USDMXN	05/16/2023	(579,000)	17.60	10,192,172
2023051203457	S	USDMXN	05/16/2023	(207,200)	17.58	3,642,431
2023051203474	S	USDMXN	05/16/2023	(135,350)	17.59	2,380,942
2023051503313	B	USDMXN	05/16/2023	100,000,000	17.60	(1,760,000,000)
2023051503316	B	USDMXN	05/16/2023	100,000,000	17.60	(1,760,000,000)
2023051503167	S	USDMXN	05/16/2023	(25,000,000)	17.57	439,250,000
2023051503182	S	USDMXN	05/16/2023	(125,000,000)	17.57	2,196,250,000
2023051603300	S	USDMXN	05/16/2023	(20,000,000)	17.45	349,000,000
2022111503635	B	USDMXN	05/17/2023	401,192	20.02	(8,030,680)
2022111503733	BO	USDMXN	05/17/2023	364	20.02	(7,289)
2022111503752	SO	USDMXN	05/17/2023	(364)	20.00	7,280
2022111703236	BO	USDMXN	05/17/2023	927,979	20.08	(18,632,785)
2022111703726	B	USDMXN	05/17/2023	1,610,417	20.06	(32,309,234)
2022111803683	B	USDMXN	05/17/2023	304,168	20.08	(6,108,522)
2022112903721	B	USDMXN	05/17/2023	117,264	19.83	(2,324,805)
2023010403584	BO	USDMXN	05/17/2023	534,014	19.86	(10,603,613)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023011303862	BO	USDMXN	05/17/2023	121,537	19.21	(2,334,554)
2023011703249	B	USDMXN	05/17/2023	2,600,000	19.17	(49,839,540)
2023011903679	BO	USDMXN	05/17/2023	40,129	19.45	(780,620)
2023012603540	B	USDMXN	05/17/2023	405,497	19.18	(7,779,089)
2023020103650	B	USDMXN	05/17/2023	52,298	18.98	(992,365)
2023020803248	BO	USDMXN	05/17/2023	573,000	19.31	(11,061,870)
2023020803363	BO	USDMXN	05/17/2023	965	19.29	(18,627)
2023021003697	BO	USDMXN	05/17/2023	993,428	19.00	(18,878,956)
2023022103715	BO	USDMXN	05/17/2023	124,809	18.75	(2,340,749)
2023030603471	BO	USDMXN	05/17/2023	54,800	18.24	(999,369)
2023030603472	BO	USDMXN	05/17/2023	700	18.23	(12,764)
2023032903276	BO	USDMXN	05/17/2023	153,090	18.28	(2,799,072)
2023032903480	BO	USDMXN	05/17/2023	64,560	18.26	(1,178,760)
2023033103845	BO	USDMXN	05/17/2023	51,030	18.18	(927,683)
2023040303481	B	USDMXN	05/17/2023	4,520,382	18.26	(82,552,372)
2023041203272	BO	USDMXN	05/17/2023	459,270	18.19	(8,355,200)
2023041203494	BO	USDMXN	05/17/2023	24,400	18.22	(444,588)
2023041203503	BO	USDMXN	05/17/2023	23,300	18.22	(424,427)
2023041303248	B	USDMXN	05/17/2023	222,242	18.14	(4,030,577)
2023041403487	B	USDMXN	05/17/2023	23,116,736	18.14	(419,396,502)
2023041403496	BO	USDMXN	05/17/2023	111,100	18.14	(2,015,678)
2023041403534	BO	USDMXN	05/17/2023	54,000	18.14	(979,502)
2023041803624	B	USDMXN	05/17/2023	107,600	18.15	(1,953,190)
2023042003520	B	USDMXN	05/17/2023	157,902	18.12	(2,861,685)
2023042503135	BO	USDMXN	05/17/2023	27,600	18.14	(500,738)
2023042703195	B	USDMXN	05/17/2023	7,958,744	18.13	(144,304,558)
2023042803778	BO	USDMXN	05/17/2023	127,200	18.03	(2,293,909)
2023050203760	BO	USDMXN	05/17/2023	194,280	18.03	(3,502,364)
2023050303261	BO	USDMXN	05/17/2023	33,284	17.95	(597,462)
2023050503356	BO	USDMXN	05/17/2023	33,000	17.79	(587,182)
2023050503359	BO	USDMXN	05/17/2023	712	17.81	(12,678)
2023050503715	B	USDMXN	05/17/2023	61,500	17.82	(1,095,711)
2023050803055	BO	USDMXN	05/17/2023	234,308	17.84	(4,179,829)
2023050803235	BO	USDMXN	05/17/2023	33,804	17.85	(603,319)
2023051003550	BO	USDMXN	05/17/2023	15,000	17.59	(263,778)
2023051503158	B	USDMXN	05/17/2023	1,000,000	17.56	(17,563,590)
2023051503163	B	USDMXN	05/17/2023	1,000,000	17.56	(17,563,690)
2023051503168	B	USDMXN	05/17/2023	25,000,000	17.57	(439,336,250)
2023051503183	B	USDMXN	05/17/2023	125,000,000	17.57	(2,196,687,500)
2023051503483	B	USDMXN	05/17/2023	1,000,000	17.51	(17,510,000)
2023051503284	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.55	17,546,100
2023051503286	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.55	17,546,300
2023051503288	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.55	17,546,300
2023051503290	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.55	17,546,300
2023051503292	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.55	17,546,400
2023051503314	S	USDMXN	05/17/2023	(100,000,000)	17.60	1,760,360,000
2023051503317	S	USDMXN	05/17/2023	(100,000,000)	17.60	1,760,360,000
2023051503731	S	USDMXN	05/17/2023	(700,000)	17.43	12,202,372
2023051603040	B	USDMXN	05/17/2023	604,206	17.51	(10,580,267)
2023051603042	B	USDMXN	05/17/2023	604,206	17.51	(10,580,267)
2023051603053	B	USDMXN	05/17/2023	604,206	17.51	(10,580,267)
2023051603123	B	USDMXN	05/17/2023	100,000,000	17.50	(1,750,000,000)
2023051603126	B	USDMXN	05/17/2023	100,000,000	17.50	(1,750,000,000)
2023051603050	S	USDMXN	05/17/2023	(170,000,000)	17.50	2,975,000,000
2023051703101	S	USDMXN	05/17/2023	(3,800,000)	17.62	66,956,000
2022071803146	BO	USDMXN	05/18/2023	4,450,000	21.62	(96,220,841)
2022081603257	B	USDMXN	05/18/2023	20,000,000	20.97	(419,413,600)
2022111103344	BO	USDMXN	05/18/2023	71,658	20.19	(1,447,002)
2022113003419	B	USDMXN	05/18/2023	1,754,307	19.99	(35,073,697)
2023010603623	B	USDMXN	05/18/2023	150,000	19.61	(2,941,796)
2023011103570	BO	USDMXN	05/18/2023	100,000	19.45	(1,945,489)
2023022803841	BO	USDMXN	05/18/2023	60,000	18.57	(1,114,390)
2023030303412	BO	USDMXN	05/18/2023	60,000	18.27	(1,096,418)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023033103557	BO	USDMXN	05/18/2023	30,000	18.17	(544,957)
2023041203248	BO	USDMXN	05/18/2023	60,000	18.20	(1,092,240)
2023042003399	B	USDMXN	05/18/2023	60,000	18.11	(1,086,837)
2023042103324	BO	USDMXN	05/18/2023	17,312	18.09	(313,179)
2023042403651	BO	USDMXN	05/18/2023	30,000	18.06	(541,813)
2023050303173	BO	USDMXN	05/18/2023	500,000	17.96	(8,979,725)
2023050303531	BO	USDMXN	05/18/2023	500,000	17.92	(8,961,718)
2023050403455	BO	USDMXN	05/18/2023	237,000	17.94	(4,250,607)
2023051103220	BO	USDMXN	05/18/2023	2,637	17.63	(46,490)
2023051603051	B	USDMXN	05/18/2023	170,000,000	17.50	(2,975,595,000)
2023051603301	B	USDMXN	05/18/2023	20,000,000	17.46	(349,136,000)
2023051603629	B	USDMXN	05/18/2023	3,368,798	17.46	(58,821,906)
2023051603632	B	USDMXN	05/18/2023	2,047,714	17.46	(35,759,639)
2023051603680	B	USDMXN	05/18/2023	3,562,790	17.47	(62,241,941)
2023051603041	S	USDMXN	05/18/2023	(604,206)	17.51	10,582,299
2023051603043	S	USDMXN	05/18/2023	(604,206)	17.51	10,582,299
2023051603054	S	USDMXN	05/18/2023	(604,206)	17.51	10,582,299
2023051603124	S	USDMXN	05/18/2023	(100,000,000)	17.50	1,750,360,000
2023051603127	S	USDMXN	05/18/2023	(100,000,000)	17.50	1,750,360,000
2023051603149	S	USDMXN	05/18/2023	(375,103)	17.47	6,552,787
2023051603152	S	USDMXN	05/18/2023	(367,881)	17.47	6,426,476
2023051603154	S	USDMXN	05/18/2023	(411,191)	17.47	7,183,054
2023051603320	S	USDMXN	05/18/2023	(2,000,000)	17.47	34,940,000
2023051603551	S	USDMXN	05/18/2023	(110,000)	17.46	1,920,600
2023051603582	S	USDMXN	05/18/2023	(55,000,000)	17.46	960,135,000
2023051603655	S	USDMXN	05/18/2023	(582,000)	17.46	10,160,847
2023051603659	S	USDMXN	05/18/2023	(2,980,790)	17.46	52,048,447
2023051603817	S	USDMXN	05/18/2023	(55,000,000)	17.46	960,135,000
2023051703102	B	USDMXN	05/18/2023	3,800,000	17.62	(66,968,540)
2023051703541	B	USDMXN	05/18/2023	100,000,000	17.55	(1,755,000,000)
2023051703543	B	USDMXN	05/18/2023	100,000,000	17.55	(1,755,000,000)
2023051703535	S	USDMXN	05/18/2023	(150,000,000)	17.55	2,632,500,000
2023051703538	S	USDMXN	05/18/2023	(100,000,000)	17.55	1,755,000,000
2022052003380	SO	USDMXN	05/19/2023	(158,750)	21.32	3,384,771
2022070603457	SO	USDMXN	05/19/2023	(229)	21.94	5,023
2022110803174	B	USDMXN	05/19/2023	250,000	20.16	(5,041,094)
2022120503513	SO	USDMXN	05/19/2023	(75,000)	20.29	1,521,848
2023011303309	B	USDMXN	05/19/2023	967,327	19.22	(18,592,394)
2023012003449	BO	USDMXN	05/19/2023	390,608	19.28	(7,529,120)
2023013003409	B	USDMXN	05/19/2023	3,300,000	19.15	(63,211,398)
2023022303529	BO	USDMXN	05/19/2023	20,000	18.68	(373,512)
2023042803499	BO	USDMXN	05/19/2023	100,000	18.06	(1,806,345)
2023050203361	B	USDMXN	05/19/2023	81,818	18.08	(1,479,011)
2023050503411	BO	USDMXN	05/19/2023	95,238	17.80	(1,695,613)
2023051003543	B	USDMXN	05/19/2023	500,000	17.59	(8,794,899)
2023051703536	B	USDMXN	05/19/2023	150,000,000	17.55	(2,633,040,000)
2023051703539	B	USDMXN	05/19/2023	100,000,000	17.55	(1,755,365,000)
2023051703728	B	USDMXN	05/19/2023	229,000	17.58	(4,026,718)
2023051703202	S	USDMXN	05/19/2023	(5,000,000)	17.60	88,000,000
2023051703270	S	USDMXN	05/19/2023	(1,500,000)	17.58	26,373,750
2023051703272	S	USDMXN	05/19/2023	(1,000,000)	17.58	17,582,300
2023051703542	S	USDMXN	05/19/2023	(100,000,000)	17.55	1,755,370,000
2023051703544	S	USDMXN	05/19/2023	(100,000,000)	17.55	1,755,370,000
2023051703553	S	USDMXN	05/19/2023	(800,000)	17.56	14,049,440
2023051703567	S	USDMXN	05/19/2023	(70,864)	17.56	1,244,620
2023051703569	S	USDMXN	05/19/2023	(84,713)	17.56	1,487,899
2023051903042	B	USDMXN	05/19/2023	100,000,000	17.70	(1,770,000,000)
2023051903044	B	USDMXN	05/19/2023	100,000,000	17.70	(1,770,000,000)
2023051903027	S	USDMXN	05/19/2023	(19,000,000)	17.69	336,110,000
2023051903029	S	USDMXN	05/19/2023	(141,000,000)	17.69	2,494,290,000
2023051903031	S	USDMXN	05/19/2023	(56,000,000)	17.69	990,640,000
2023051903523	S	USDMXN	05/19/2023	(19,000,000)	17.69	336,110,000
2023051903525	S	USDMXN	05/19/2023	(141,000,000)	17.69	2,494,290,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023051903527	S	USDMXN	05/19/2023	(56,000,000)	17.69	990,640,000
2023022303530	BO	USDMXN	05/22/2023	10,000	18.69	(186,888)
2023050303612	SO	USDMXN	05/22/2023	(126,000)	17.95	2,261,644
2023051803039	S	USDMXN	05/22/2023	(1,000,000)	17.74	17,739,720
2023051803304	S	USDMXN	05/22/2023	(582,000)	17.75	10,327,881
2023051803482	S	USDMXN	05/22/2023	(582,000)	17.71	10,308,326
2023051903028	B	USDMXN	05/22/2023	19,000,000	17.71	(336,410,200)
2023051903030	B	USDMXN	05/22/2023	141,000,000	17.71	(2,496,517,800)
2023051903032	B	USDMXN	05/22/2023	56,000,000	17.71	(991,524,800)
2023051903524	B	USDMXN	05/22/2023	19,000,000	17.71	(336,410,200)
2023051903526	B	USDMXN	05/22/2023	141,000,000	17.71	(2,496,517,800)
2023051903528	B	USDMXN	05/22/2023	56,000,000	17.71	(991,524,800)
2023051903043	S	USDMXN	05/22/2023	(100,000,000)	17.72	1,771,660,000
2023051903045	S	USDMXN	05/22/2023	(100,000,000)	17.72	1,771,660,000
2023052203500	B	USDMXN	05/22/2023	100,000,000	17.89	(1,789,000,000)
2023052203502	B	USDMXN	05/22/2023	100,000,000	17.89	(1,789,000,000)
2023052203495	S	USDMXN	05/22/2023	(100,000,000)	17.89	1,789,000,000
2023052203497	S	USDMXN	05/22/2023	(100,000,000)	17.89	1,789,000,000
2022110703442	BO	USDMXN	05/23/2023	100,000	20.18	(2,017,944)
2023012503357	BO	USDMXN	05/23/2023	20,000	19.24	(384,759)
2023013003475	BO	USDMXN	05/23/2023	50,000	19.18	(958,771)
2023020203582	BO	USDMXN	05/23/2023	20,000	19.07	(381,393)
2023022203463	BO	USDMXN	05/23/2023	50,000	18.64	(931,801)
2023022303531	BO	USDMXN	05/23/2023	10,000	18.69	(186,928)
2023040503408	BO	USDMXN	05/23/2023	150,000	18.26	(2,739,115)
2023041003199	B	USDMXN	05/23/2023	153,846	18.32	(2,818,316)
2023042703206	B	USDMXN	05/23/2023	1,904,368	18.16	(34,578,725)
2023042703472	BO	USDMXN	05/23/2023	70,680	18.13	(1,281,773)
2023050803631	B	USDMXN	05/23/2023	1,120,000	17.83	(19,974,758)
2023050803635	B	USDMXN	05/23/2023	1,120,000	17.83	(19,974,758)
2023051903137	B	USDMXN	05/23/2023	1,000,000	17.70	(17,695,890)
2023051903494	B	USDMXN	05/23/2023	1,000,000	17.75	(17,750,510)
2022062903455	SO	USDMXN	05/24/2023	(279,877)	21.43	5,998,919
2022070503333	SO	USDMXN	05/24/2023	(274,173)	21.89	6,000,891
2022112303614	B	USDMXN	05/24/2023	2,000,000	20.00	(40,000,918)
2022112903044	BO	USDMXN	05/24/2023	250,000	19.75	(4,937,066)
2022122803069	B	USDMXN	05/24/2023	1,700,000	19.99	(33,977,407)
2023011003591	B	USDMXN	05/24/2023	272,000	19.55	(5,316,444)
2023022303533	BO	USDMXN	05/24/2023	40,000	18.69	(747,770)
2023031303394	B	USDMXN	05/24/2023	50,000,000	19.18	(958,928,800)
2023032403377	B	USDMXN	05/24/2023	244,018	18.69	(4,559,644)
2023032803592	BO	USDMXN	05/24/2023	13,600	18.43	(250,630)
2023032903277	BO	USDMXN	05/24/2023	204,120	18.31	(3,737,200)
2023032903531	BO	USDMXN	05/24/2023	120,000	18.30	(2,195,775)
2023042503136	BO	USDMXN	05/24/2023	71,050	18.17	(1,290,939)
2023042703407	BO	USDMXN	05/24/2023	86,000	18.14	(1,560,436)
2023042803779	BO	USDMXN	05/24/2023	37,804	18.06	(682,724)
2023050203761	BO	USDMXN	05/24/2023	37,404	18.05	(675,284)
2023050303263	BO	USDMXN	05/24/2023	28,716	17.98	(516,193)
2023050303600	BO	USDMXN	05/24/2023	488	17.98	(8,775)
2023050503717	B	USDMXN	05/24/2023	61,500	17.84	(1,097,252)
2023050903368	B	USDMXN	05/24/2023	102,216	17.81	(1,820,021)
2023050903577	BO	USDMXN	05/24/2023	35,508	17.83	(632,948)
2023051003552	BO	USDMXN	05/24/2023	15,000	17.61	(264,142)
2023051203765	BO	USDMXN	05/24/2023	262,700	17.61	(4,625,557)
2023052203148	B	USDMXN	05/24/2023	1,000,000	17.88	(17,884,630)
2023052203188	B	USDMXN	05/24/2023	10,000,000	17.85	(178,529,100)
2023052203197	B	USDMXN	05/24/2023	10,000,000	17.85	(178,450,000)
2023052203484	B	USDMXN	05/24/2023	1,000,000	17.91	(17,907,450)
2023052203496	B	USDMXN	05/24/2023	100,000,000	17.90	(1,790,110,000)
2023052203498	B	USDMXN	05/24/2023	100,000,000	17.90	(1,790,110,000)
2023052203171	S	USDMXN	05/24/2023	(1,000,000)	17.85	17,849,060
2023052203179	S	USDMXN	05/24/2023	(3,000,000)	17.86	53,568,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023052203180	S	USDMXN	05/24/2023	(3,000,000)	17.86	53,568,000
2023052203196	S	USDMXN	05/24/2023	(4,000,000)	17.84	71,360,000
2023052203307	S	USDMXN	05/24/2023	(1,000,000)	17.88	17,884,810
2023052203401	S	USDMXN	05/24/2023	(582,000)	17.88	10,409,012
2023052203501	S	USDMXN	05/24/2023	(100,000,000)	17.90	1,790,150,000
2023052203503	S	USDMXN	05/24/2023	(100,000,000)	17.90	1,790,150,000
2023052303139	B	USDMXN	05/24/2023	94,549,499	17.98	(1,700,000,000)
2023052303153	B	USDMXN	05/24/2023	100,000,000	17.95	(1,795,000,000)
2023052303155	B	USDMXN	05/24/2023	100,000,000	17.95	(1,795,000,000)
2023052303024	S	USDMXN	05/24/2023	(30,000,000)	17.97	539,100,000
2023052303026	S	USDMXN	05/24/2023	(30,000,000)	17.97	539,100,000
2023052303141	S	USDMXN	05/24/2023	(10,000,000)	17.99	179,850,000
2023052303160	S	USDMXN	05/24/2023	(50,000,000)	17.98	899,000,000
2023052303165	S	USDMXN	05/24/2023	(94,549,499)	17.98	1,700,000,000
2023052303187	S	USDMXN	05/24/2023	(31,000)	17.95	556,386
2023052403051	S	USDMXN	05/24/2023	(3,800,000)	17.78	67,564,000
2022052603124	B	USDMXN	05/25/2023	360,000	21.25	(7,648,349)
2022062903415	SO	USDMXN	05/25/2023	(249,011)	21.49	5,351,099
2022070503331	SO	USDMXN	05/25/2023	(244,527)	21.89	5,352,480
2022071203267	SO	USDMXN	05/25/2023	(242,000)	22.00	5,325,017
2022071203277	SO	USDMXN	05/25/2023	(81)	22.01	1,786
2022071303308	S	USDMXN	05/25/2023	(330,000)	21.95	7,243,255
2022071903279	SO	USDMXN	05/25/2023	(246,419)	21.71	5,350,658
2022102803739	SO	USDMXN	05/25/2023	(30,000)	20.57	616,959
2022111103347	BO	USDMXN	05/25/2023	71,658	20.22	(1,448,977)
2022112503216	BO	USDMXN	05/25/2023	1,100,000	19.99	(21,992,130)
2022112503518	BO	USDMXN	05/25/2023	336	19.99	(6,709)
2022113003421	B	USDMXN	05/25/2023	1,754,307	20.02	(35,117,009)
2022120603288	SO	USDMXN	05/25/2023	(287,470)	20.44	5,874,685
2023010603625	B	USDMXN	05/25/2023	150,000	19.64	(2,945,638)
2023022303536	BO	USDMXN	05/25/2023	20,000	18.70	(373,997)
2023030303587	BO	USDMXN	05/25/2023	100,000	18.27	(1,827,305)
2023033103559	BO	USDMXN	05/25/2023	30,000	18.19	(545,687)
2023041203247	BO	USDMXN	05/25/2023	60,000	18.23	(1,093,742)
2023042003401	B	USDMXN	05/25/2023	60,000	18.14	(1,088,225)
2023042403650	BO	USDMXN	05/25/2023	60,000	18.09	(1,085,158)
2023042403691	BO	USDMXN	05/25/2023	250,000	18.08	(4,520,461)
2023050303174	BO	USDMXN	05/25/2023	500,000	17.99	(8,992,571)
2023050303532	BO	USDMXN	05/25/2023	500,000	17.95	(8,974,352)
2023050403454	BO	USDMXN	05/25/2023	237,000	17.96	(4,256,609)
2023051003545	B	USDMXN	05/25/2023	200,000	17.61	(3,522,177)
2023052303017	B	USDMXN	05/25/2023	5,000,000	17.96	(89,823,100)
2023052303025	B	USDMXN	05/25/2023	30,000,000	17.98	(539,295,000)
2023052303027	B	USDMXN	05/25/2023	30,000,000	17.98	(539,295,000)
2023052303142	B	USDMXN	05/25/2023	10,000,000	17.99	(179,915,000)
2023052303161	B	USDMXN	05/25/2023	50,000,000	17.99	(899,325,000)
2023052303166	B	USDMXN	05/25/2023	94,515,331	17.99	(1,700,000,000)
2023052303177	B	USDMXN	05/25/2023	1,000,000	17.95	(17,949,570)
2023052303190	B	USDMXN	05/25/2023	34,168	17.96	(613,598)
2023052303316	B	USDMXN	05/25/2023	1,000,000	17.96	(17,955,000)
2023052303517	B	USDMXN	05/25/2023	4,031,391	17.97	(72,436,717)
2023052303580	B	USDMXN	05/25/2023	22,000,000	17.98	(395,604,000)
2023052303140	S	USDMXN	05/25/2023	(94,515,331)	17.99	1,700,000,000
2023052303154	S	USDMXN	05/25/2023	(100,000,000)	17.96	1,795,680,000
2023052303156	S	USDMXN	05/25/2023	(100,000,000)	17.96	1,795,680,000
2023052303181	S	USDMXN	05/25/2023	(1,000,000)	17.94	17,935,610
2023052303258	S	USDMXN	05/25/2023	(1,000,000)	17.98	17,980,050
2023052303418	S	USDMXN	05/25/2023	(2,000,000)	17.98	35,950,000
2023052303476	S	USDMXN	05/25/2023	(2,000,000)	17.97	35,940,000
2023052303519	S	USDMXN	05/25/2023	(34,391)	17.97	617,953
2023052403052	B	USDMXN	05/25/2023	3,800,000	17.79	(67,584,140)
2023052403128	B	USDMXN	05/25/2023	100,000,000	17.82	(1,782,000,000)
2023052403130	B	USDMXN	05/25/2023	100,000,000	17.82	(1,782,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023052403487	B	USDMXN	05/25/2023	200.000	17.82	(3,563,378)
2023052403111	S	USDMXN	05/25/2023	(155,000,000)	17.82	2,762,100,000
2023052403124	S	USDMXN	05/25/2023	(60,000,000)	17.81	1,068,300,000
2022022403553	SO	USDMXN	05/26/2023	(100,000)	22.45	2,245,351
2022052703625	B	USDMXN	05/26/2023	1,825,000	21.06	(38,429,281)
2022052703629	S	USDMXN	05/26/2023	(1,825,000)	21.06	38,441,055
2022052703658	SO	USDMXN	05/26/2023	(158,750)	21.06	3,343,681
2022110803176	B	USDMXN	05/26/2023	250,000	20.19	(5,047,758)
2022111803400	BO	USDMXN	05/26/2023	200,000	20.15	(4,030,183)
2023011803543	BO	USDMXN	05/26/2023	25,000	19.28	(482,083)
2023012003452	BO	USDMXN	05/26/2023	235,375	19.30	(4,543,029)
2023013003412	B	USDMXN	05/26/2023	3,500,000	19.18	(67,117,015)
2023020203506	B	USDMXN	05/26/2023	300,000	19.05	(5,714,313)
2023030103335	BO	USDMXN	05/26/2023	50,000	18.53	(926,463)
2023032703426	B	USDMXN	05/26/2023	100,000	18.57	(1,857,270)
2023042403266	S	USDMXN	05/26/2023	(11,340,000)	18.13	205,574,003
2023042503137	BO	USDMXN	05/26/2023	193	18.18	(3,508)
2023050203364	B	USDMXN	05/26/2023	81,818	18.10	(1,481,099)
2023050203705	BO	USDMXN	05/26/2023	35,343	18.06	(638,172)
2023050303601	BO	USDMXN	05/26/2023	46,000	17.99	(827,569)
2023050503412	BO	USDMXN	05/26/2023	95,238	17.83	(1,698,030)
2023050503610	SO	USDMXN	05/26/2023	(270,000)	17.85	4,819,764
2023050503614	SO	USDMXN	05/26/2023	(3,000)	17.84	53,524
2023052403112	B	USDMXN	05/26/2023	155,000,000	17.83	(2,762,995,900)
2023052403125	B	USDMXN	05/26/2023	60,000,000	17.81	(1,068,630,000)
2023052403211	B	USDMXN	05/26/2023	1,000,000	17.83	(17,829,690)
2023052403212	B	USDMXN	05/26/2023	1,000,000	17.83	(17,828,450)
2023052403129	S	USDMXN	05/26/2023	(100,000,000)	17.83	1,782,580,000
2023052403131	S	USDMXN	05/26/2023	(100,000,000)	17.83	1,782,580,000
2023052403307	S	USDMXN	05/26/2023	(500,000)	17.82	8,908,600
2023052403422	S	USDMXN	05/26/2023	(1,000,000)	17.83	17,833,350
2023052403423	S	USDMXN	05/26/2023	(1,000,000)	17.83	17,833,590
2023052503277	B	USDMXN	05/26/2023	100,000,000	17.82	(1,782,000,000)
2023052503279	B	USDMXN	05/26/2023	100,000,000	17.82	(1,782,000,000)
2023052503001	S	USDMXN	05/26/2023	(10,000,000)	17.80	178,042,640
2023052503003	S	USDMXN	05/26/2023	(5,000,000)	17.81	89,066,290
2023052503115	S	USDMXN	05/26/2023	(100,000,000)	17.85	1,784,500,000
2023052503117	S	USDMXN	05/26/2023	(100,000,000)	17.82	1,782,000,000
2022030703261	SO	USDMXN	05/30/2023	(75,000)	23.10	1,732,331
2022110703620	BO	USDMXN	05/30/2023	75,000	20.21	(1,515,777)
2023011103571	BO	USDMXN	05/30/2023	100,000	19.50	(1,949,813)
2023012503358	BO	USDMXN	05/30/2023	20,000	19.26	(385,274)
2023021303497	BO	USDMXN	05/30/2023	20,000	18.98	(379,640)
2023022303675	B	USDMXN	05/30/2023	5,084,096	18.70	(95,050,129)
2023031003603	SO	USDMXN	05/30/2023	(125,000)	18.78	2,347,580
2023031403369	BO	USDMXN	05/30/2023	676,610	18.89	(12,783,374)
2023031403108	SO	USDMXN	05/30/2023	(125,000)	19.38	2,422,123
2023031503132	SO	USDMXN	05/30/2023	(200,000)	19.18	3,835,851
2023031603608	SO	USDMXN	05/30/2023	(1,900,000)	18.98	36,061,877
2023031603619	SO	USDMXN	05/30/2023	(43,313)	18.99	822,300
2023032203123	B	USDMXN	05/30/2023	500,000	18.80	(9,401,776)
2023032903461	BO	USDMXN	05/30/2023	400,000	18.35	(7,339,374)
2023033003635	S	USDMXN	05/30/2023	(2,137,531)	18.31	39,140,343
2023040403486	B	USDMXN	05/30/2023	360,655	18.30	(6,600,868)
2023040503411	BO	USDMXN	05/30/2023	150,000	18.29	(2,742,881)
2023041003201	B	USDMXN	05/30/2023	153,846	18.35	(2,822,429)
2023042003492	B	USDMXN	05/30/2023	863,393	18.17	(15,683,611)
2023042703281	BO	USDMXN	05/30/2023	586,042	18.18	(10,655,166)
2023050203706	BO	USDMXN	05/30/2023	69,460	18.07	(1,255,167)
2023050303346	BO	USDMXN	05/30/2023	200,000	17.99	(3,598,796)
2023050403556	S	USDMXN	05/30/2023	(1,149,042)	17.99	20,671,379
2023050803629	B	USDMXN	05/30/2023	3,050,000	17.86	(54,469,606)
2023050903471	S	USDMXN	05/30/2023	(2,472,027)	17.83	44,081,077



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050903477	S	USDMXN	05/30/2023	(1,641,186)	17.83	29,258,512
2023050903481	S	USDMXN	05/30/2023	(2,117,866)	17.83	37,755,583
2023050903485	S	USDMXN	05/30/2023	(4,126,269)	17.83	73,558,323
2023050903488	S	USDMXN	05/30/2023	(734,919)	17.83	13,101,152
2023050903492	S	USDMXN	05/30/2023	(9,825,867)	17.83	175,185,180
2023051003569	SO	USDMXN	05/30/2023	(273,000)	17.62	4,810,140
2023051103570	SO	USDMXN	05/30/2023	(412,000)	17.64	7,269,349
2023051603613	S	USDMXN	05/30/2023	(1,321,315)	17.50	23,124,583
2023051603618	S	USDMXN	05/30/2023	(2,381,080)	17.50	41,669,877
2023051603620	S	USDMXN	05/30/2023	(4,980,570)	17.50	87,164,705
2023051603623	S	USDMXN	05/30/2023	(329,470)	17.50	5,765,981
2023051603630	S	USDMXN	05/30/2023	(3,368,798)	17.50	58,967,589
2023051803664	BO	USDMXN	05/30/2023	2,700,000	17.79	(48,038,346)
2023051803666	BO	USDMXN	05/30/2023	2,700,000	17.79	(48,038,346)
2023052303500	B	USDMXN	05/30/2023	3,336,571	18.00	(60,053,056)
2023052503116	B	USDMXN	05/30/2023	100,000,000	17.86	(1,786,400,000)
2023052503118	B	USDMXN	05/30/2023	100,000,000	17.84	(1,783,900,000)
2023052503534	B	USDMXN	05/30/2023	272,000	17.85	(4,856,302)
2023052503148	S	USDMXN	05/30/2023	(1,000,000)	17.85	17,851,260
2023052503278	S	USDMXN	05/30/2023	(100,000,000)	17.84	1,784,000,000
2023052503280	S	USDMXN	05/30/2023	(100,000,000)	17.84	1,784,000,000
2023052503451	S	USDMXN	05/30/2023	(1,000,000)	17.86	17,858,090
2023052503456	S	USDMXN	05/30/2023	(1,000,000)	17.86	17,858,250
2023052503645	S	USDMXN	05/30/2023	(272,001)	17.84	4,853,650
2023052603612	B	USDMXN	05/30/2023	100,000,000	17.64	(1,764,000,000)
2023052603614	B	USDMXN	05/30/2023	100,000,000	17.64	(1,764,000,000)
2023052603608	S	USDMXN	05/30/2023	(200,000,000)	17.64	3,528,000,000
2022082203350	B	USDMXN	05/31/2023	250,000	21.30	(5,325,370)
2023030203663	B	USDMXN	05/31/2023	162,500	18.42	(2,993,778)
2023030203694	SO	USDMXN	05/31/2023	(3,600)	18.42	66,323
2023031003884	B	USDMXN	05/31/2023	31,200	18.77	(585,657)
2023031003678	SO	USDMXN	05/31/2023	(31,200)	18.73	584,418
2023032803402	B	USDMXN	05/31/2023	100,000	18.49	(1,849,234)
2023041303570	B	USDMXN	05/31/2023	2,000,000	18.18	(36,357,684)
2023041803106	BO	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.23	(12,886,587)
2023041803535	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.20	(12,867,861)
2023041803626	B	USDMXN	05/31/2023	41,600	18.20	(757,322)
2023041903317	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.20	(12,867,029)
2023042003281	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.16	(12,842,388)
2023042103488	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.14	(12,824,918)
2023042403249	BO	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.15	(12,828,733)
2023042403573	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.10	(12,798,111)
2023042503223	B	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.19	(12,859,401)
2023042603414	BO	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.27	(12,913,941)
2023042603481	BO	USDMXN	05/31/2023	44,225	18.24	(806,455)
2023042603482	BO	USDMXN	05/31/2023	8,261	18.21	(150,406)
2023042603496	B	USDMXN	05/31/2023	397,000	18.25	(7,246,336)
2023042603588	BO	USDMXN	05/31/2023	274,514	18.28	(5,016,826)
2023042703072	BO	USDMXN	05/31/2023	707,000	18.19	(12,862,743)
2023042703598	B	USDMXN	05/31/2023	103,600	18.16	(1,881,384)
2023042703682	BO	USDMXN	05/31/2023	118,800	18.16	(2,157,522)
2023042703688	B	USDMXN	05/31/2023	96,168	18.16	(1,746,419)
2023042703745	BO	USDMXN	05/31/2023	118,800	18.15	(2,156,549)
2023042703696	S	USDMXN	05/31/2023	(214,968)	18.16	3,903,437
2023042803480	BO	USDMXN	05/31/2023	22,900	18.10	(414,388)
2023042803673	BO	USDMXN	05/31/2023	20,250	18.10	(366,438)
2023042803780	BO	USDMXN	05/31/2023	35,200	18.09	(636,601)
2023050503355	BO	USDMXN	05/31/2023	53,500	17.84	(954,631)
2023050503719	B	USDMXN	05/31/2023	61,500	17.87	(1,098,753)
2023050803237	BO	USDMXN	05/31/2023	33,488	17.90	(599,379)
2023051003553	BO	USDMXN	05/31/2023	15,000	17.63	(264,472)
2023051203458	B	USDMXN	05/31/2023	207,200	17.63	(3,653,815)
2023051503306	BO	USDMXN	05/31/2023	76,000	17.60	(1,337,682)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023051503763	BO	USDMXN	05/31/2023	194,432	17.48	(3,398,984)
2023051903458	BO	USDMXN	05/31/2023	44,800	17.77	(796,095)
2023052303188	B	USDMXN	05/31/2023	31,000	17.99	(557,715)
2023052503168	S	USDMXN	05/31/2023	(48,000,000)	17.85	856,749,120
2023052603103	B	USDMXN	05/31/2023	1,000,000	17.68	(17,677,000)
2023052603104	B	USDMXN	05/31/2023	1,000,000	17.67	(17,674,390)
2023052603354	B	USDMXN	05/31/2023	2,000,000	17.66	(35,328,600)
2023052603356	B	USDMXN	05/31/2023	59,023	17.67	(1,042,876)
2023052603377	B	USDMXN	05/31/2023	212,511	17.66	(3,753,592)
2023052603609	B	USDMXN	05/31/2023	200,000,000	17.64	(3,528,880,000)
2023052603110	S	USDMXN	05/31/2023	(1,000,000)	17.65	17,651,970
2023052603114	S	USDMXN	05/31/2023	(418,000)	17.65	7,379,334
2023052603390	S	USDMXN	05/31/2023	(9,212,510)	17.66	162,727,190
2023052603394	S	USDMXN	05/31/2023	(2,059,024)	17.66	36,369,771
2023052603412	S	USDMXN	05/31/2023	(582,000)	17.66	10,278,027
2023052603613	S	USDMXN	05/31/2023	(100,000,000)	17.64	1,764,470,000
2023052603615	S	USDMXN	05/31/2023	(100,000,000)	17.64	1,764,470,000
2023052903502	B	USDMXN	05/31/2023	250,000	17.59	(4,396,993)
2023052903505	B	USDMXN	05/31/2023	150,000	17.59	(2,638,286)
2023052903522	B	USDMXN	05/31/2023	750,000	17.59	(13,190,985)
2023052903306	S	USDMXN	05/31/2023	(10,000,000)	17.56	175,590,200
2023052903432	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,780
2023052903434	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,750
2023052903436	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,750
2023052903438	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,750
2023052903440	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,750
2023052903442	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,720
2023052903444	S	USDMXN	05/31/2023	(300,000)	17.58	5,274,720
2023053003109	B	USDMXN	05/31/2023	100,000,000	17.60	(1,760,000,000)
2023053003029	S	USDMXN	05/31/2023	(45,600)	17.58	801,809
2023053003031	S	USDMXN	05/31/2023	(250,000)	17.59	4,396,747
2023053003033	S	USDMXN	05/31/2023	(250,000)	17.59	4,396,702
2023053003035	S	USDMXN	05/31/2023	(250,000)	17.59	4,396,402
2023053003037	S	USDMXN	05/31/2023	(250,000)	17.59	4,396,484
2023053003219	S	USDMXN	05/31/2023	(71,042,910)	17.60	1,250,000,000
2023053003263	S	USDMXN	05/31/2023	(30,000,000)	17.69	530,550,000
2022112903237	BO	USDMXN	06/01/2023	3,900,000	19.86	(77,448,224)
2022112903268	BO	USDMXN	06/01/2023	35,000	19.89	(696,240)
2022113003423	B	USDMXN	06/01/2023	1,351,320	20.05	(27,088,815)
2023010603627	B	USDMXN	06/01/2023	150,000	19.66	(2,949,391)
2023020203322	BO	USDMXN	06/01/2023	100,000	19.00	(1,899,633)
2023033103560	BO	USDMXN	06/01/2023	30,000	18.21	(546,418)
2023041203246	BO	USDMXN	06/01/2023	60,000	18.25	(1,095,246)
2023042003403	B	USDMXN	06/01/2023	60,000	18.16	(1,089,654)
2023042403652	BO	USDMXN	06/01/2023	60,000	18.11	(1,086,674)
2023050203273	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	18.14	(10,560,179)
2023050203587	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	18.10	(10,534,624)
2023050403170	B	USDMXN	06/01/2023	582,000	18.04	(10,498,226)
2023050403456	BO	USDMXN	06/01/2023	237,000	17.99	(4,262,562)
2023050503352	B	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.86	(10,394,255)
2023050503739	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.87	(10,399,872)
2023050803229	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.89	(10,409,082)
2023050803299	B	USDMXN	06/01/2023	250,000	17.87	(4,468,679)
2023050803421	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.86	(10,397,418)
2023050903420	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.83	(10,378,429)
2023051003458	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.67	(10,284,433)
2023051103287	B	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.68	(10,288,339)
2023051103573	SO	USDMXN	06/01/2023	(139,000)	17.65	2,453,499
2023051503175	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.63	(10,261,665)
2023051603074	BO	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.53	(10,200,235)
2023051603656	B	USDMXN	06/01/2023	582,000	17.51	(10,190,929)
2023051903420	BO	USDMXN	06/01/2023	6,224	17.76	(110,539)
2023052303581	S	USDMXN	06/01/2023	(22,000,000)	18.02	396,462,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023052403488	S	USDMXN	06/01/2023	(200,000)	17.85	3,570,466
2023053003124	B	USDMXN	06/01/2023	1,000,000	17.66	(17,656,620)
2023053003211	B	USDMXN	06/01/2023	10,000,000	17.68	(176,808,000)
2023053003220	B	USDMXN	06/01/2023	71,026,359	17.60	(1,250,000,000)
2023053003264	B	USDMXN	06/01/2023	30,000,000	17.69	(530,676,000)
2023053003364	B	USDMXN	06/01/2023	1,000,000	17.65	(17,650,000)
2023053003700	B	USDMXN	06/01/2023	3,000,000	17.66	(52,965,000)
2023053003708	B	USDMXN	06/01/2023	2,364,992	17.66	(41,753,934)
2023053003711	B	USDMXN	06/01/2023	1,000,000	17.66	(17,655,160)
2023053003027	S	USDMXN	06/01/2023	(98,988)	17.59	1,741,684
2023053003110	S	USDMXN	06/01/2023	(100,000,000)	17.60	1,760,430,000
2023053003122	S	USDMXN	06/01/2023	(1,000,000)	17.63	17,631,450
2023053003254	S	USDMXN	06/01/2023	(1,000,000)	17.68	17,683,180
2023053003424	S	USDMXN	06/01/2023	(582,000)	17.65	10,274,803
2023053003586	S	USDMXN	06/01/2023	(1,000,000)	17.69	17,686,280
2023053003719	S	USDMXN	06/01/2023	(5,364,992)	17.65	94,688,251
2023053103174	B	USDMXN	06/01/2023	100,000,000	17.70	(1,770,000,000)
2023053103039	S	USDMXN	06/01/2023	(100,000,000)	17.65	1,765,000,000
2022060303228	B	USDMXN	06/02/2023	1,460,000	21.01	(30,680,440)
2022060303303	S	USDMXN	06/02/2023	(1,460,000)	21.01	30,678,635
2023011003594	B	USDMXN	06/02/2023	454,000	19.58	(8,888,923)
2023012003454	BO	USDMXN	06/02/2023	635,685	19.33	(12,285,512)
2023030103336	BO	USDMXN	06/02/2023	50,000	18.49	(924,708)
2023030103337	BO	USDMXN	06/02/2023	50,000	18.44	(922,068)
2023030203591	B	USDMXN	06/02/2023	250,000	18.43	(4,607,162)
2023030803497	BO	USDMXN	06/02/2023	400,000	18.27	(7,307,083)
2023042703283	BO	USDMXN	06/02/2023	805,909	18.19	(14,661,660)
2023050203366	B	USDMXN	06/02/2023	81,818	18.12	(1,482,942)
2023050303254	BO	USDMXN	06/02/2023	1,000,000	18.01	(18,013,142)
2023050503413	BO	USDMXN	06/02/2023	95,238	17.85	(1,700,375)
2023051203763	BO	USDMXN	06/02/2023	300,000	17.64	(5,292,170)
2023051203642	SO	USDMXN	06/02/2023	(270,000)	17.67	4,770,984
2023051203673	SO	USDMXN	06/02/2023	(8,000)	17.65	141,214
2023053103035	B	USDMXN	06/02/2023	1,000,000	17.65	(17,645,430)
2023053103040	B	USDMXN	06/02/2023	100,000,000	17.65	(1,765,420,000)
2023053103121	B	USDMXN	06/02/2023	1,000,000	17.75	(17,753,250)
2023053103281	B	USDMXN	06/02/2023	600,000	17.75	(10,652,892)
2023053103368	B	USDMXN	06/02/2023	199,364	17.73	(3,533,930)
2023053103372	B	USDMXN	06/02/2023	209,070	17.73	(3,705,962)
2023053103046	S	USDMXN	06/02/2023	(1,000,000)	17.68	17,680,000
2023053103120	S	USDMXN	06/02/2023	(1,000,000)	17.74	17,739,950
2023053103175	S	USDMXN	06/02/2023	(100,000,000)	17.70	1,770,450,000
2023053103200	S	USDMXN	06/02/2023	(1,000,000)	17.75	17,750,000
2023060103211	B	USDMXN	06/02/2023	100,000,000	17.55	(1,755,000,000)
2023060103444	S	USDMXN	06/02/2023	(68,000,000)	17.57	1,194,624,000
2023011003596	B	USDMXN	06/05/2023	267,000	19.59	(5,230,632)
2023051003554	BO	USDMXN	06/05/2023	70,232	17.66	(1,240,136)
2023051703729	S	USDMXN	06/05/2023	(229,000)	17.65	4,040,844
2023052503524	S	USDMXN	06/05/2023	(170,000)	17.88	3,039,045
2023052503526	SO	USDMXN	06/05/2023	(109,000)	17.88	1,948,428
2023053003757	BO	USDMXN	06/05/2023	94,000	17.67	(1,660,984)
2023060103394	B	USDMXN	06/05/2023	1,000,000	17.58	(17,578,820)
2023060103425	B	USDMXN	06/05/2023	118,000	17.57	(2,073,396)
2023060103445	B	USDMXN	06/05/2023	68,000,000	17.58	(1,195,395,800)
2023060103645	B	USDMXN	06/05/2023	161,000	17.56	(2,826,592)
2023060103212	S	USDMXN	06/05/2023	(100,000,000)	17.56	1,756,200,000
2023060103246	S	USDMXN	06/05/2023	(570,000)	17.55	10,005,324
2023060103405	S	USDMXN	06/05/2023	(1,800,000)	17.57	31,632,066
2023060103423	S	USDMXN	06/05/2023	(279,000)	17.57	4,901,349
2023060103473	S	USDMXN	06/05/2023	(400,000)	17.57	7,026,440
2023060103475	S	USDMXN	06/05/2023	(600,000)	17.57	10,539,720
2023060203335	B	USDMXN	06/05/2023	100,000,000	17.50	(1,750,000,000)
2023060203337	B	USDMXN	06/05/2023	100,000,000	17.50	(1,750,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060203267	S	USDMXN	06/05/2023	(85,763,293)	17.49	1,500,000,000
2023060203269	S	USDMXN	06/05/2023	(65,000,000)	17.51	1,137,890,000
2023060203280	S	USDMXN	06/05/2023	(65,000,000)	17.51	1,137,890,000
2023060203339	S	USDMXN	06/05/2023	(50,000,000)	17.52	875,750,000
2022092003180	BO	USDMXN	06/06/2023	500,000	20.96	(10,480,792)
2022111003564	B	USDMXN	06/06/2023	2,800,000	20.12	(56,332,766)
2022122303347	BO	USDMXN	06/06/2023	2,500,000	20.01	(50,019,400)
2023010603366	BO	USDMXN	06/06/2023	100,000	19.70	(1,970,002)
2023011203109	B	USDMXN	06/06/2023	4,570,140	19.40	(88,680,016)
2023013003476	BO	USDMXN	06/06/2023	50,000	19.23	(961,304)
2023020203583	BO	USDMXN	06/06/2023	20,000	19.12	(382,379)
2023021303499	BO	USDMXN	06/06/2023	20,000	19.01	(380,160)
2023022003428	BO	USDMXN	06/06/2023	20,000	18.77	(375,388)
2023030203227	BO	USDMXN	06/06/2023	50,000	18.42	(921,131)
2023030203569	BO	USDMXN	06/06/2023	4,000,000	18.41	(73,650,780)
2023030803498	BO	USDMXN	06/06/2023	400,000	18.28	(7,312,461)
2023040503409	BO	USDMXN	06/06/2023	150,000	18.31	(2,746,647)
2023041003203	B	USDMXN	06/06/2023	153,846	18.37	(2,826,573)
2023050303610	BO	USDMXN	06/06/2023	52,950	18.03	(954,624)
2023051803481	SO	USDMXN	06/06/2023	(412,000)	17.77	7,319,918
2023060203029	B	USDMXN	06/06/2023	1,000,000	17.45	(17,454,430)
2023060203132	B	USDMXN	06/06/2023	1,000,000	17.48	(17,480,410)
2023060203147	B	USDMXN	06/06/2023	3,000,000	17.50	(52,485,000)
2023060203148	B	USDMXN	06/06/2023	441,206	17.49	(7,718,661)
2023060203249	B	USDMXN	06/06/2023	1,000,000	17.51	(17,511,220)
2023060203268	B	USDMXN	06/06/2023	85,745,889	17.49	(1,500,000,000)
2023060203270	B	USDMXN	06/06/2023	65,000,000	17.51	(1,138,120,750)
2023060203281	B	USDMXN	06/06/2023	65,000,000	17.51	(1,138,120,750)
2023060203340	B	USDMXN	06/06/2023	50,000,000	17.52	(875,930,000)
2023060203429	B	USDMXN	06/06/2023	1,700,000	17.55	(29,826,755)
2023060203524	B	USDMXN	06/06/2023	1,709,889	17.53	(29,966,831)
2023060203619	B	USDMXN	06/06/2023	3,000,000	17.56	(52,680,000)
2023060203091	S	USDMXN	06/06/2023	(1,000,000)	17.48	17,480,720
2023060203151	S	USDMXN	06/06/2023	(5,441,206)	17.49	95,164,516
2023060203225	S	USDMXN	06/06/2023	(1,000,000)	17.50	17,497,400
2023060203242	S	USDMXN	06/06/2023	(3,530,000)	17.51	61,804,652
2023060203330	S	USDMXN	06/06/2023	(900,000)	17.51	15,762,060
2023060203332	S	USDMXN	06/06/2023	(800,000)	17.51	14,010,720
2023060203336	S	USDMXN	06/06/2023	(100,000,000)	17.50	1,750,390,000
2023060203338	S	USDMXN	06/06/2023	(100,000,000)	17.50	1,750,390,000
2023060203614	S	USDMXN	06/06/2023	(3,000,000)	17.56	52,665,000
2023060503298	B	USDMXN	06/06/2023	150,000,000	17.48	(2,622,000,000)
2023060503254	S	USDMXN	06/06/2023	(137,000,000)	17.47	2,393,390,000
2023060503264	S	USDMXN	06/06/2023	(4,000,000)	17.47	69,891,200
2023060603384	B	USDMXN	06/06/2023	150,000,000	17.40	(2,610,000,000)
2022071203456	SO	USDMXN	06/07/2023	(315,315)	22.17	6,989,515
2022082303342	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.17	1,058,452
2022082303344	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.18	1,058,797
2022082303347	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.18	1,058,791
2022082303352	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.17	1,058,555
2022082303354	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.18	1,058,799
2022082303359	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000)	21.18	1,058,900
2022082303418	S	USDMXN	06/07/2023	(20,122)	21.18	426,284
2022082303433	SO	USDMXN	06/07/2023	(10,597)	21.16	224,248
2023030303594	BO	USDMXN	06/07/2023	250,000	18.29	(4,573,273)
2023030303602	S	USDMXN	06/07/2023	(250,000)	18.29	4,571,428
2023031003888	B	USDMXN	06/07/2023	31,200	18.80	(586,413)
2023031003894	BO	USDMXN	06/07/2023	7,800	18.80	(146,643)
2023031003677	SO	USDMXN	06/07/2023	(39,000)	18.76	731,499
2023041203613	BO	USDMXN	06/07/2023	46,800	18.29	(855,994)
2023050203628	BO	USDMXN	06/07/2023	22,800	18.10	(412,788)
2023050303259	BO	USDMXN	06/07/2023	102,000	18.03	(1,838,911)
2023050303602	BO	USDMXN	06/07/2023	800	18.03	(14,426)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050503358	BO	USDMXN	06/07/2023	53,500	17.87	(955,911)
2023050503721	B	USDMXN	06/07/2023	61,500	17.89	(1,100,244)
2023050503873	BO	USDMXN	06/07/2023	19,450	17.87	(347,589)
2023051103562	BO	USDMXN	06/07/2023	40,416	17.68	(714,411)
2023051203475	B	USDMXN	06/07/2023	135,350	17.67	(2,391,742)
2023051203771	BO	USDMXN	06/07/2023	12,555	17.66	(221,732)
2023051203481	SO	USDMXN	06/07/2023	(52,950)	17.67	935,560
2023051503305	BO	USDMXN	06/07/2023	155,324	17.63	(2,737,923)
2023052203189	S	USDMXN	06/07/2023	(10,000,000)	17.91	179,134,100
2023052303696	BO	USDMXN	06/07/2023	163,327	18.04	(2,946,132)
2023052303698	BO	USDMXN	06/07/2023	163,327	18.04	(2,946,132)
2023052303699	BO	USDMXN	06/07/2023	118,732	18.05	(2,143,292)
2023052303701	BO	USDMXN	06/07/2023	118,732	18.05	(2,143,292)
2023052303721	BO	USDMXN	06/07/2023	163,327	18.04	(2,946,132)
2023052303727	BO	USDMXN	06/07/2023	118,732	18.05	(2,143,292)
2023052403305	BO	USDMXN	06/07/2023	35,120	17.88	(627,951)
2023052503002	B	USDMXN	06/07/2023	10,000,000	17.86	(178,574,210)
2023053003028	B	USDMXN	06/07/2023	98,988	17.62	(1,744,027)
2023060503002	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.51	(17,509,680)
2023060503069	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.50	(17,495,000)
2023060503115	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.48	(17,480,000)
2023060503127	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.48	(17,478,950)
2023060503136	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.48	(17,475,030)
2023060503149	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.47	(17,473,720)
2023060503162	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.47	(17,473,270)
2023060503164	B	USDMXN	06/07/2023	1,000,000	17.47	(17,473,590)
2023060503255	B	USDMXN	06/07/2023	137,000,000	17.47	(2,393,869,500)
2023060503265	B	USDMXN	06/07/2023	4,000,000	17.48	(69,905,600)
2023060503333	B	USDMXN	06/07/2023	500,000	17.48	(8,737,550)
2023060503005	S	USDMXN	06/07/2023	(1,000,000)	17.47	17,473,800
2023060503060	S	USDMXN	06/07/2023	(2,000,000)	17.50	34,991,520
2023060503200	S	USDMXN	06/07/2023	(1,000,000)	17.47	17,468,720
2023060503213	S	USDMXN	06/07/2023	(1,000,000)	17.47	17,471,320
2023060503222	S	USDMXN	06/07/2023	(1,000,000)	17.47	17,470,210
2023060503226	S	USDMXN	06/07/2023	(753,739)	17.47	13,165,491
2023060503282	S	USDMXN	06/07/2023	(1,250,000)	17.48	21,850,000
2023060503299	S	USDMXN	06/07/2023	(150,000,000)	17.48	2,622,570,000
2023060503490	S	USDMXN	06/07/2023	(499,611)	17.46	8,722,203
2023060603388	B	USDMXN	06/07/2023	150,000,000	17.40	(2,610,000,000)
2023060603271	S	USDMXN	06/07/2023	(100,000,000)	17.42	1,742,000,000
2023060603397	S	USDMXN	06/07/2023	(50,000,000)	17.40	870,000,000
2022070503334	SO	USDMXN	06/08/2023	(273,286)	21.96	6,002,043
2022071903274	SO	USDMXN	06/08/2023	(275,000)	21.77	5,987,630
2022071903326	SO	USDMXN	06/08/2023	(558)	21.77	12,155
2022113003425	B	USDMXN	06/08/2023	1,351,320	20.07	(27,126,536)
2023010603629	B	USDMXN	06/08/2023	150,000	19.69	(2,953,218)
2023020203320	BO	USDMXN	06/08/2023	100,000	19.02	(1,902,065)
2023030303221	BO	USDMXN	06/08/2023	50,000	18.37	(918,707)
2023030303430	S	USDMXN	06/08/2023	(50,000)	18.32	915,968
2023030803354	BO	USDMXN	06/08/2023	10,000	18.24	(182,424)
2023033103561	BO	USDMXN	06/08/2023	30,000	18.24	(547,158)
2023041203245	BO	USDMXN	06/08/2023	60,000	18.28	(1,096,751)
2023042003405	B	USDMXN	06/08/2023	60,000	18.19	(1,091,286)
2023042403653	BO	USDMXN	06/08/2023	60,000	18.14	(1,088,189)
2023050403457	BO	USDMXN	06/08/2023	237,000	18.01	(4,268,359)
2023050803301	B	USDMXN	06/08/2023	250,000	17.90	(4,474,665)
2023051103221	BO	USDMXN	06/08/2023	16,023	17.71	(283,687)
2023051903421	BO	USDMXN	06/08/2023	6,224	17.79	(110,717)
2023051903569	SO	USDMXN	06/08/2023	(107,000)	17.80	1,904,134
2023052303018	S	USDMXN	06/08/2023	(5,000,000)	18.03	90,168,100
2023052503004	B	USDMXN	06/08/2023	5,000,000	17.87	(89,353,545)
2023060603010	B	USDMXN	06/08/2023	1,000,000	17.47	(17,469,370)
2023060603011	B	USDMXN	06/08/2023	1,000,000	17.45	(17,450,750)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060603111	B	USDMXN	06/08/2023	1,000,000	17.44	(17,443,110)
2023060603123	B	USDMXN	06/08/2023	750,000	17.44	(13,080,000)
2023060603125	B	USDMXN	06/08/2023	300,000	17.44	(5,232,000)
2023060603163	B	USDMXN	06/08/2023	139,130	17.44	(2,426,330)
2023060603272	B	USDMXN	06/08/2023	100,000,000	17.42	(1,742,320,000)
2023060603325	B	USDMXN	06/08/2023	500,000	17.41	(8,706,500)
2023060603398	B	USDMXN	06/08/2023	50,000,000	17.40	(870,166,000)
2023060603489	B	USDMXN	06/08/2023	1,407,000	17.41	(24,488,835)
2023060603554	B	USDMXN	06/08/2023	750,000	17.40	(13,050,225)
2023060603188	S	USDMXN	06/08/2023	(2,000,000)	17.43	34,861,180
2023060603194	S	USDMXN	06/08/2023	(750,000)	17.43	13,072,650
2023060603196	S	USDMXN	06/08/2023	(300,000)	17.43	5,229,510
2023060603336	S	USDMXN	06/08/2023	(250,000)	17.41	4,351,875
2023060603338	S	USDMXN	06/08/2023	(250,000)	17.41	4,351,600
2023060603385	S	USDMXN	06/08/2023	(150,000,000)	17.40	2,610,525,000
2023060603389	S	USDMXN	06/08/2023	(150,000,000)	17.40	2,610,525,000
2023060603442	S	USDMXN	06/08/2023	(750,000)	17.40	13,050,300
2023060603490	S	USDMXN	06/08/2023	(390,260)	17.40	6,790,831
2023060603496	S	USDMXN	06/08/2023	(1,018,880)	17.40	17,729,424
2023060603498	S	USDMXN	06/08/2023	(500,000)	17.40	8,701,600
2023060603682	S	USDMXN	06/08/2023	(500,000)	17.39	8,694,850
2023060703411	B	USDMXN	06/08/2023	150,000,000	17.35	(2,602,500,000)
2023060703445	S	USDMXN	06/08/2023	(150,000,000)	17.36	2,604,000,000
2022101303274	BO	USDMXN	06/09/2023	200,000	20.89	(4,177,813)
2022122803070	BO	USDMXN	06/09/2023	1,210,000	19.99	(24,185,630)
2023011803544	BO	USDMXN	06/09/2023	25,000	19.33	(483,342)
2023020203508	B	USDMXN	06/09/2023	300,000	19.10	(5,729,060)
2023030203454	BO	USDMXN	06/09/2023	50,000	18.45	(922,413)
2023030203593	B	USDMXN	06/09/2023	250,000	18.45	(4,613,438)
2023042403692	BO	USDMXN	06/09/2023	250,000	18.14	(4,534,000)
2023042703284	BO	USDMXN	06/09/2023	711,887	18.22	(12,969,979)
2023050203368	B	USDMXN	06/09/2023	81,818	18.15	(1,484,963)
2023050303533	BO	USDMXN	06/09/2023	250,000	18.00	(4,499,315)
2023050503414	BO	USDMXN	06/09/2023	95,238	17.88	(1,702,653)
2023051903568	SO	USDMXN	06/09/2023	(273,000)	17.80	4,859,250
2023060603717	S	USDMXN	06/09/2023	(500,000)	17.39	8,694,850
2023060703030	B	USDMXN	06/09/2023	1,000,000	17.32	(17,323,680)
2023060703110	B	USDMXN	06/09/2023	1,000,000	17.37	(17,372,380)
2023060703131	B	USDMXN	06/09/2023	2,000,000	17.35	(34,700,000)
2023060703136	B	USDMXN	06/09/2023	1,000,000	17.34	(17,340,190)
2023060703405	B	USDMXN	06/09/2023	570,000	17.36	(9,895,200)
2023060703427	B	USDMXN	06/09/2023	170,000	17.36	(2,950,942)
2023060703446	B	USDMXN	06/09/2023	150,000,000	17.36	(2,604,465,000)
2023060703097	S	USDMXN	06/09/2023	(500,000)	17.38	8,688,400
2023060703099	S	USDMXN	06/09/2023	(1,000,000)	17.38	17,380,700
2023060703192	S	USDMXN	06/09/2023	(1,000,000)	17.30	17,304,630
2023060703194	S	USDMXN	06/09/2023	(1,000,000)	17.31	17,313,850
2023060703197	S	USDMXN	06/09/2023	(1,000,000)	17.33	17,333,600
2023060703223	S	USDMXN	06/09/2023	(570,000)	17.34	9,881,423
2023060703235	S	USDMXN	06/09/2023	(600,000)	17.34	10,401,360
2023060703412	S	USDMXN	06/09/2023	(150,000,000)	17.35	2,603,010,000
2023060703425	S	USDMXN	06/09/2023	(570,000)	17.36	9,893,080
2023060803151	B	USDMXN	06/09/2023	150,000,000	17.40	(2,610,000,000)
2023060803090	S	USDMXN	06/09/2023	(110,000,000)	17.39	1,913,010,000
2022061503519	BO	USDMXN	06/12/2023	350,000	21.80	(7,628,353)
2023030803353	BO	USDMXN	06/12/2023	20,000	18.26	(365,118)
2023052403443	SO	USDMXN	06/12/2023	(377,000)	17.92	6,755,853
2023060803035	B	USDMXN	06/12/2023	1,000,000	17.38	(17,383,160)
2023060803091	B	USDMXN	06/12/2023	110,000,000	17.40	(1,914,033,000)
2023060803101	B	USDMXN	06/12/2023	1,000,000	17.42	(17,424,070)
2023060803102	B	USDMXN	06/12/2023	1,000,000	17.42	(17,424,050)
2023060803174	B	USDMXN	06/12/2023	1,000,000	17.43	(17,428,000)
2023060803183	B	USDMXN	06/12/2023	1,000,000	17.41	(17,413,030)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060803515	B	USDMXN	06/12/2023	300,000	17.39	(5,217,954)
2023060803571	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,236)
2023060803573	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,236)
2023060803575	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,237)
2023060803577	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,228)
2023060803579	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,223)
2023060803581	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,217)
2023060803583	B	USDMXN	06/12/2023	15,600	17.39	(271,223)
2023060803084	S	USDMXN	06/12/2023	(1,000,000)	17.40	17,401,620
2023060803130	S	USDMXN	06/12/2023	(2,000,000)	17.42	34,836,000
2023060803145	S	USDMXN	06/12/2023	(1,000,000)	17.43	17,433,690
2023060803152	S	USDMXN	06/12/2023	(150,000,000)	17.41	2,611,485,000
2023060803201	S	USDMXN	06/12/2023	(1,000,000)	17.41	17,407,000
2023060803419	S	USDMXN	06/12/2023	(5,000,000)	17.40	87,002,000
2023060803541	S	USDMXN	06/12/2023	(147,600)	17.39	2,566,188
2023060803543	S	USDMXN	06/12/2023	(147,600)	17.39	2,566,484
2023060803551	S	USDMXN	06/12/2023	(52,800)	17.38	917,880
2023060803553	S	USDMXN	06/12/2023	(52,800)	17.38	917,880
2023060803557	S	USDMXN	06/12/2023	(37,600)	17.38	653,646
2023060903305	B	USDMXN	06/12/2023	150,000,000	17.30	(2,595,000,000)
2023060903056	S	USDMXN	06/12/2023	(90,000,000)	17.31	1,558,080,000
2023010603367	BO	USDMXN	06/13/2023	100,000	19.73	(1,972,525)
2023011303863	BO	USDMXN	06/13/2023	152,415	19.30	(2,942,225)
2023022003429	BO	USDMXN	06/13/2023	20,000	18.79	(375,889)
2023022103384	SO	USDMXN	06/13/2023	(3,000,000)	18.80	56,407,332
2023022103544	SO	USDMXN	06/13/2023	(2,500,000)	18.81	47,037,320
2023022803030	BO	USDMXN	06/13/2023	20,000	18.68	(373,625)
2023030803355	BO	USDMXN	06/13/2023	20,000	18.26	(365,199)
2023040503413	BO	USDMXN	06/13/2023	150,000	18.34	(2,750,414)
2023041003205	B	USDMXN	06/13/2023	153,846	18.40	(2,830,650)
2023041403481	BO	USDMXN	06/13/2023	44,200	18.26	(807,288)
2023050503349	B	USDMXN	06/13/2023	5,000,000	17.91	(89,539,734)
2023051803587	BO	USDMXN	06/13/2023	103,372	17.79	(1,838,721)
2023052503522	S	USDMXN	06/13/2023	(412,000)	17.91	7,378,397
2023060203620	S	USDMXN	06/13/2023	(3,000,000)	17.58	52,752,569
2023060903057	B	USDMXN	06/13/2023	90,000,000	17.32	(1,558,363,500)
2023060903116	B	USDMXN	06/13/2023	1,000,000	17.34	(17,338,750)
2023060903137	B	USDMXN	06/13/2023	700,000	17.31	(12,115,565)
2023060903309	B	USDMXN	06/13/2023	9,600,000	17.28	(165,891,840)
2023060903143	S	USDMXN	06/13/2023	(500,000)	17.31	8,652,750
2023060903145	S	USDMXN	06/13/2023	(500,000)	17.31	8,652,700
2023060903147	S	USDMXN	06/13/2023	(700,000)	17.31	12,114,620
2023060903306	S	USDMXN	06/13/2023	(150,000,000)	17.30	2,595,510,000
2023060903387	S	USDMXN	06/13/2023	(2,000,000)	17.28	34,550,000
2023060903389	S	USDMXN	06/13/2023	(1,000,000)	17.28	17,280,000
2023060903590	S	USDMXN	06/13/2023	(300,000)	17.27	5,180,100
2023060903685	S	USDMXN	06/13/2023	(2,000,000)	17.28	34,552,560
2023061203006	B	USDMXN	06/13/2023	150,000,000	17.27	(2,590,500,000)
2023061203004	S	USDMXN	06/13/2023	(150,000,000)	17.27	2,590,500,000
2022112303621	B	USDMXN	06/14/2023	2,000,000	20.08	(40,168,808)
2022112903049	BO	USDMXN	06/14/2023	250,000	19.83	(4,957,252)
2023011003598	B	USDMXN	06/14/2023	494,000	19.62	(9,694,460)
2023021403251	B	USDMXN	06/14/2023	125,000	18.99	(2,373,766)
2023031403537	BO	USDMXN	06/14/2023	7,490,607	18.97	(142,119,332)
2023031703677	SO	USDMXN	06/14/2023	(98,500)	19.21	1,892,140
2023032103489	B	USDMXN	06/14/2023	2,487,924	18.95	(47,146,514)
2023032103491	B	USDMXN	06/14/2023	2,819,212	18.95	(53,422,941)
2023032803101	B	USDMXN	06/14/2023	333,333	18.54	(6,178,949)
2023041303703	BO	USDMXN	06/14/2023	121,692	18.22	(2,217,784)
2023041803628	B	USDMXN	06/14/2023	39,600	18.26	(722,935)
2023042003486	S	USDMXN	06/14/2023	(2,156,760)	18.21	39,279,135
2023042703673	S	USDMXN	06/14/2023	(1,080,529)	18.21	19,672,676
2023050303535	B	USDMXN	06/14/2023	400,000	18.04	(7,214,209)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050403568	BO	USDMXN	06/14/2023	79,800	18.04	(1,439,554)
2023050503357	BO	USDMXN	06/14/2023	185,000	17.89	(3,310,081)
2023050503724	B	USDMXN	06/14/2023	61,500	17.91	(1,101,766)
2023050803621	B	USDMXN	06/14/2023	1,000,000	17.91	(17,911,466)
2023050903085	BO	USDMXN	06/14/2023	22,800	17.89	(407,782)
2023050903495	S	USDMXN	06/14/2023	(456,603)	17.88	8,166,051
2023051103378	BO	USDMXN	06/14/2023	82,800	17.72	(1,467,252)
2023051203459	BO	USDMXN	06/14/2023	81,800	17.69	(1,446,991)
2023051203579	BO	USDMXN	06/14/2023	137,300	17.71	(2,431,538)
2023051603633	S	USDMXN	06/14/2023	(2,047,714)	17.56	35,960,546
2023052303501	S	USDMXN	06/14/2023	(3,336,571)	18.06	60,266,253
2023052303510	S	USDMXN	06/14/2023	(379,617)	18.06	6,854,972
2023052303518	S	USDMXN	06/14/2023	(4,031,391)	18.06	72,809,621
2023052503532	B	USDMXN	06/14/2023	101,687	17.91	(1,821,709)
2023052603815	BO	USDMXN	06/14/2023	243,892	17.68	(4,312,864)
2023060103568	BO	USDMXN	06/14/2023	983,170	17.60	(17,305,360)
2023060103572	B	USDMXN	06/14/2023	1,207,039	17.60	(21,238,619)
2023060503419	BO	USDMXN	06/14/2023	169,056	17.51	(2,959,838)
2023060603485	B	USDMXN	06/14/2023	897,720	17.43	(15,646,198)
2023060603491	B	USDMXN	06/14/2023	390,260	17.42	(6,798,930)
2023061203005	B	USDMXN	06/14/2023	150,000,000	17.27	(2,590,950,000)
2023061203073	B	USDMXN	06/14/2023	1,000,000	17.32	(17,324,050)
2023061203237	B	USDMXN	06/14/2023	500,000	17.33	(8,663,500)
2023061203318	B	USDMXN	06/14/2023	500,000	17.30	(8,650,520)
2023061203007	S	USDMXN	06/14/2023	(150,000,000)	17.27	2,590,980,000
2023061203071	S	USDMXN	06/14/2023	(1,000,000)	17.31	17,309,610
2023061203158	S	USDMXN	06/14/2023	(1,000,000)	17.31	17,314,740
2023061303051	B	USDMXN	06/14/2023	150,000,000	17.28	(2,592,000,000)
2023061303030	S	USDMXN	06/14/2023	(70,000,000)	17.28	1,209,810,000
2023061303116	S	USDMXN	06/14/2023	(10,287,123)	17.24	177,350,000
2023061303165	S	USDMXN	06/14/2023	(100,000,000)	17.27	1,727,100,000
2023061303170	S	USDMXN	06/14/2023	(100,000,000)	17.27	1,727,100,000
2023061303192	S	USDMXN	06/14/2023	(10,287,123)	17.24	177,350,000
2022013103143	B	USDMXN	06/15/2023	668,136	22.70	(15,169,553)
2022030703263	SO	USDMXN	06/15/2023	(175,000)	23.16	4,053,705
2022032403649	B	USDMXN	06/15/2023	563,577	21.90	(12,340,101)
2022070603463	SO	USDMXN	06/15/2023	(1,116)	22.06	24,615
2022071803147	BO	USDMXN	06/15/2023	4,235,000	21.74	(92,054,031)
2022081003799	BO	USDMXN	06/15/2023	285,097	21.21	(6,045,604)
2022102503683	B	USDMXN	06/15/2023	285,097	20.75	(5,917,026)
2022110403291	BO	USDMXN	06/15/2023	285,000	20.35	(5,800,043)
2022110403590	BO	USDMXN	06/15/2023	97	20.38	(1,977)
2022110703621	BO	USDMXN	06/15/2023	175,000	20.27	(3,547,598)
2022112903083	B	USDMXN	06/15/2023	1,750,000	19.84	(34,722,342)
2022113003428	B	USDMXN	06/15/2023	1,351,320	20.10	(27,163,466)
2023010603632	B	USDMXN	06/15/2023	150,000	19.71	(2,956,827)
2023021003321	BO	USDMXN	06/15/2023	500,000	19.12	(9,559,304)
2023030803356	BO	USDMXN	06/15/2023	50,000	18.27	(913,400)
2023031003604	SO	USDMXN	06/15/2023	(175,000)	18.84	3,296,283
2023031403110	SO	USDMXN	06/15/2023	(175,000)	19.44	3,401,501
2023033103562	BO	USDMXN	06/15/2023	30,000	18.26	(547,913)
2023041203243	BO	USDMXN	06/15/2023	60,000	18.30	(1,098,259)
2023042003407	B	USDMXN	06/15/2023	60,000	18.21	(1,092,787)
2023042403654	BO	USDMXN	06/15/2023	60,000	18.16	(1,089,712)
2023050403458	BO	USDMXN	06/15/2023	237,000	18.03	(4,274,292)
2023050503611	BO	USDMXN	06/15/2023	25,000	17.92	(448,119)
2023052503561	BO	USDMXN	06/15/2023	11,904	17.91	(213,232)
2023060103539	BO	USDMXN	06/15/2023	157,000	17.60	(2,763,534)
2023060103607	BO	USDMXN	06/15/2023	467	17.59	(8,220)
2023060203525	S	USDMXN	06/15/2023	(1,709,889)	17.56	30,019,597
2023060603370	BO	USDMXN	06/15/2023	13,500	17.44	(235,409)
2023061303031	B	USDMXN	06/15/2023	70,000,000	17.29	(1,210,006,000)
2023061303057	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.27	(17,267,590)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023061303060	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.27	(17,269,520)
2023061303092	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.24	(17,243,720)
2023061303095	B	USDMXN	06/15/2023	500,000	17.24	(8,620,000)
2023061303097	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.24	(17,240,000)
2023061303098	B	USDMXN	06/15/2023	1,500,000	17.24	(25,860,000)
2023061303100	B	USDMXN	06/15/2023	2,000,000	17.24	(34,480,000)
2023061303117	B	USDMXN	06/15/2023	10,284,886	17.24	(177,350,000)
2023061303166	B	USDMXN	06/15/2023	100,000,000	17.27	(1,727,375,000)
2023061303171	B	USDMXN	06/15/2023	100,000,000	17.27	(1,727,375,000)
2023061303193	B	USDMXN	06/15/2023	10,285,482	17.24	(177,350,000)
2023061303260	B	USDMXN	06/15/2023	250,000	17.22	(4,304,375)
2023061303352	B	USDMXN	06/15/2023	750,000	17.22	(12,912,300)
2023061303366	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.22	(17,218,550)
2023061303390	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,474)
2023061303392	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,473)
2023061303394	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,471)
2023061303397	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,464)
2023061303401	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,464)
2023061303403	B	USDMXN	06/15/2023	15,600	17.21	(268,465)
2023061303405	B	USDMXN	06/15/2023	19,500	17.21	(335,572)
2023061303407	B	USDMXN	06/15/2023	19,500	17.21	(335,611)
2023061303527	B	USDMXN	06/15/2023	1,000,000	17.21	(17,205,000)
2023061303052	S	USDMXN	06/15/2023	(150,000,000)	17.28	2,592,442,500
2023061303082	S	USDMXN	06/15/2023	(1,000,000)	17.27	17,267,330
2023061303087	S	USDMXN	06/15/2023	(430,000)	17.25	7,417,483
2023061303132	S	USDMXN	06/15/2023	(1,000,000)	17.23	17,227,450
2023061303203	S	USDMXN	06/15/2023	(570,000)	17.20	9,804,496
2023061303453	S	USDMXN	06/15/2023	(2,000,000)	17.22	34,440,000
2023061303470	S	USDMXN	06/15/2023	(570,000)	17.21	9,810,418
2023061303510	S	USDMXN	06/15/2023	(286,810)	17.21	4,935,892
2023061303533	S	USDMXN	06/15/2023	(150,000)	17.20	2,580,608
2023061403008	B	USDMXN	06/15/2023	150,000,000	17.16	(2,574,000,000)
2023061403012	S	USDMXN	06/15/2023	(185,000,000)	17.16	3,174,600,000
2023061403052	S	USDMXN	06/15/2023	(185,000,000)	17.16	3,174,600,000
2023061503592	S	USDMXN	06/15/2023	(10,000,000)	17.11	171,115,000
2023011003600	B	USDMXN	06/16/2023	331,000	19.63	(6,498,393)
2023012003453	BO	USDMXN	06/16/2023	358,038	19.38	(6,937,643)
2023013003414	B	USDMXN	06/16/2023	4,400,000	19.25	(84,717,952)
2023030203455	BO	USDMXN	06/16/2023	50,000	18.47	(923,671)
2023030203595	B	USDMXN	06/16/2023	250,000	18.48	(4,619,735)
2023032203375	B	USDMXN	06/16/2023	4,000,000	18.82	(75,260,525)
2023050203370	B	USDMXN	06/16/2023	81,818	18.17	(1,487,013)
2023050503415	BO	USDMXN	06/16/2023	95,238	17.90	(1,705,054)
2023051803588	BO	USDMXN	06/16/2023	100,000	17.80	(1,779,845)
2023052603818	SO	USDMXN	06/16/2023	(272,000)	17.66	4,803,462
2023060203450	BO	USDMXN	06/16/2023	108,000	17.57	(1,897,728)
2023061403013	B	USDMXN	06/16/2023	185,000,000	17.16	(3,175,136,500)
2023061403053	B	USDMXN	06/16/2023	185,000,000	17.16	(3,175,136,500)
2023061403582	B	USDMXN	06/16/2023	35,000	17.12	(599,354)
2023061403009	S	USDMXN	06/16/2023	(150,000,000)	17.16	2,574,457,500
2023061403681	S	USDMXN	06/16/2023	(4,000,000)	17.10	68,402,160
2023061503031	B	USDMXN	06/16/2023	150,000,000	17.17	(2,575,500,000)
2023061503015	B	MXNUSD	06/16/2023	1,000,000,000	17.17	(58,234,335)
2023061503017	S	USDMXN	06/16/2023	(92,000,000)	17.17	1,579,824,000
2023061503019	S	USDMXN	06/16/2023	(20,000,000)	17.18	343,500,000
2023061503334	S	USDMXN	06/16/2023	(35,000,000)	17.17	600,880,000
2023010603369	BO	USDMXN	06/20/2023	100,000	19.75	(1,975,007)
2023032803405	B	USDMXN	06/20/2023	30,000	18.56	(556,930)
2023040503412	BO	USDMXN	06/20/2023	150,000	18.36	(2,754,266)
2023041003207	B	USDMXN	06/20/2023	153,846	18.43	(2,835,011)
2023042803411	BO	USDMXN	06/20/2023	10,000	18.20	(181,962)
2023050203456	B	USDMXN	06/20/2023	4,968,000	18.20	(90,393,644)
2023050203589	BO	USDMXN	06/20/2023	314	18.17	(5,697)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050203707	BO	USDMXN	06/20/2023	133,000	18.15	(2,413,300)
2023050803283	BO	USDMXN	06/20/2023	4,968,000	18.20	(90,393,644)
2023051703554	B	USDMXN	06/20/2023	800,000	17.68	(14,144,084)
2023051803589	BO	USDMXN	06/20/2023	100,001	17.81	(1,781,343)
2023052603391	B	USDMXN	06/20/2023	9,212,510	17.74	(163,442,145)
2023053003850	SO	USDMXN	06/20/2023	(104,000)	17.73	1,843,514
2023060803420	B	USDMXN	06/20/2023	5,000,000	17.43	(87,138,195)
2023061503016	S	MXNUSD	06/20/2023	(1,000,000,000)	17.18	58,191,975
2023061503018	B	USDMXN	06/20/2023	92,000,000	17.18	(1,580,974,000)
2023061503020	B	USDMXN	06/20/2023	20,000,000	17.19	(343,746,000)
2023061503125	B	USDMXN	06/20/2023	1,000,000	17.21	(17,208,860)
2023061503126	B	USDMXN	06/20/2023	1,000,000	17.21	(17,208,600)
2023061503168	B	USDMXN	06/20/2023	1,000,000	17.18	(17,179,010)
2023061503169	B	USDMXN	06/20/2023	1,000,000	17.18	(17,179,210)
2023061503335	B	USDMXN	06/20/2023	35,000,000	17.18	(601,307,000)
2023061503363	B	USDMXN	06/20/2023	5,000,000	17.14	(85,700,000)
2023061503367	B	USDMXN	06/20/2023	3,000,000	17.14	(51,405,000)
2023061503404	B	USDMXN	06/20/2023	25,000	17.17	(429,255)
2023061503593	B	USDMXN	06/20/2023	10,000,000	17.13	(171,262,000)
2023061503032	S	USDMXN	06/20/2023	(150,000,000)	17.18	2,577,397,500
2023061503198	S	USDMXN	06/20/2023	(1,000,000)	17.17	17,169,170
2023061503200	S	USDMXN	06/20/2023	(3,000,000)	17.17	51,514,500
2023061503544	S	USDMXN	06/20/2023	(5,000,000)	17.11	85,550,000
2023061503549	S	USDMXN	06/20/2023	(3,000,000)	17.12	51,345,000
2023061603254	B	USDMXN	06/20/2023	150,000,000	17.10	(2,565,000,000)
2023061603039	S	USDMXN	06/20/2023	(70,000,000)	17.11	1,197,840,000
2023061603040	S	USDMXN	06/20/2023	(55,000,000)	17.11	941,160,000
2023061603256	S	USDMXN	06/20/2023	(35,000,000)	17.10	598,325,000
2022071903251	BO	USDMXN	06/21/2023	399	21.84	(8,718)
2022071903249	SO	USDMXN	06/21/2023	(321,000)	21.83	7,007,855
2022072603225	SO	USDMXN	06/21/2023	(322,000)	21.73	6,996,901
2022072603324	SO	USDMXN	06/21/2023	(180)	21.72	3,905
2022082303365	S	USDMXN	06/21/2023	(50,000)	21.24	1,061,805
2022082303367	S	USDMXN	06/21/2023	(50,000)	21.24	1,061,847
2022082303410	S	USDMXN	06/21/2023	(229,877)	21.24	4,881,593
2022111503640	B	USDMXN	06/21/2023	377,957	20.14	(7,611,277)
2022111703240	BO	USDMXN	06/21/2023	937,858	20.21	(18,955,861)
2022111703758	B	USDMXN	06/21/2023	1,551,092	20.19	(31,321,540)
2022111803559	B	USDMXN	06/21/2023	302,611	20.22	(6,118,962)
2022112903723	B	USDMXN	06/21/2023	114,560	19.96	(2,286,830)
2023010403589	B	USDMXN	06/21/2023	548,871	19.98	(10,969,024)
2023011303744	B	USDMXN	06/21/2023	1,100,000	19.33	(21,266,854)
2023011303864	BO	USDMXN	06/21/2023	553	19.33	(10,691)
2023011603552	BO	USDMXN	06/21/2023	1,100,000	19.33	(21,266,854)
2023011703057	BO	USDMXN	06/21/2023	1,100,000	19.33	(21,266,854)
2023011703251	B	USDMXN	06/21/2023	1,600,000	19.29	(30,869,142)
2023011903680	BO	USDMXN	06/21/2023	39,036	19.58	(764,438)
2023012603542	B	USDMXN	06/21/2023	391,568	19.31	(7,562,908)
2023020103652	B	USDMXN	06/21/2023	51,791	19.10	(989,144)
2023021003696	BO	USDMXN	06/21/2023	1,017,305	19.13	(19,465,200)
2023022103716	BO	USDMXN	06/21/2023	124,002	18.88	(2,341,358)
2023032803593	BO	USDMXN	06/21/2023	13,600	18.53	(251,978)
2023032903472	BO	USDMXN	06/21/2023	63,600	18.38	(1,169,278)
2023041303250	B	USDMXN	06/21/2023	230,604	18.26	(4,210,917)
2023042003522	B	USDMXN	06/21/2023	159,638	18.26	(2,914,195)
2023042803409	BO	USDMXN	06/21/2023	10,000	18.20	(181,999)
2023050503726	B	USDMXN	06/21/2023	61,500	17.94	(1,103,323)
2023051103379	BO	USDMXN	06/21/2023	41,600	17.75	(738,243)
2023051503304	BO	USDMXN	06/21/2023	76,000	17.68	(1,343,446)
2023051703577	BO	USDMXN	06/21/2023	68,225	17.68	(1,205,995)
2023051803496	BO	USDMXN	06/21/2023	132,650	17.86	(2,368,600)
2023051903333	BO	USDMXN	06/21/2023	22,800	17.78	(405,474)
2023052603820	BO	USDMXN	06/21/2023	53,500	17.76	(950,245)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023053003779	BO	USDMXN	06/21/2023	90,952	17.74	(1,613,217)
2023060203159	BO	USDMXN	06/21/2023	81,000	17.54	(1,420,785)
2023060603145	BO	USDMXN	06/21/2023	237,536	17.49	(4,153,482)
2023060703387	BO	USDMXN	06/21/2023	35,528	17.41	(618,480)
2023060703574	BO	USDMXN	06/21/2023	85,600	17.41	(1,490,416)
2023060803542	B	USDMXN	06/21/2023	147,600	17.42	(2,570,854)
2023061203375	BO	USDMXN	06/21/2023	181,464	17.31	(3,141,341)
2023061603042	B	USDMXN	06/21/2023	70,000,000	17.11	(1,198,036,000)
2023061603041	B	USDMXN	06/21/2023	55,000,000	17.11	(941,314,000)
2023061603150	B	USDMXN	06/21/2023	3,000,000	17.11	(51,330,000)
2023061603171	B	USDMXN	06/21/2023	570,000	17.09	(9,741,300)
2023061603257	B	USDMXN	06/21/2023	35,000,000	17.10	(598,423,000)
2023061603261	B	USDMXN	06/21/2023	70,000	17.08	(1,195,837)
2023061603349	B	USDMXN	06/21/2023	500,000	17.07	(8,533,400)
2023061603515	B	USDMXN	06/21/2023	255,000	17.05	(4,347,648)
2023061603130	S	USDMXN	06/21/2023	(1,000,000)	17.15	17,146,150
2023061603131	S	USDMXN	06/21/2023	(1,000,000)	17.14	17,144,360
2023061603132	S	USDMXN	06/21/2023	(1,000,000)	17.14	17,144,150
2023061603183	S	USDMXN	06/21/2023	(400,000)	17.09	6,836,280
2023061603186	S	USDMXN	06/21/2023	(400,000)	17.09	6,836,240
2023061603188	S	USDMXN	06/21/2023	(250,000)	17.09	4,271,650
2023061603255	S	USDMXN	06/21/2023	(150,000,000)	17.10	2,565,442,500
2023061603266	S	USDMXN	06/21/2023	(570,000)	17.08	9,732,921
2023061603436	S	USDMXN	06/21/2023	(500,000)	17.07	8,535,225
2023062003334	B	USDMXN	06/21/2023	150,000,000	17.20	(2,580,000,000)
2023062003195	S	USDMXN	06/21/2023	(185,000,000)	17.17	3,175,525,000
2023062003201	S	USDMXN	06/21/2023	(185,000,000)	17.17	3,175,525,000
2022062803051	BO	USDMXN	06/22/2023	250,000	21.46	(5,363,852)
2022070503421	SO	USDMXN	06/22/2023	(272,000)	22.01	5,986,898
2022070503422	SO	USDMXN	06/22/2023	(368)	22.01	8,104
2022112903086	B	USDMXN	06/22/2023	1,750,000	19.86	(34,762,102)
2022113003430	B	USDMXN	06/22/2023	1,351,320	20.13	(27,200,233)
2023010603634	B	USDMXN	06/22/2023	150,000	19.74	(2,960,479)
2023032803407	B	USDMXN	06/22/2023	70,000	18.57	(1,299,953)
2023033103563	BO	USDMXN	06/22/2023	30,000	18.29	(548,668)
2023041203244	BO	USDMXN	06/22/2023	60,000	18.33	(1,099,787)
2023042003409	B	USDMXN	06/22/2023	60,000	18.24	(1,094,347)
2023042403655	BO	USDMXN	06/22/2023	60,000	18.19	(1,091,236)
2023050403459	BO	USDMXN	06/22/2023	237,000	18.06	(4,280,225)
2023050803309	B	USDMXN	06/22/2023	250,000	17.95	(4,487,142)
2023052503562	BO	USDMXN	06/22/2023	11,904	17.94	(213,539)
2023060203537	SO	USDMXN	06/22/2023	(35,600)	17.60	626,640
2023060603339	B	USDMXN	06/22/2023	250,000	17.46	(4,363,763)
2023060903652	BO	USDMXN	06/22/2023	22,000	17.30	(380,648)
2023060903651	SO	USDMXN	06/22/2023	(11,000)	17.30	190,258
2023061203226	BO	USDMXN	06/22/2023	796,565	17.34	(13,814,396)
2023062003143	B	USDMXN	06/22/2023	1,000,000	17.16	(17,160,000)
2023062003149	B	USDMXN	06/22/2023	2,000,000	17.16	(34,310,000)
2023062003196	B	USDMXN	06/22/2023	185,000,000	17.17	(3,176,070,750)
2023062003202	B	USDMXN	06/22/2023	185,000,000	17.17	(3,176,070,750)
2023062003312	B	USDMXN	06/22/2023	2,500,000	17.22	(43,042,500)
2023062003128	S	USDMXN	06/22/2023	(2,000,000)	17.15	34,300,000
2023062003129	S	USDMXN	06/22/2023	(1,000,000)	17.15	17,153,710
2023062003130	S	USDMXN	06/22/2023	(2,000,000)	17.16	34,310,000
2023062003131	S	USDMXN	06/22/2023	(2,000,000)	17.16	34,310,000
2023062003159	S	USDMXN	06/22/2023	(1,000,000)	17.17	17,170,000
2023062003313	S	USDMXN	06/22/2023	(2,500,000)	17.22	43,037,500
2023062003335	S	USDMXN	06/22/2023	(150,000,000)	17.20	2,580,472,500
2023062103439	B	USDMXN	06/22/2023	150,000,000	17.15	(2,572,500,000)
2023062103371	S	USDMXN	06/22/2023	(100,000,000)	17.13	1,712,500,000
2022062403528	B	USDMXN	06/23/2023	1,460,000	21.32	(31,121,112)
2022062403531	S	USDMXN	06/23/2023	(1,460,000)	21.33	31,138,626
2022111803399	BO	USDMXN	06/23/2023	200,000	20.26	(4,051,958)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022121403536	SO	USDMXN	06/23/2023	(100.000)	20.40	2,039,617
2022122803071	BO	USDMXN	06/23/2023	1,210,000	20.04	(24,248,819)
2023011803545	BO	USDMXN	06/23/2023	25,000	19.38	(484,611)
2023012003455	BO	USDMXN	06/23/2023	303,018	19.40	(5,879,150)
2023013003417	B	USDMXN	06/23/2023	4,520,000	19.28	(87,143,399)
2023013003609	BO	USDMXN	06/23/2023	800,000	19.28	(15,421,580)
2023020203510	B	USDMXN	06/23/2023	300,000	19.15	(5,743,663)
2023020703007	SO	USDMXN	06/23/2023	(400,000)	19.53	7,813,180
2023030203456	BO	USDMXN	06/23/2023	50,000	18.50	(924,883)
2023030203597	B	USDMXN	06/23/2023	250,000	18.50	(4,625,647)
2023030303586	BO	USDMXN	06/23/2023	100,000	18.37	(1,837,362)
2023032403372	B	USDMXN	06/23/2023	222,400	18.80	(4,180,069)
2023042703069	BO	USDMXN	06/23/2023	500,000	18.26	(9,131,347)
2023042803410	BO	USDMXN	06/23/2023	10,000	18.21	(182,072)
2023050203441	B	USDMXN	06/23/2023	1,000,000	18.21	(18,212,074)
2023050203590	BO	USDMXN	06/23/2023	43,600	18.18	(792,620)
2023050803233	BO	USDMXN	06/23/2023	250,000	17.98	(4,495,021)
2023050803293	BO	USDMXN	06/23/2023	1,000,000	18.21	(18,212,074)
2023052603395	B	USDMXN	06/23/2023	2,059,024	17.75	(36,552,394)
2023052903433	B	USDMXN	06/23/2023	300,000	17.67	(5,302,191)
2023060203538	SO	USDMXN	06/23/2023	(418,000)	17.60	7,358,513
2023061403373	SO	USDMXN	06/23/2023	(100,000)	17.15	1,715,497
2023062203372	B	USDMXN	06/23/2023	100,000,000	17.13	(1,712,815,000)
2023062103307	S	USDMXN	06/23/2023	(570,000)	17.12	9,758,172
2023062103349	S	USDMXN	06/23/2023	(3,999,942)	17.11	68,456,207
2023062103440	S	USDMXN	06/23/2023	(150,000,000)	17.15	2,572,995,000
2023062203261	B	USDMXN	06/23/2023	150,000,000	17.15	(2,572,500,000)
2023062203142	S	USDMXN	06/23/2023	(40,000,000)	17.19	687,400,000
2023062203156	S	USDMXN	06/23/2023	(70,000,000)	17.17	1,201,900,000
2023062203605	S	USDMXN	06/23/2023	(25,000,000)	17.18	429,375,000
2023062303404	S	USDMXN	06/23/2023	(10,000,000)	17.17	171,650,000
2023042503298	BO	USDMXN	06/26/2023	100,000	18.18	(1,817,852)
2023052603403	BO	USDMXN	06/26/2023	500,000	17.85	(8,924,320)
2023053003758	BO	USDMXN	06/26/2023	43,000	17.75	(763,257)
2023060503488	SO	USDMXN	06/26/2023	(181,000)	17.52	3,171,679
2023060703578	SO	USDMXN	06/26/2023	(136,000)	17.42	2,369,173
2023060903310	S	USDMXN	06/26/2023	(9,600,000)	17.32	166,309,123
2023061603360	BO	USDMXN	06/26/2023	300,000	17.09	(5,128,187)
2023062203143	B	USDMXN	06/26/2023	40,000,000	17.19	(687,788,000)
2023062203157	B	USDMXN	06/26/2023	70,000,000	17.18	(1,202,579,000)
2023062203606	B	USDMXN	06/26/2023	25,000,000	17.18	(429,615,000)
2023062203622	B	USDMXN	06/26/2023	500,000	17.19	(8,594,225)
2023062203262	S	USDMXN	06/26/2023	(150,000,000)	17.16	2,574,030,000
2023062303219	B	USDMXN	06/26/2023	150,000,000	17.15	(2,572,500,000)
2023062303405	B	USDMXN	06/26/2023	10,000,000	17.17	(171,742,000)
2023062303032	S	USDMXN	06/26/2023	(58,139,000)	17.20	999,990,800
2023062303105	S	USDMXN	06/26/2023	(58,139,000)	17.20	999,990,800
2023062303183	S	USDMXN	06/26/2023	(50,000,000)	17.19	859,600,000
2023062303440	S	USDMXN	06/26/2023	(50,000,000)	17.19	859,600,000
2023062603530	S	USDMXN	06/26/2023	(30,000,000)	17.12	513,735,000
2023010303405	S	USDMXN	06/27/2023	(319,192)	20.03	6,394,919
2023010603368	BO	USDMXN	06/27/2023	100,000	19.78	(1,977,512)
2023012403437	B	MXNUSD	06/27/2023	97,627	19.36	(5,042)
2023012403440	S	USDMXN	06/27/2023	(92,585)	19.36	1,792,710
2023021303498	BO	USDMXN	06/27/2023	30,000	19.09	(572,568)
2023022803031	BO	USDMXN	06/27/2023	20,000	18.73	(374,619)
2023030903539	BO	USDMXN	06/27/2023	50,000	18.44	(921,844)
2023032703312	B	USDMXN	06/27/2023	4,000,000	18.68	(74,737,893)
2023032903597	BO	USDMXN	06/27/2023	400,000	18.40	(7,359,221)
2023040503414	BO	USDMXN	06/27/2023	150,000	18.39	(2,758,195)
2023041003209	B	USDMXN	06/27/2023	153,846	18.45	(2,838,923)
2023042703676	S	USDMXN	06/27/2023	(820,919)	18.25	14,983,327
2023050203372	B	USDMXN	06/27/2023	81,818	18.21	(1,490,268)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050403561	S	USDMXN	06/27/2023	(1,981,322)	18.09	35,839,363
2023050503416	BO	USDMXN	06/27/2023	95,238	17.94	(1,708,794)
2023050903478	B	USDMXN	06/27/2023	1,641,186	17.93	(29,423,504)
2023051603614	B	USDMXN	06/27/2023	1,321,315	17.60	(23,261,024)
2023052303511	B	USDMXN	06/27/2023	379,617	18.11	(6,874,707)
2023052503169	B	USDMXN	06/27/2023	48,000,000	17.96	(861,851,654)
2023052503528	B	USDMXN	06/27/2023	286,294	17.96	(5,142,170)
2023060603480	S	USDMXN	06/27/2023	(5,698,526)	17.47	99,572,429
2023060603486	S	USDMXN	06/27/2023	(897,720)	17.47	15,685,432
2023060803457	SO	USDMXN	06/27/2023	(281,000)	17.45	4,902,967
2023061203450	BO	USDMXN	06/27/2023	157,961	17.33	(2,737,282)
2023061503628	B	USDMXN	06/27/2023	1,850,206	17.13	(31,695,161)
2023062303033	B	USDMXN	06/27/2023	58,139,000	17.20	(1,000,176,845)
2023062303106	B	USDMXN	06/27/2023	58,139,000	17.20	(1,000,176,845)
2023062303172	B	USDMXN	06/27/2023	2,000,000	17.19	(34,370,000)
2023062303184	B	USDMXN	06/27/2023	50,000,000	17.20	(859,760,000)
2023062303284	B	USDMXN	06/27/2023	275,000	17.19	(4,726,989)
2023062303363	B	USDMXN	06/27/2023	2,000,000	17.17	(34,330,000)
2023062303441	B	USDMXN	06/27/2023	50,000,000	17.20	(859,760,000)
2023062303463	B	USDMXN	06/27/2023	160,164	17.16	(2,749,055)
2023062303615	B	USDMXN	06/27/2023	2,500,000	17.16	(42,900,000)
2023062303616	B	USDMXN	06/27/2023	2,500,000	17.16	(42,903,000)
2023062303220	S	USDMXN	06/27/2023	(150,000,000)	17.15	2,573,010,000
2023062303328	S	USDMXN	06/27/2023	(38,444)	17.17	660,272
2023062303331	S	USDMXN	06/27/2023	(40,000)	17.17	686,936
2023062303334	S	USDMXN	06/27/2023	(80,000)	17.18	1,374,120
2023062303335	S	USDMXN	06/27/2023	(164,400)	17.18	2,823,948
2023062303393	S	USDMXN	06/27/2023	(1,000,000)	17.16	17,162,520
2023062303395	S	USDMXN	06/27/2023	(1,000,000)	17.16	17,164,310
2023062303399	S	USDMXN	06/27/2023	(111,600)	17.17	1,915,714
2023062303603	S	USDMXN	06/27/2023	(9,347,150)	17.16	160,378,213
2023062303605	S	USDMXN	06/27/2023	(2,318,203)	17.16	39,778,509
2023062603399	B	USDMXN	06/27/2023	150,000,000	17.12	(2,568,000,000)
2023062603396	S	USDMXN	06/27/2023	(125,000,000)	17.12	2,140,250,000
2023041803630	B	USDMXN	06/28/2023	39,600	18.31	(724,976)
2023042803634	BO	USDMXN	06/28/2023	100,000	18.17	(1,817,485)
2023050503728	B	USDMXN	06/28/2023	61,500	17.97	(1,104,854)
2023052503650	BO	USDMXN	06/28/2023	17,400	17.97	(312,755)
2023052603816	BO	USDMXN	06/28/2023	89,108	17.74	(1,580,334)
2023052603819	BO	USDMXN	06/28/2023	492	17.78	(8,748)
2023053103374	BO	USDMXN	06/28/2023	132,000	17.83	(2,353,191)
2023060503420	BO	USDMXN	06/28/2023	49,600	17.56	(870,833)
2023060603146	BO	USDMXN	06/28/2023	139,464	17.51	(2,441,994)
2023060603151	BO	USDMXN	06/28/2023	608	17.51	(10,645)
2023060703575	BO	USDMXN	06/28/2023	42,800	17.44	(746,231)
2023060803544	B	USDMXN	06/28/2023	147,600	17.45	(2,574,894)
2023060803593	SO	USDMXN	06/28/2023	(100,000)	17.44	1,743,601
2023061303539	BO	USDMXN	06/28/2023	32,368	17.25	(558,383)
2023061403117	BO	USDMXN	06/28/2023	36,448	17.17	(625,800)
2023061603197	BO	USDMXN	06/28/2023	15,000	17.12	(256,755)
2023062103330	BO	USDMXN	06/28/2023	110,332	17.18	(1,895,412)
2023062603140	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.16	(17,156,210)
2023062603153	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.15	(17,154,250)
2023062603316	B	USDMXN	06/28/2023	500,000	17.14	(8,569,950)
2023062603381	B	USDMXN	06/28/2023	2,000,000	17.12	(34,240,000)
2023062603397	B	USDMXN	06/28/2023	125,000,000	17.13	(2,140,637,500)
2023062603414	B	USDMXN	06/28/2023	71,430	17.13	(1,223,489)
2023062603464	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,281,775)
2023062603466	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,723)
2023062603471	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,600)
2023062603476	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,525)
2023062603478	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,550)
2023062603480	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,426,240)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023062603482	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,900)
2023062603485	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,920)
2023062603487	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,325)
2023062603491	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,620)
2023062603493	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,282,000)
2023062603498	B	USDMXN	06/28/2023	300,000	17.13	(5,137,800)
2023062603500	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,200)
2023062603502	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,200)
2023062603504	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,281,475)
2023062603506	B	USDMXN	06/28/2023	200,000	17.13	(3,425,160)
2023062603508	B	USDMXN	06/28/2023	250,000	17.13	(4,281,425)
2023062603510	B	USDMXN	06/28/2023	333,333	17.13	(5,708,700)
2023062603513	B	USDMXN	06/28/2023	350,000	17.13	(5,994,205)
2023062603531	B	USDMXN	06/28/2023	30,000,000	17.13	(513,919,500)
2023062603714	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.13	(17,134,780)
2023062603735	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.13	(17,133,010)
2023062603747	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.13	(17,134,330)
2023062603750	B	USDMXN	06/28/2023	1,000,000	17.14	(17,139,130)
2023062603762	B	USDMXN	06/28/2023	5,000,000	17.15	(85,727,000)
2023062603177	S	USDMXN	06/28/2023	(1,000,000)	17.14	17,138,460
2023062603178	S	USDMXN	06/28/2023	(2,000,000)	17.14	34,274,400
2023062603188	S	USDMXN	06/28/2023	(1,000,000)	17.13	17,132,020
2023062603400	S	USDMXN	06/28/2023	(150,000,000)	17.12	2,568,510,000
2023062603410	S	USDMXN	06/28/2023	(570,000)	17.13	9,761,763
2023062603583	S	USDMXN	06/28/2023	(6,082,167)	17.13	104,200,895
2023062603588	S	USDMXN	06/28/2023	(3,998,172)	17.13	68,497,967
2023062703153	B	USDMXN	06/28/2023	150,000,000	17.07	(2,560,500,000)
2023062703041	S	USDMXN	06/28/2023	(120,000,000)	17.07	2,047,800,000
2022112903088	B	USDMXN	06/29/2023	1,750,000	19.89	(34,808,877)
2022113003432	B	USDMXN	06/29/2023	1,351,320	20.16	(27,236,434)
2022120203412	SO	USDMXN	06/29/2023	(200,000)	20.14	4,028,412
2023031403371	BO	USDMXN	06/29/2023	771,384	19.00	(14,658,994)
2023032703602	BO	USDMXN	06/29/2023	32,850	18.69	(614,073)
2023040303588	BO	USDMXN	06/29/2023	200,000	18.41	(3,682,625)
2023041203242	BO	USDMXN	06/29/2023	60,000	18.36	(1,101,314)
2023042003411	B	USDMXN	06/29/2023	60,000	18.26	(1,095,886)
2023042403656	BO	USDMXN	06/29/2023	60,000	18.21	(1,092,752)
2023050403460	BO	USDMXN	06/29/2023	237,000	18.08	(4,286,136)
2023050503612	BO	USDMXN	06/29/2023	25,000	17.97	(449,366)
2023050803365	B	USDMXN	06/29/2023	250,000	17.97	(4,493,434)
2023052503564	BO	USDMXN	06/29/2023	11,904	17.96	(213,837)
2023060103540	BO	USDMXN	06/29/2023	157,000	17.65	(2,771,705)
2023060103609	BO	USDMXN	06/29/2023	93	17.65	(1,644)
2023060603337	B	USDMXN	06/29/2023	250,000	17.48	(4,370,276)
2023061203225	BO	USDMXN	06/29/2023	796,565	17.37	(13,833,565)
2023062203621	BO	USDMXN	06/29/2023	5,952	17.20	(102,366)
2023062203623	S	USDMXN	06/29/2023	(500,000)	17.20	8,599,158
2023062603827	B	USDMXN	06/29/2023	5,000,000	17.15	(85,727,000)
2023062703042	B	USDMXN	06/29/2023	120,000,000	17.07	(2,048,178,000)
2023062703293	B	USDMXN	06/29/2023	1,000,000	17.11	(17,112,460)
2023062703423	B	USDMXN	06/29/2023	912,221	17.11	(15,607,205)
2023062703428	B	USDMXN	06/29/2023	416,819	17.11	(7,131,357)
2023062703431	B	USDMXN	06/29/2023	3,163,044	17.11	(54,107,766)
2023062703536	B	USDMXN	06/29/2023	47,615	17.09	(813,823)
2023062703154	S	USDMXN	06/29/2023	(150,000,000)	17.07	2,561,002,500
2023062703227	S	USDMXN	06/29/2023	(1,000,000)	17.09	17,090,000
2023062703406	S	USDMXN	06/29/2023	(4,000,000)	17.11	68,440,000
2023062703474	S	USDMXN	06/29/2023	(20,000,000)	17.10	342,068,000
2023062703506	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,610
2023062703513	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,592
2023062703515	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,610
2023062703517	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,610
2023062703519	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,610

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023062703521	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,658
2023062703523	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,658
2023062703525	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,628
2023062703527	S	USDMXN	06/29/2023	(60,000)	17.09	1,025,472
2023062703644	S	USDMXN	06/29/2023	(199,690)	17.09	3,411,704
2023062703668	S	USDMXN	06/29/2023	(300,000)	17.08	5,124,063
2023062703674	S	USDMXN	06/29/2023	(1,000,000)	17.08	17,080,420
2023062703675	S	USDMXN	06/29/2023	(1,000,000)	17.08	17,080,180
2023062803270	B	USDMXN	06/29/2023	150,000,000	17.08	(2,562,000,000)
2023062803636	B	USDMXN	06/29/2023	2,000,000	17.10	(34,191,460)
2023062803155	S	USDMXN	06/29/2023	(33,000,000)	17.10	564,300,000
2023062803264	S	USDMXN	06/29/2023	(117,116,590)	17.08	2,000,000,000
2022070103348	S	USDMXN	06/30/2023	(127,000)	21.74	2,761,335
2022100503286	B	USDMXN	06/30/2023	640,000	21.12	(13,517,754)
2022110103565	B	USDMXN	06/30/2023	3,590,000	20.63	(74,044,364)
2023012003456	BO	USDMXN	06/30/2023	662,889	19.43	(12,877,899)
2023030203457	BO	USDMXN	06/30/2023	50,000	18.52	(926,125)
2023030203599	B	USDMXN	06/30/2023	250,000	18.53	(4,631,805)
2023031003605	SO	USDMXN	06/30/2023	(125,000)	18.89	2,361,084
2023031403109	SO	USDMXN	06/30/2023	(125,000)	19.49	2,436,492
2023041303566	B	USDMXN	06/30/2023	2,000,000	18.29	(36,574,818)
2023051803305	B	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.90	(10,415,420)
2023051803483	B	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.86	(10,394,748)
2023052203402	B	USDMXN	06/30/2023	582,000	18.04	(10,499,220)
2023052303049	BO	USDMXN	06/30/2023	582,000	18.11	(10,539,490)
2023052403176	BO	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.97	(10,456,647)
2023052503523	B	USDMXN	06/30/2023	412,000	17.97	(7,404,765)
2023052503525	B	USDMXN	06/30/2023	170,000	17.97	(3,055,337)
2023052603413	B	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.77	(10,344,811)
2023053003425	B	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.76	(10,338,960)
2023053003721	BO	USDMXN	06/30/2023	250,000	17.76	(4,440,985)
2023053103491	BO	USDMXN	06/30/2023	582,000	17.80	(10,358,022)
2023060903592	SO	USDMXN	06/30/2023	(417,000)	17.33	7,224,988
2023062803004	B	USDMXN	06/30/2023	1,000,000	17.08	(17,083,600)
2023062803038	B	USDMXN	06/30/2023	1,000,000	17.08	(17,080,780)
2023062803041	B	USDMXN	06/30/2023	1,000,000	17.08	(17,082,200)
2023062803113	B	USDMXN	06/30/2023	570,000	17.10	(9,748,676)
2023062803156	B	USDMXN	06/30/2023	33,000,000	17.10	(564,402,300)
2023062803265	B	USDMXN	06/30/2023	117,094,990	17.08	(2,000,000,000)
2023062803409	B	USDMXN	06/30/2023	750,000	17.07	(12,798,750)
2023062803432	B	USDMXN	06/30/2023	20,869	17.06	(355,987)
2023062803098	S	USDMXN	06/30/2023	(2,000,000)	17.10	34,200,000
2023062803271	S	USDMXN	06/30/2023	(150,000,000)	17.08	2,562,502,500
2023062803273	S	USDMXN	06/30/2023	(570,000)	17.07	9,728,458
2023062803649	S	USDMXN	06/30/2023	(1,000,000)	17.10	17,095,670
2023062903423	B	USDMXN	06/30/2023	100,000,000	17.10	(1,710,000,000)
2023062903425	B	USDMXN	06/30/2023	100,000,000	17.10	(1,710,000,000)
2023062903045	S	USDMXN	06/30/2023	(50,000,000)	17.14	856,750,000
2023062903050	S	USDMXN	06/30/2023	(58,339,653)	17.14	1,000,000,000
2023062903205	S	USDMXN	06/30/2023	(50,000,000)	17.12	856,000,000
2023031703589	B	EURMXN	04/24/2023	290,000	20.39	(5,911,863)
2022033003343	B	USDMXN	04/03/2023	10,000,000	21.31	(213,080,000)
2022083103240	S	USDMXN	04/03/2023	(10,000,000)	20.98	209,800,000
2023013003358	S	USDMXN	04/03/2023	(10,000,000)	18.99	189,880,000
2023022803670	B	USDMXN	04/03/2023	60,000,000	18.43	(1,106,034,000)
2023030103241	BON	USDMXN	04/03/2023	30,000,000	18.24	(547,221,000)
2023030103325	S	USDMXN	04/03/2023	(30,000,000)	18.20	545,850,000
2023033003078	B	USDMXN	04/03/2023	30,000,000	18.13	(543,840,000)
2023033003081	BO	USDMXN	04/03/2023	0	18.13	(3,381,000)
2023033003454	B	USDMXN	04/03/2023	30,000,000	18.08	(542,250,000)
2023033003006	S	USDMXN	04/03/2023	(55,000,000)	18.14	997,810,000
2023033003064	S	USDMXN	04/03/2023	(368,996)	18.13	6,690,885
2023033003080	SON	USDMXN	04/03/2023	(30,000,000)	18.24	547,221,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023033103001	S	USDMXN	04/03/2023	(631.004)	18.02	11,367,637
2023040303084	S	USDMXN	04/03/2023	(16,000,000)	18.03	288,480,000
2022110903214	B	USDMXN	04/04/2023	55,000,000	20.11	(1,106,044,500)
2022110903307	B	USDMXN	04/04/2023	55,000,000	20.08	(1,104,400,000)
2023033103002	B	USDMXN	04/04/2023	631,004	18.02	(11,370,196)
2023040303085	B	USDMXN	04/04/2023	16,000,000	18.03	(288,536,800)
2023040303088	B	USDMXN	04/04/2023	368,996	18.05	(6,660,735)
2022040103141	B	USDMXN	04/05/2023	5,000,000	21.26	(106,307,500)
2023040303119	B	USDMXN	04/05/2023	45,000,000	18.08	(813,600,000)
2023040303089	S	USDMXN	04/05/2023	(368,996)	18.05	6,661,956
2023040303113	S	USDMXN	04/05/2023	(30,000,000)	18.06	541,725,000
2023040403214	B	USDMXN	04/05/2023	14,000,000	18.05	(252,742,000)
2023040403218	B	USDMXN	04/05/2023	368,996	18.05	(6,661,490)
2022040503022	B	USDMXN	04/10/2023	3,000,000	21.22	(63,654,000)
2023010403438	S	USDMXN	04/10/2023	(6,000,000)	19.72	118,320,000
2023020703233	S	USDMXN	04/10/2023	(30,000,000)	19.26	577,650,000
2023030203057	B	USDMXN	04/10/2023	20,000,000	18.27	(365,470,000)
2023030303255	BON	USDMXN	04/10/2023	30,000,000	18.13	(543,919,500)
2023030303362	BON	USDMXN	04/10/2023	30,000,000	18.13	(543,921,000)
2023030303418	S	USDMXN	04/10/2023	(30,000,000)	18.11	543,435,000
2023030803172	B	USDMXN	04/10/2023	20,000,000	18.05	(360,980,000)
2023040403226	BO	USDMXN	04/10/2023	0	18.11	(591,000)
2023040403242	B	USDMXN	04/10/2023	30,000,000	18.08	(542,250,000)
2023040403249	B	USDMXN	04/10/2023	10,000,000	18.17	(181,650,000)
2023040403410	B	USDMXN	04/10/2023	10,000,000	18.12	(181,200,000)
2023040403215	S	USDMXN	04/10/2023	(14,000,000)	18.07	252,991,200
2023040403219	S	USDMXN	04/10/2023	(368,996)	18.07	6,667,860
2023040403225	SON	USDMXN	04/10/2023	(30,000,000)	18.13	543,921,000
2023040503002	S	USDMXN	04/10/2023	(631,004)	18.16	11,460,260
2023040503006	S	USDMXN	04/10/2023	(12,000,000)	18.16	217,932,000
2023040503010	S	USDMXN	04/10/2023	(12,000,000)	18.16	217,968,000
2023040503003	B	USDMXN	04/11/2023	631,004	18.17	(11,462,828)
2023040503007	B	USDMXN	04/11/2023	12,000,000	18.16	(217,978,800)
2023040503011	B	USDMXN	04/11/2023	12,000,000	18.17	(218,014,800)
2023040503218	B	USDMXN	04/11/2023	30,000,000	18.33	(549,750,000)
2023040503101	S	USDMXN	04/11/2023	(30,000,000)	18.36	550,860,000
2023041003070	B	USDMXN	04/11/2023	12,000,000	18.24	(218,868,000)
2023041003076	B	USDMXN	04/11/2023	368,996	18.24	(6,730,839)
2023020703198	BON	USDMXN	04/12/2023	35,000,000	19.28	(674,747,500)
2023041003262	BO	USDMXN	04/12/2023	0	18.21	(37,450,000)
2023041003274	B	USDMXN	04/12/2023	30,000,000	18.16	(544,650,000)
2023041003071	S	USDMXN	04/12/2023	(12,000,000)	18.24	218,928,000
2023041003077	S	USDMXN	04/12/2023	(368,996)	18.25	6,732,544
2023041003261	SON	USDMXN	04/12/2023	(35,000,000)	19.28	674,747,500
2023041003503	S	USDMXN	04/12/2023	(35,000,000)	18.15	635,250,000
2023041003603	S	USDMXN	04/12/2023	(30,000,000)	18.16	544,854,000
2023041103145	S	USDMXN	04/12/2023	(37,000,000)	18.22	674,029,000
2023041103148	S	USDMXN	04/12/2023	(631,004)	18.19	11,477,152
2022101103103	S	USDMXN	04/13/2023	(10,000,000)	20.66	206,580,000
2023020903591	B	USDMXN	04/13/2023	10,000,000	18.98	(189,775,000)
2023020903537	S	USDMXN	04/13/2023	(20,000,000)	18.99	379,740,000
2023041103146	B	USDMXN	04/13/2023	37,000,000	18.22	(674,217,700)
2023041103149	B	USDMXN	04/13/2023	631,004	18.19	(11,480,748)
2023041103203	B	USDMXN	04/13/2023	3,408,466	18.19	(62,000,000)
2023041103329	S	USDMXN	04/13/2023	(3,415,978)	18.15	62,000,000
2023041203013	S	USDMXN	04/13/2023	(623,493)	18.05	11,254,566
2023041203041	S	USDMXN	04/13/2023	(17,000,000)	18.04	306,595,000
2023031003641	S	USDMXN	04/14/2023	(30,000,000)	18.61	558,405,000
2023041203014	B	USDMXN	04/14/2023	623,493	18.06	(11,257,660)
2023041203042	B	USDMXN	04/14/2023	17,000,000	18.04	(306,673,200)
2023041203007	S	USDMXN	04/14/2023	(20,000,000)	18.09	361,760,000
2023041203549	S	USDMXN	04/14/2023	(30,000,000)	18.09	542,760,000
2023041203582	S	USDMXN	04/14/2023	(20,000,000)	18.09	361,760,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023041303039	B	USDMXN	04/14/2023	376,507	18.04	(6,790,799)
2023041303106	B	USDMXN	04/14/2023	34,000,000	18.04	(613,190,000)
2023041403036	S	USDMXN	04/14/2023	(20,000,000)	18.07	361,400,000
2023041403040	S	USDMXN	04/14/2023	(30,000,000)	18.08	542,400,000
2022081203439	B	USDMXN	04/17/2023	30,000,000	20.79	(623,550,000)
2022081203453	B	USDMXN	04/17/2023	30,000,000	20.79	(623,550,000)
2023021403082	S	USDMXN	04/17/2023	(20,000,000)	18.86	377,230,000
2023021403234	S	USDMXN	04/17/2023	(20,000,000)	18.79	375,790,000
2023021503451	B	USDMXN	04/17/2023	15,000,000	18.83	(282,510,000)
2023031303350	S	USDMXN	04/17/2023	(10,000,000)	18.94	189,440,000
2023041003604	B	USDMXN	04/17/2023	30,000,000	18.18	(545,505,726)
2023041303040	S	USDMXN	04/17/2023	(376,507)	18.05	6,795,655
2023041303107	S	USDMXN	04/17/2023	(34,000,000)	18.05	613,645,600
2023041403000	B	USDMXN	04/17/2023	376,507	18.07	(6,802,156)
2023041403026	B	USDMXN	04/17/2023	39,000,000	18.05	(703,950,000)
2023041403037	B	USDMXN	04/17/2023	20,000,000	18.08	(361,660,000)
2023041403041	B	USDMXN	04/17/2023	30,000,000	18.09	(542,791,500)
2023041703344	B	USDMXN	04/17/2023	42,000,000	18.09	(759,780,000)
2023041703006	S	USDMXN	04/17/2023	(33,900,000)	18.03	611,217,000
2023041703478	S	USDMXN	04/17/2023	(72,000,000)	18.07	1,301,040,000
2023041403001	S	USDMXN	04/18/2023	(376,507)	18.07	6,803,788
2023041403027	S	USDMXN	04/18/2023	(39,000,000)	18.05	704,129,400
2023041703007	B	USDMXN	04/18/2023	33,900,000	18.03	(611,366,160)
2023041703104	B	USDMXN	04/18/2023	376,507	18.13	(6,825,614)
2023041703441	B	USDMXN	04/18/2023	29,000,000	18.07	(523,885,000)
2023041703479	B	USDMXN	04/18/2023	72,000,000	18.07	(1,301,392,800)
2023041703345	S	USDMXN	04/18/2023	(42,000,000)	18.09	759,973,200
2023041803041	S	USDMXN	04/18/2023	(75,000,000)	18.07	1,355,550,000
2023041803126	S	USDMXN	04/18/2023	(16,600,000)	18.08	300,128,000
2023041803138	S	USDMXN	04/18/2023	(16,600,000)	18.08	300,078,200
2023041803143	S	USDMXN	04/18/2023	(43,400,000)	18.07	784,172,900
2023021403278	BON	USDMXN	04/19/2023	35,000,000	18.81	(658,280,000)
2023041703096	B	USDMXN	04/19/2023	35,000,000	18.12	(634,200,000)
2023041703144	BO	USDMXN	04/19/2023	0	18.14	(23,222,500)
2023041703105	S	USDMXN	04/19/2023	(376,507)	18.13	6,827,244
2023041703143	SON	USDMXN	04/19/2023	(35,000,000)	18.81	658,280,000
2023041703442	S	USDMXN	04/19/2023	(29,000,000)	18.07	524,018,400
2023041803008	B	USDMXN	04/19/2023	376,507	18.02	(6,784,010)
2023041803042	B	USDMXN	04/19/2023	75,000,000	18.08	(1,355,880,000)
2023041803127	B	USDMXN	04/19/2023	16,600,000	18.08	(300,201,040)
2023041803139	B	USDMXN	04/19/2023	16,600,000	18.08	(300,151,240)
2023041803144	B	USDMXN	04/19/2023	43,400,000	18.07	(784,363,860)
2023041803097	S	USDMXN	04/19/2023	(6,000,000)	18.07	108,444,000
2023041903116	S	USDMXN	04/19/2023	(52,000,000)	18.06	939,120,000
2023011803235	BON	USDMXN	04/20/2023	40,000,000	19.02	(760,948,000)
2023011803241	S	USDMXN	04/20/2023	(40,000,000)	18.95	757,960,000
2023041803098	B	USDMXN	04/20/2023	6,000,000	18.08	(108,470,700)
2023041803101	BO	USDMXN	04/20/2023	0	18.07	(38,018,000)
2023041803102	B	USDMXN	04/20/2023	40,000,000	18.07	(722,930,000)
2023041803009	S	USDMXN	04/20/2023	(376,507)	18.02	6,785,602
2023041803100	SON	USDMXN	04/20/2023	(40,000,000)	19.02	760,948,000
2023041903032	B	USDMXN	04/20/2023	376,507	18.05	(6,796,511)
2023041903117	B	USDMXN	04/20/2023	52,000,000	18.06	(939,369,600)
2023041903047	S	USDMXN	04/20/2023	(6,000,000)	18.05	108,300,000
2023042003083	S	USDMXN	04/20/2023	(60,000,000)	18.04	1,082,400,000
2023042003171	S	USDMXN	04/20/2023	(6,000,000)	18.01	108,060,000
2023041903048	B	USDMXN	04/21/2023	6,000,000	18.05	(108,328,200)
2023041903263	B	USDMXN	04/21/2023	10,000,000	18.05	(180,480,000)
2023041903033	S	USDMXN	04/21/2023	(376,507)	18.06	6,798,103
2023042003084	B	USDMXN	04/21/2023	60,000,000	18.05	(1,082,970,000)
2023042003126	B	USDMXN	04/21/2023	278,157	17.99	(5,004,787)
2023042003144	B	USDMXN	04/21/2023	11,000,000	18.01	(198,110,000)
2023042003172	B	USDMXN	04/21/2023	6,000,000	18.02	(108,117,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042103029	S	USDMXN	04/21/2023	(80,000,000)	17.98	1,438,240,000
2022101003266	B	USDMXN	04/24/2023	25,000,000	20.65	(516,307,500)
2022101003268	S	USDMXN	04/24/2023	(25,000,000)	20.71	517,675,000
2023011903523	B	USDMXN	04/24/2023	10,000,000	19.36	(193,620,000)
2023021703653	S	USDMXN	04/24/2023	(20,000,000)	18.57	371,450,000
2023042003127	S	USDMXN	04/24/2023	(278,157)	18.01	5,009,668
2023042003145	S	USDMXN	04/24/2023	(11,000,000)	18.03	198,308,000
2023042003251	S	USDMXN	04/24/2023	(30,000,000)	18.02	540,450,000
2023042003569	S	USDMXN	04/24/2023	(20,000,000)	18.03	360,600,000
2023042103030	B	USDMXN	04/24/2023	80,000,000	17.99	(1,439,360,000)
2023042103171	B	USDMXN	04/24/2023	64,000,000	18.01	(1,152,640,000)
2023042103205	B	USDMXN	04/24/2023	586,700	18.01	(10,568,653)
2022082303204	B	USDMXN	04/25/2023	40,000,000	20.99	(839,720,000)
2023042103398	B	USDMXN	04/25/2023	20,000,000	17.99	(359,700,000)
2023042103414	B	USDMXN	04/25/2023	25,000,000	17.99	(449,675,000)
2023042103050	S	USDMXN	04/25/2023	(20,000,000)	18.00	360,000,000
2023042103172	S	USDMXN	04/25/2023	(64,000,000)	18.02	1,152,972,800
2023042103206	S	USDMXN	04/25/2023	(586,700)	18.02	10,571,455
2023042403001	S	USDMXN	04/25/2023	(413,300)	17.98	7,432,508
2023042503142	S	USDMXN	04/25/2023	(50,000,000)	18.07	903,250,000
2022072503518	S	USDMXN	04/26/2023	(50,000,000)	21.64	1,081,775,000
2022072503522	S	USDMXN	04/26/2023	(50,000,000)	21.64	1,081,775,000
2022072503526	S	USDMXN	04/26/2023	(50,000,000)	21.64	1,081,775,000
2022080903290	B	USDMXN	04/26/2023	35,000,000	21.26	(744,117,920)
2023012503302	BON	USDMXN	04/26/2023	37,000,000	19.13	(707,909,900)
2023042403002	B	USDMXN	04/26/2023	413,300	17.99	(7,434,150)
2023042403198	BO	USDMXN	04/26/2023	0	18.03	(40,651,900)
2023042403199	B	USDMXN	04/26/2023	30,000,000	18.03	(541,020,000)
2023042403578	B	USDMXN	04/26/2023	10,000,000	17.97	(179,700,000)
2023042403197	SON	USDMXN	04/26/2023	(37,000,000)	19.13	707,909,900
2023042503037	B	USDMXN	04/26/2023	586,700	18.05	(10,590,156)
2023042503143	B	USDMXN	04/26/2023	50,000,000	18.07	(903,440,000)
2023042503149	S	USDMXN	04/26/2023	(13,000,000)	18.07	234,884,000
2023042603380	B	USDMXN	04/26/2023	20,000,000	18.09	(361,700,000)
2023042603058	S	USDMXN	04/26/2023	(60,000,000)	18.16	1,089,300,000
2023012503178	S	USDMXN	04/27/2023	(20,000,000)	19.12	382,370,000
2023012503200	S	USDMXN	04/27/2023	(20,000,000)	19.14	382,860,000
2023032303030	B	USDMXN	04/27/2023	30,000,000	18.67	(560,220,000)
2023032703128	BON	USDMXN	04/27/2023	16,000,000	18.50	(295,952,000)
2023042503039	B	USDMXN	04/27/2023	20,000,000	18.04	(360,740,000)
2023042503122	BO	USDMXN	04/27/2023	0	18.08	(6,640,000)
2023042503150	B	USDMXN	04/27/2023	13,000,000	18.07	(234,933,400)
2023042503038	S	USDMXN	04/27/2023	(586,700)	18.05	10,592,400
2023042503121	SON	USDMXN	04/27/2023	(16,000,000)	18.50	295,952,000
2023042503132	S	USDMXN	04/27/2023	(24,000,000)	18.08	433,968,000
2023042603000	B	USDMXN	04/27/2023	586,700	18.09	(10,611,383)
2023042603059	B	USDMXN	04/27/2023	60,000,000	18.16	(1,089,540,000)
2023042603268	B	USDMXN	04/27/2023	31,000,000	18.11	(561,255,000)
2022112803077	B	USDMXN	04/28/2023	37,716,872	19.89	(750,000,000)
2022112803073	S	USDMXN	04/28/2023	(37,722,563)	19.88	750,000,000
2023032403049	S	USDMXN	04/28/2023	(30,000,000)	18.73	561,849,000
2023042603179	B	USDMXN	04/28/2023	20,000,000	18.11	(362,140,000)
2023042603507	B	USDMXN	04/28/2023	30,000,000	18.13	(543,840,000)
2023042603001	S	USDMXN	04/28/2023	(586,700)	18.09	10,613,697
2023042603269	S	USDMXN	04/28/2023	(31,000,000)	18.11	561,385,200
2023042603381	S	USDMXN	04/28/2023	(20,000,000)	18.09	361,856,000
2023042703048	B	USDMXN	04/28/2023	592,391	18.07	(10,703,953)
2023042703061	B	USDMXN	04/28/2023	11,000,000	18.09	(198,935,000)
2023042703065	B	USDMXN	04/28/2023	11,000,000	18.08	(198,880,000)
2023042803485	B	USDMXN	04/28/2023	9,000,000	17.98	(161,820,000)
2023042803196	S	USDMXN	04/28/2023	(46,500,000)	18.01	837,465,000
2023042803599	S	USDMXN	04/28/2023	(9,000,000)	18.00	162,000,000
2023013103513	B	USDMXN	05/02/2023	30,000,000	19.13	(573,765,000)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023022703258	S	USDMXN	05/02/2023	(30,000,000)	18.61	558,240,000
2023042703554	B	USDMXN	05/02/2023	20,000,000	18.04	(360,800,000)
2023042703049	S	USDMXN	05/02/2023	(592,391)	18.09	10,714,105
2023042703062	S	USDMXN	05/02/2023	(11,000,000)	18.10	199,127,500
2023042703066	S	USDMXN	05/02/2023	(11,000,000)	18.10	199,072,500
2023042703119	S	USDMXN	05/02/2023	(40,000,000)	18.07	722,800,000
2023042703394	S	USDMXN	05/02/2023	(10,000,000)	18.06	180,550,000
2023042803065	B	USDMXN	05/02/2023	592,391	18.00	(10,663,740)
2023042803071	B	USDMXN	05/02/2023	41,000,000	18.03	(739,107,000)
2023042803197	B	USDMXN	05/02/2023	46,500,000	18.03	(838,390,350)
2023042803600	B	USDMXN	05/02/2023	9,000,000	18.02	(162,193,500)
2023042803486	S	USDMXN	05/02/2023	(9,000,000)	18.00	162,010,800
2023020103169	S	USDMXN	05/03/2023	(50,000,000)	19.05	952,700,000
2023022703241	BON	USDMXN	05/03/2023	40,000,000	18.60	(743,980,000)
2023042803060	B	USDMXN	05/03/2023	10,000,000	17.98	(179,750,000)
2023042803260	BO	USDMXN	05/03/2023	0	18.04	(22,420,000)
2023042803293	B	USDMXN	05/03/2023	1,000,000	18.00	(18,000,900)
2023042803609	B	USDMXN	05/03/2023	30,000,000	17.99	(539,700,000)
2023042803066	S	USDMXN	05/03/2023	(592,391)	18.01	10,666,180
2023042803072	S	USDMXN	05/03/2023	(41,000,000)	18.03	739,283,300
2023042803259	SON	USDMXN	05/03/2023	(40,000,000)	18.60	743,980,000
2023050203023	B	USDMXN	05/03/2023	592,391	17.97	(10,645,310)
2023050203276	B	USDMXN	05/03/2023	36,000,000	18.04	(649,404,000)
2023050303029	S	USDMXN	05/03/2023	(30,000,000)	17.97	538,950,000
2023020103184	BON	USDMXN	05/04/2023	25,000,000	19.06	(476,573,750)
2023020103229	BON	USDMXN	05/04/2023	25,000,000	19.06	(476,575,000)
2023050203047	BO	USDMXN	05/04/2023	0	18.02	(25,975,000)
2023050203101	B	USDMXN	05/04/2023	30,000,000	18.08	(542,250,000)
2023050203024	S	USDMXN	05/04/2023	(592,391)	17.97	10,647,639
2023050203046	SON	USDMXN	05/04/2023	(25,000,000)	19.06	476,575,000
2023050203277	S	USDMXN	05/04/2023	(36,000,000)	18.04	649,548,000
2023050303030	B	USDMXN	05/04/2023	30,000,000	17.97	(539,053,500)
2023050303001	S	USDMXN	05/04/2023	(3,407,609)	17.94	61,118,770
2023050403035	S	USDMXN	05/04/2023	(30,000,000)	17.95	538,350,000
2023040303111	BON	USDMXN	05/05/2023	30,000,000	18.16	(544,845,000)
2023040303120	S	USDMXN	05/05/2023	(45,000,000)	18.19	818,392,500
2023050303002	B	USDMXN	05/05/2023	3,407,609	17.94	(61,132,162)
2023050303108	BO	USDMXN	05/05/2023	0	17.91	(7,545,000)
2023050303113	B	USDMXN	05/05/2023	25,000,000	17.91	(447,750,000)
2023050303107	SON	USDMXN	05/05/2023	(30,000,000)	18.16	544,845,000
2023050303324	S	USDMXN	05/05/2023	(20,000,000)	17.90	358,000,000
2023050303587	S	USDMXN	05/05/2023	(10,000,000)	17.93	179,305,000
2023050403036	B	USDMXN	05/05/2023	30,000,000	17.95	(538,452,000)
2023050403038	B	USDMXN	05/05/2023	592,391	17.98	(10,654,007)
2023050403052	B	USDMXN	05/05/2023	41,000,000	17.94	(735,540,000)
2023050403060	B	USDMXN	05/05/2023	41,000,000	17.99	(737,590,000)
2023050503171	B	USDMXN	05/05/2023	74,761,102	17.79	(1,330,000,000)
2023050503312	B	USDMXN	05/05/2023	30,000,000	17.77	(532,950,000)
2023050503314	B	USDMXN	05/05/2023	45,000,000	17.77	(799,650,000)
2023050503320	B	USDMXN	05/05/2023	70,231	17.77	(1,248,229)
2023050503069	S	USDMXN	05/05/2023	(30,000,000)	17.80	534,000,000
2023050503299	S	USDMXN	05/05/2023	(23,092,087)	17.76	410,000,000
2023050503307	S	USDMXN	05/05/2023	(51,816,000)	17.76	919,993,080
2023050503310	S	USDMXN	05/05/2023	(74,923,246)	17.75	1,330,000,000
2023030303488	S	USDMXN	05/08/2023	(20,000,000)	18.20	364,040,000
2023030603597	B	USDMXN	05/08/2023	20,000,000	18.22	(364,410,000)
2023040403236	BON	USDMXN	05/08/2023	30,000,000	18.21	(546,255,000)
2023050403078	BO	USDMXN	05/08/2023	0	17.99	(6,525,000)
2023050403262	B	USDMXN	05/08/2023	20,000,000	17.95	(359,000,000)
2023050403293	B	USDMXN	05/08/2023	30,000,000	17.95	(538,500,000)
2023050403295	B	USDMXN	05/08/2023	30,000,000	17.95	(538,500,000)
2023050403039	S	USDMXN	05/08/2023	(592,391)	18.00	10,660,256
2023050403053	S	USDMXN	05/08/2023	(41,000,000)	17.95	735,978,700



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050403061	S	USDMXN	05/08/2023	(41,000,000)	18.00	738,028,700
2023050403077	SON	USDMXN	05/08/2023	(30,000,000)	18.21	546,255,000
2023050403308	S	USDMXN	05/08/2023	(10,000,000)	17.95	179,500,000
2023050403540	S	USDMXN	05/08/2023	(20,000,000)	17.91	358,200,000
2023050503070	B	USDMXN	05/08/2023	30,000,000	17.81	(534,294,000)
2023050503300	B	USDMXN	05/08/2023	23,079,608	17.76	(410,000,000)
2023050503308	B	USDMXN	05/08/2023	51,816,000	17.76	(920,500,877)
2023050503311	B	USDMXN	05/08/2023	74,882,749	17.76	(1,330,000,000)
2023050503326	B	USDMXN	05/08/2023	11,814	17.78	(210,023)
20230505033050	S	USDMXN	05/08/2023	(407,609)	17.80	7,256,324
2023050503052	S	USDMXN	05/08/2023	(8,000,000)	17.81	142,480,000
2023050503172	S	USDMXN	05/08/2023	(74,719,941)	17.80	1,330,000,000
2023050503313	S	USDMXN	05/08/2023	(30,000,000)	17.77	533,227,500
2023050503315	S	USDMXN	05/08/2023	(45,000,000)	17.78	800,082,000
2023050503321	S	USDMXN	05/08/2023	(70,231)	17.78	1,248,708
2022110703342	B	USDMXN	05/09/2023	10,000,000	20.13	(201,300,000)
2023030703626	S	USDMXN	05/09/2023	(30,000,000)	18.35	550,350,000
2023040503095	BON	USDMXN	05/09/2023	30,000,000	18.46	(553,851,000)
2023042103399	S	USDMXN	05/09/2023	(20,000,000)	18.05	360,910,000
2023050503051	B	USDMXN	05/09/2023	407,609	17.81	(7,257,802)
2023050503053	B	USDMXN	05/09/2023	8,000,000	17.81	(142,508,800)
2023050503361	BO	USDMXN	05/09/2023	0	17.82	(19,161,000)
2023050503369	B	USDMXN	05/09/2023	40,000,000	17.78	(711,200,000)
2023050503327	S	USDMXN	05/09/2023	(11,814)	17.78	210,063
2023050503360	SON	USDMXN	05/09/2023	(30,000,000)	18.46	553,851,000
2023050803000	B	USDMXN	05/09/2023	1,604,206	17.82	(28,584,112)
2023050803062	S	USDMXN	05/09/2023	(20,000,000)	17.82	356,400,000
2023050903046	S	USDMXN	05/09/2023	(43,000,000)	17.78	764,540,000
2023030703223	BON	USDMXN	05/10/2023	40,000,000	18.38	(735,108,000)
2023040403243	S	USDMXN	05/10/2023	(30,000,000)	18.18	545,445,000
2023040403250	S	USDMXN	05/10/2023	(10,000,000)	18.27	182,725,000
2023050803063	B	USDMXN	05/10/2023	20,000,000	17.82	(356,468,000)
2023050803167	BO	USDMXN	05/10/2023	0	17.82	(22,348,000)
2023050803175	B	USDMXN	05/10/2023	30,000,000	17.82	(534,570,000)
2023050803001	S	USDMXN	05/10/2023	(1,604,206)	17.82	28,589,511
2023050803166	SON	USDMXN	05/10/2023	(40,000,000)	18.38	735,108,000
2023050803169	S	USDMXN	05/10/2023	(30,000,000)	17.82	534,570,000
2023050903007	B	USDMXN	05/10/2023	1,604,206	17.82	(28,590,361)
2023050903047	B	USDMXN	05/10/2023	43,000,000	17.78	(764,669,000)
2023051003089	S	USDMXN	05/10/2023	(20,000,000)	17.62	352,440,000
2022110403340	S	USDMXN	05/11/2023	(5,000,000)	20.19	100,929,700
2022110403617	SO	USDMXN	05/11/2023	(5,000,000)	20.19	100,929,700
2023040503219	S	USDMXN	05/11/2023	(30,000,000)	18.44	553,065,000
2023050903201	B	USDMXN	05/11/2023	10,000,000	17.76	(177,600,000)
2023050903278	B	USDMXN	05/11/2023	30,000,000	17.76	(532,860,000)
2023050903282	B	USDMXN	05/11/2023	10,000,000	17.76	(177,600,000)
2023050903008	S	USDMXN	05/11/2023	(1,604,206)	17.83	28,595,286
2023050903116	S	USDMXN	05/11/2023	(35,000,000)	17.77	621,775,000
2023050903410	S	USDMXN	05/11/2023	(10,000,000)	17.77	177,650,000
2023051003010	B	USDMXN	05/11/2023	604,206	17.66	(10,667,779)
2023051003090	B	USDMXN	05/11/2023	20,000,000	17.63	(352,504,000)
2023051003185	B	USDMXN	05/11/2023	36,000,000	17.62	(634,140,000)
2022100703380	B	USDMXN	05/12/2023	10,000,000	20.82	(208,160,000)
2023051003011	S	USDMXN	05/12/2023	(604,206)	17.66	10,669,727
2023051003029	S	USDMXN	05/12/2023	(10,000,000)	17.65	176,530,000
2023051003186	S	USDMXN	05/12/2023	(36,000,000)	17.62	634,260,600
2023051103010	B	USDMXN	05/12/2023	604,206	17.65	(10,663,088)
2023051203033	S	USDMXN	05/12/2023	(20,000,000)	17.60	352,000,000
2022081103273	S	USDMXN	05/15/2023	(30,000,000)	20.96	628,800,000
2023030903384	S	USDMXN	05/15/2023	(20,000,000)	18.26	365,200,000
2023041203008	B	USDMXN	05/15/2023	20,000,000	18.20	(364,070,000)
2023041203550	B	USDMXN	05/15/2023	30,000,000	18.21	(546,225,000)
2023051103469	B	USDMXN	05/15/2023	30,000,000	17.61	(528,240,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023051103583	B	USDMXN	05/15/2023	10,000,000	17.60	(175,950,000)
2023051103011	S	USDMXN	05/15/2023	(604,206)	17.66	10,669,062
2023051103304	S	USDMXN	05/15/2023	(30,000,000)	17.62	528,480,000
2023051203010	B	USDMXN	05/15/2023	604,206	17.59	(10,628,297)
2023051203034	B	USDMXN	05/15/2023	20,000,000	17.61	(352,186,000)
2023010503305	BO	USDMXN	05/16/2023	2,200,000	19.80	(43,570,182)
2023010503306	SO	USDMXN	05/16/2023	(2,200,000)	19.81	43,588,600
2023042103415	S	USDMXN	05/16/2023	(25,000,000)	18.07	451,825,000
2023051203011	S	USDMXN	05/16/2023	(604,206)	17.59	10,630,333
2023051203552	S	USDMXN	05/16/2023	(30,000,000)	17.59	527,700,000
2023051503161	B	USDMXN	05/16/2023	604,206	17.56	(10,609,855)
2022111503186	BON	USDMXN	05/17/2023	20,000,000	20.01	(400,225,000)
2022111503774	BON	USDMXN	05/17/2023	20,000,000	20.01	(400,226,000)
2022111503197	S	USDMXN	05/17/2023	(30,000,000)	19.99	599,790,000
2022111503208	S	USDMXN	05/17/2023	(30,000,000)	19.99	599,790,000
2022111503547	S	USDMXN	05/17/2023	(30,000,000)	20.01	600,240,000
2023051503154	BO	USDMXN	05/17/2023	0	17.58	(48,686,000)
2023051503155	B	USDMXN	05/17/2023	10,000,000	17.58	(175,770,000)
2023051503390	B	USDMXN	05/17/2023	40,000,000	17.53	(701,200,000)
2023051503608	B	USDMXN	05/17/2023	10,000,000	17.58	(175,770,000)
2023051503646	B	USDMXN	05/17/2023	20,000,000	17.44	(348,740,000)
2023051503153	SON	USDMXN	05/17/2023	(20,000,000)	20.01	400,226,000
2023051503162	S	USDMXN	05/17/2023	(604,206)	17.56	10,611,844
2023051603366	B	USDMXN	05/17/2023	604,206	17.51	(10,580,267)
2023051703205	S	USDMXN	05/17/2023	(1,000,000)	17.60	17,597,943
2023051703265	S	USDMXN	05/17/2023	(55,000,000)	17.56	965,800,000
2022081603267	B	USDMXN	05/18/2023	20,000,000	20.97	(419,413,600)
2022081603289	B	USDMXN	05/18/2023	20,000,000	20.97	(419,413,600)
2022110403343	S	USDMXN	05/18/2023	(5,000,000)	20.21	101,064,700
2022110403618	SO	USDMXN	05/18/2023	(5,000,000)	20.21	101,064,700
2023021303349	BON	USDMXN	05/18/2023	30,000,000	18.97	(568,953,000)
2023051603361	BO	USDMXN	05/18/2023	0	17.47	(44,868,000)
2023051603360	SON	USDMXN	05/18/2023	(30,000,000)	18.97	568,953,000
2023051603367	S	USDMXN	05/18/2023	(604,206)	17.51	10,582,299
2023051703266	B	USDMXN	05/18/2023	55,000,000	17.56	(965,989,750)
2023051703003	S	USDMXN	05/18/2023	(395,794)	17.66	6,989,839
2023051703019	S	USDMXN	05/18/2023	(13,000,000)	17.67	229,710,000
2022081703442	B	USDMXN	05/19/2023	20,000,000	21.13	(422,600,000)
2022081703447	B	USDMXN	05/19/2023	20,000,000	21.13	(422,600,000)
2023042603180	S	USDMXN	05/19/2023	(20,000,000)	18.19	363,750,000
2023042603508	S	USDMXN	05/19/2023	(30,000,000)	18.21	546,255,000
2023051703004	B	USDMXN	05/19/2023	395,794	17.66	(6,991,273)
2023051703020	B	USDMXN	05/19/2023	13,000,000	17.67	(229,755,500)
2023051703133	B	USDMXN	05/19/2023	30,000,000	17.63	(528,900,000)
2023051703206	B	USDMXN	05/19/2023	1,000,000	17.61	(17,605,200)
2023051703512	B	USDMXN	05/19/2023	15,000,000	17.56	(263,400,000)
2023051803005	S	USDMXN	05/19/2023	(28,000,000)	17.69	495,320,000
2023051803007	S	USDMXN	05/19/2023	(395,794)	17.67	6,992,668
2023051903340	B	USDMXN	05/19/2023	72,000,000	17.68	(1,272,960,000)
2023051903033	S	USDMXN	05/19/2023	(20,000,000)	17.70	353,960,000
2023051903046	S	USDMXN	05/19/2023	(20,000,000)	17.70	354,000,000
2023051903181	S	USDMXN	05/19/2023	(80,000,000)	17.68	1,414,400,000
2023051903360	S	USDMXN	05/19/2023	(72,000,000)	17.69	1,273,320,000
2023051903592	S	USDMXN	05/19/2023	(20,000,000)	17.70	353,960,000
2022121603081	B	USDMXN	05/22/2023	26,979,961	20.39	(550,000,000)
2022121603076	S	USDMXN	05/22/2023	(26,988,567)	20.38	550,000,000
2023021603012	S	USDMXN	05/22/2023	(30,000,000)	18.95	568,635,000
2023031603222	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	19.23	(384,580,000)
2023051803006	B	USDMXN	05/22/2023	28,000,000	17.70	(495,656,000)
2023051803008	B	USDMXN	05/22/2023	395,794	17.68	(6,998,516)
2023051803381	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	17.77	(355,400,000)
2023051803578	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	17.71	(354,100,000)
2023051803580	S	USDMXN	05/22/2023	(30,000,000)	17.71	531,180,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023051903034	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	17.71	(354,260,000)
2023051903047	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	17.72	(354,310,000)
2023051903182	B	USDMXN	05/22/2023	80,000,000	17.70	(1,415,680,000)
2023051903361	B	USDMXN	05/22/2023	72,000,000	17.70	(1,274,565,600)
2023051903593	B	USDMXN	05/22/2023	20,000,000	17.71	(354,260,000)
2023051903131	S	USDMXN	05/22/2023	(387,189)	17.72	6,861,817
2023051903207	S	USDMXN	05/22/2023	(28,000,000)	17.71	495,740,000
2023051903341	S	USDMXN	05/22/2023	(72,000,000)	17.70	1,274,205,600
2023052203166	S	USDMXN	05/22/2023	(33,000,000)	17.92	591,195,000
2023052203168	S	USDMXN	05/22/2023	(45,000,000)	17.91	805,950,000
2023051903132	B	USDMXN	05/23/2023	387,189	17.73	(6,863,699)
2023051903208	B	USDMXN	05/23/2023	28,000,000	17.71	(495,863,200)
2023051903218	B	USDMXN	05/23/2023	30,000,000	17.72	(531,600,000)
2023051903517	B	USDMXN	05/23/2023	15,000,000	17.76	(266,325,000)
2023052203167	B	USDMXN	05/23/2023	33,000,000	17.92	(591,369,900)
2023052203169	B	USDMXN	05/23/2023	45,000,000	17.92	(806,188,500)
2023052203003	S	USDMXN	05/23/2023	(387,189)	17.91	6,932,904
2023052203364	S	USDMXN	05/23/2023	(73,000,000)	17.89	1,305,605,000
2023052203526	S	USDMXN	05/23/2023	(1,000,000)	17.90	17,898,371
2023052303157	S	USDMXN	05/23/2023	(120,000,000)	17.95	2,154,000,000
2023042003252	B	USDMXN	05/24/2023	30,000,000	18.14	(544,320,000)
2023042003570	B	USDMXN	05/24/2023	20,000,000	18.16	(363,100,000)
2023051503391	S	USDMXN	05/24/2023	(40,000,000)	17.56	702,212,000
2023052203004	B	USDMXN	05/24/2023	387,189	17.91	(6,935,329)
2023052203320	B	USDMXN	05/24/2023	67,200,000	17.89	(1,202,140,800)
2023052203365	B	USDMXN	05/24/2023	73,000,000	17.89	(1,306,057,600)
2023052203527	B	USDMXN	05/24/2023	1,000,000	17.90	(17,904,700)
2023052203674	B	USDMXN	05/24/2023	67,200,000	17.89	(1,202,140,800)
2023052203217	S	USDMXN	05/24/2023	(20,000,000)	17.85	357,000,000
2023052203260	S	USDMXN	05/24/2023	(20,000,000)	17.84	356,840,000
2023052203263	S	USDMXN	05/24/2023	(67,200,000)	17.85	1,199,452,800
2023052203383	S	USDMXN	05/24/2023	(50,000,000)	17.88	894,000,000
2023052203460	S	USDMXN	05/24/2023	(50,000,000)	17.89	894,650,000
2023052203671	S	USDMXN	05/24/2023	(67,200,000)	17.85	1,199,452,800
2023052203676	S	USDMXN	05/24/2023	(50,000,000)	17.89	894,650,000
2023052303158	B	USDMXN	05/24/2023	120,000,000	17.96	(2,154,768,000)
2023052303219	S	USDMXN	05/24/2023	(63,000,000)	17.95	1,130,850,000
2023052303223	S	USDMXN	05/24/2023	(387,189)	17.97	6,958,599
2023052303566	S	USDMXN	05/24/2023	(63,000,000)	17.97	1,131,795,000
2023052403113	S	USDMXN	05/24/2023	(52,000,000)	17.83	926,900,000
2022082303207	S	USDMXN	05/25/2023	(10,000,000)	21.09	210,925,000
2022110403346	S	USDMXN	05/25/2023	(5,000,000)	20.24	101,214,700
2022110403619	SO	USDMXN	05/25/2023	(5,000,000)	20.24	101,214,700
2023052203264	B	USDMXN	05/25/2023	67,200,000	17.85	(1,199,835,840)
2023052203672	B	USDMXN	05/25/2023	67,200,000	17.85	(1,199,835,840)
2023052203321	S	USDMXN	05/25/2023	(67,200,000)	17.90	1,202,544,000
2023052203675	S	USDMXN	05/25/2023	(67,200,000)	17.90	1,202,544,000
2023052303220	B	USDMXN	05/25/2023	63,000,000	17.96	(1,131,259,500)
2023052303224	B	USDMXN	05/25/2023	387,189	17.98	(6,961,271)
2023052303567	B	USDMXN	05/25/2023	63,000,000	17.97	(1,132,204,500)
2023052303228	S	USDMXN	05/25/2023	(30,000,000)	17.97	539,175,000
2023052303234	S	USDMXN	05/25/2023	(30,000,000)	17.97	539,175,000
2023052303446	S	USDMXN	05/25/2023	(20,000,000)	17.95	359,000,000
2023052403003	B	USDMXN	05/25/2023	1,612,811	17.78	(28,678,393)
2023052403114	B	USDMXN	05/25/2023	52,000,000	17.83	(927,201,600)
2023052403252	B	USDMXN	05/25/2023	40,889,133	17.84	(729,462,139)
2023052403348	B	USDMXN	05/25/2023	68,876	17.84	(1,228,710)
2023052403344	S	USDMXN	05/25/2023	(40,958,009)	17.81	729,462,139
2023052503151	S	USDMXN	05/25/2023	(39,900,000)	17.83	711,456,900
2023052503515	S	USDMXN	05/25/2023	(5,600,000)	17.86	99,988,000
2023052403082	B	USDMXN	05/26/2023	10,000,000	17.82	(178,150,000)
2023052403115	B	USDMXN	05/26/2023	30,000,000	17.82	(534,450,000)
2023052403243	B	USDMXN	05/26/2023	5,000,000	17.81	(89,050,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023052403345	B	USDMXN	05/26/2023	40,945,364	17.82	(729,462,139)
2023052403546	B	USDMXN	05/26/2023	30,000,000	17.81	(534,210,000)
2023052403004	S	USDMXN	05/26/2023	(1,612,811)	17.79	28,686,102
2023052403253	S	USDMXN	05/26/2023	(40,875,844)	17.85	729,462,139
2023052403349	S	USDMXN	05/26/2023	(68,876)	17.84	1,229,071
2023052503152	B	USDMXN	05/26/2023	39,900,000	17.83	(711,612,510)
2023052503134	S	USDMXN	05/26/2023	(43,000,000)	17.86	767,765,000
2023052503137	S	USDMXN	05/26/2023	(30,000,000)	17.86	535,800,000
2023052503157	S	USDMXN	05/26/2023	(387,834)	17.83	6,914,126
2023052603227	B	USDMXN	05/26/2023	3,332,536	17.68	(58,919,235)
2023052603230	B	USDMXN	05/26/2023	3,332,536	17.68	(58,919,235)
2023052603216	S	USDMXN	05/26/2023	(45,000,000)	17.68	795,600,000
2023052603308	S	USDMXN	05/26/2023	(6,000,000)	17.66	105,942,000
2023052603313	S	USDMXN	05/26/2023	(665,072)	17.63	11,726,913
2022110103506	B	USDMXN	05/30/2023	24,000,000	20.46	(491,025,600)
2022110403366	B	USDMXN	05/30/2023	20,000,000	20.22	(404,330,000)
2022110403372	S	USDMXN	05/30/2023	(20,000,000)	20.29	405,885,200
2023022403311	BON	USDMXN	05/30/2023	40,000,000	18.76	(750,460,000)
2023032703327	S	USDMXN	05/30/2023	(20,000,000)	18.59	371,860,000
2023042503130	BON	USDMXN	05/30/2023	40,000,000	18.20	(728,148,000)
2023051803382	S	USDMXN	05/30/2023	(20,000,000)	17.80	356,016,000
2023052503135	B	USDMXN	05/30/2023	43,000,000	17.87	(768,582,000)
2023052503138	B	USDMXN	05/30/2023	30,000,000	17.88	(536,370,000)
2023052503158	B	USDMXN	05/30/2023	387,834	17.85	(6,922,288)
2023052503165	BO	USDMXN	05/30/2023	0	17.82	(37,570,000)
2023052503167	BO	USDMXN	05/30/2023	0	17.82	(15,258,000)
2023052503516	B	USDMXN	05/30/2023	5,600,000	17.88	(100,105,600)
2023052503164	SON	USDMXN	05/30/2023	(40,000,000)	18.76	750,460,000
2023052503166	SON	USDMXN	05/30/2023	(40,000,000)	18.20	728,148,000
2023052503175	S	USDMXN	05/30/2023	(30,000,000)	17.83	534,840,000
2023052503179	S	USDMXN	05/30/2023	(30,000,000)	17.85	535,350,000
2023052503346	S	USDMXN	05/30/2023	(20,000,000)	17.81	356,180,000
2023052603217	B	USDMXN	05/30/2023	45,000,000	17.70	(796,306,500)
2023052603197	S	USDMXN	05/30/2023	(387,834)	17.67	6,853,799
2023052603414	S	USDMXN	05/30/2023	(57,000,000)	17.67	1,006,905,000
2023052603581	S	USDMXN	05/30/2023	(57,000,000)	17.67	1,006,905,000
2023053003267	S	USDMXN	05/30/2023	(50,000,000)	17.61	880,500,000
2023053003270	S	USDMXN	05/30/2023	(30,000,000)	17.59	527,700,000
2023053003276	S	USDMXN	05/30/2023	(11,347,518)	17.63	200,000,000
2023053003343	S	USDMXN	05/30/2023	(18,000,000)	17.66	317,880,000
2023053003351	S	USDMXN	05/30/2023	(652,482)	17.65	11,514,607
2023022403122	S	USDMXN	05/31/2023	(50,000,000)	18.74	937,150,000
2023052203384	B	USDMXN	05/31/2023	50,000,000	17.91	(895,290,000)
2023052603198	B	USDMXN	05/31/2023	387,834	17.68	(6,855,464)
2023052603309	B	USDMXN	05/31/2023	6,000,000	17.68	(106,062,000)
2023052603314	B	USDMXN	05/31/2023	665,072	17.66	(11,746,233)
2023052603324	B	USDMXN	05/31/2023	30,000,000	17.69	(530,700,000)
2023052603328	B	USDMXN	05/31/2023	10,000,000	17.69	(176,900,000)
2023052603335	B	USDMXN	05/31/2023	30,000,000	17.67	(529,950,000)
2023052603415	B	USDMXN	05/31/2023	57,000,000	17.67	(1,007,155,800)
2023052603582	B	USDMXN	05/31/2023	57,000,000	17.67	(1,007,155,800)
2023052603228	S	USDMXN	05/31/2023	(3,328,733)	17.70	58,919,235
2023053003000	B	USDMXN	05/31/2023	275,827	17.55	(4,841,988)
2023053003235	B	USDMXN	05/31/2023	7,000,000	17.60	(123,200,000)
2023053003268	B	USDMXN	05/31/2023	50,000,000	17.61	(880,690,000)
2023053003271	B	USDMXN	05/31/2023	30,000,000	17.59	(527,814,000)
2023053003277	B	USDMXN	05/31/2023	11,345,200	17.63	(200,000,000)
2023053003344	B	USDMXN	05/31/2023	18,000,000	17.66	(317,946,600)
2023053003352	B	USDMXN	05/31/2023	652,482	17.65	(11,517,717)
2023053003415	B	USDMXN	05/31/2023	2,317	17.65	(40,905)
2023053103342	S	USDMXN	05/31/2023	(24,453,000)	17.75	433,991,844
2023053103347	S	USDMXN	05/31/2023	(4,547,000)	17.76	80,754,720
2022110403362	S	USDMXN	06/01/2023	(5,000,000)	20.27	101,349,700

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022110403621	SO	USDMXN	06/01/2023	(5,000,000)	20.27	101,349,700
2023013003227	S	USDMXN	06/01/2023	(10,000,000)	19.19	191,925,000
2023013003264	S	USDMXN	06/01/2023	(10,000,000)	19.19	191,900,000
2023032203311	B	USDMXN	06/01/2023	91,395.751	18.79	(1,717,636,906)
2023032203387	SO	USDMXN	06/01/2023	(91,552,614)	18.76	1,717,636,906
2023032203608	SO	USDMXN	06/01/2023	(91,552,614)	18.76	1,717,636,906
2023042703118	BON	USDMXN	06/01/2023	40,000,000	18.19	(727,408,000)
2023053003249	BO	USDMXN	06/01/2023	0	17.66	(20,858,000)
2023053003258	B	USDMXN	06/01/2023	30,000,000	17.66	(529,912,500)
2023053003001	S	USDMXN	06/01/2023	(275,827)	17.56	4,843,057
2023053003236	S	USDMXN	06/01/2023	(7,000,000)	17.60	123,228,000
2023053003248	SON	USDMXN	06/01/2023	(40,000,000)	18.19	727,408,000
2023053003416	S	USDMXN	06/01/2023	(2,317)	17.66	40,914
2023053103343	B	USDMXN	06/01/2023	24,453,000	17.75	(434,119,000)
2023053103348	B	USDMXN	06/01/2023	4,547,000	17.77	(80,779,729)
2023053103004	S	USDMXN	06/01/2023	(17,000,000)	17.68	300,475,000
2023053103041	S	USDMXN	06/01/2023	(564,992)	17.65	9,970,149
2023060103129	S	USDMXN	06/01/2023	(49,000,000)	17.56	860,195,000
2023022803165	B	USDMXN	06/02/2023	20,000,000	18.64	(372,730,000)
2023032203319	B	USDMXN	06/02/2023	94,956,542	18.80	(1,785,467,857)
2023032203364	S	USDMXN	06/02/2023	(95,042,471)	18.79	1,785,467,857
2023042703555	S	USDMXN	06/02/2023	(20,000,000)	18.16	363,150,000
2023052403116	S	USDMXN	06/02/2023	(30,000,000)	17.85	535,515,000
2023053103005	B	USDMXN	06/02/2023	17,000,000	17.68	(300,546,400)
2023053103042	B	USDMXN	06/02/2023	564,992	17.65	(9,972,620)
2023053103474	B	USDMXN	06/02/2023	30,000,000	17.67	(530,100,000)
2023053103683	B	USDMXN	06/02/2023	10,000,000	17.69	(176,880,000)
2023053103009	S	USDMXN	06/02/2023	(30,000,000)	17.64	529,260,000
2023060103046	B	USDMXN	06/02/2023	520,937	17.57	(9,152,000)
2023060103130	B	USDMXN	06/02/2023	49,000,000	17.56	(860,346,900)
2023042803061	S	USDMXN	06/05/2023	(10,000,000)	18.10	180,985,000
2023050303325	B	USDMXN	06/05/2023	20,000,000	18.01	(360,250,000)
2023060103471	B	USDMXN	06/05/2023	30,000,000	17.56	(526,830,000)
2023060103586	B	USDMXN	06/05/2023	20,000,000	17.57	(351,360,000)
2023060103047	S	USDMXN	06/05/2023	(520,937)	17.58	9,157,495
2023060103181	S	USDMXN	06/05/2023	(35,000,000)	17.56	614,425,000
2023060103582	S	USDMXN	06/05/2023	(10,000,000)	17.56	175,600,000
2023060203009	B	USDMXN	06/05/2023	27,086,902	17.47	(473,072,739)
2023060203111	S	USDMXN	06/05/2023	(565,965)	17.48	9,891,115
2023060203290	S	USDMXN	06/05/2023	(14,000,000)	17.50	244,930,000
2022120203534	S	USDMXN	06/06/2023	(7,474,586)	20.07	150,000,000
2023052503176	B	USDMXN	06/06/2023	30,000,000	17.86	(535,755,000)
2023060203095	B	USDMXN	06/06/2023	20,000,000	17.46	(349,140,000)
2023060203112	B	USDMXN	06/06/2023	565,965	17.48	(9,893,238)
2023060203291	B	USDMXN	06/06/2023	14,000,000	17.50	(244,979,700)
2023060203010	S	USDMXN	06/06/2023	(27,081,475)	17.47	473,072,739
2023060503214	B	USDMXN	06/06/2023	990,096	17.47	(17,297,695)
2023060503501	S	USDMXN	06/06/2023	(500,000)	17.46	8,728,685
2023050403086	BON	USDMXN	06/07/2023	30,000,000	18.10	(542,880,000)
2023060503199	BO	USDMXN	06/07/2023	0	17.47	(18,690,000)
2023060503207	B	USDMXN	06/07/2023	80,000,000	17.51	(1,400,480,000)
2023060503209	B	USDMXN	06/07/2023	80,000,000	17.50	(1,399,800,000)
2023060503483	B	USDMXN	06/07/2023	30,000,000	17.47	(523,950,000)
2023060503502	B	USDMXN	06/07/2023	500,000	17.46	(8,730,500)
2023060503198	SON	USDMXN	06/07/2023	(30,000,000)	18.10	542,880,000
2023060503215	S	USDMXN	06/07/2023	(990,096)	17.47	17,300,938
2023060603241	B	USDMXN	06/07/2023	80,000,000	17.51	(1,400,480,000)
2023060603102	S	USDMXN	06/07/2023	(10,000,000)	17.48	174,800,000
2023060603104	S	USDMXN	06/07/2023	(9,904)	17.44	172,722
2023060703352	B	USDMXN	06/07/2023	30,000,000	17.36	(520,920,000)
2023060703108	S	USDMXN	06/07/2023	(44,000,000)	17.33	762,564,000
2023050403294	S	USDMXN	06/08/2023	(30,000,000)	18.06	541,845,000
2023050403296	S	USDMXN	06/08/2023	(30,000,000)	18.06	541,845,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050503368	BON	USDMXN	06/08/2023	40,000,000	17.93	(717,108,000)
2023052603231	S	USDMXN	06/08/2023	(3,322,950)	17.73	58,919,235
2023060603103	B	USDMXN	06/08/2023	10,000,000	17.48	(174,833,500)
2023060603105	B	USDMXN	06/08/2023	9,904	17.44	(172,756)
2023060603106	B	USDMXN	06/08/2023	25,000,000	17.46	(436,500,000)
2023060603153	BO	USDMXN	06/08/2023	0	17.44	(19,408,000)
2023060603265	B	USDMXN	06/08/2023	30,000,000	17.42	(522,450,000)
2023060603576	B	USDMXN	06/08/2023	20,000,000	17.40	(347,980,000)
2023060603152	SON	USDMXN	06/08/2023	(40,000,000)	17.93	717,108,000
2023060703109	B	USDMXN	06/08/2023	44,000,000	17.33	(762,691,600)
2023060703104	S	USDMXN	06/08/2023	(686,953)	17.37	11,933,639
2023060703106	S	USDMXN	06/08/2023	(16,000,000)	17.33	277,328,000
2023060703353	S	USDMXN	06/08/2023	(30,000,000)	17.37	521,004,000
2023060803114	S	USDMXN	06/08/2023	(27,500,000)	17.41	478,775,000
2023060803332	S	USDMXN	06/08/2023	(4,500,000)	17.38	78,230,250
2023010503407	B	USDMXN	06/09/2023	3,000,000	19.86	(59,593,500)
2023050503370	S	USDMXN	06/09/2023	(40,000,000)	17.89	715,616,000
2023060703105	B	USDMXN	06/09/2023	686,953	17.38	(11,935,817)
2023060703107	B	USDMXN	06/09/2023	16,000,000	17.34	(277,376,800)
2023060703447	S	USDMXN	06/09/2023	(10,000,000)	17.36	173,570,000
2023060703497	S	USDMXN	06/09/2023	(10,000,000)	17.35	173,485,000
2023060803036	B	USDMXN	06/09/2023	313,047	17.38	(5,441,187)
2023060803115	B	USDMXN	06/09/2023	27,500,000	17.41	(478,856,125)
2023041003275	S	USDMXN	06/12/2023	(30,000,000)	18.38	551,445,000
2023060803333	B	USDMXN	06/12/2023	4,500,000	17.40	(78,285,600)
2023060803588	B	USDMXN	06/12/2023	10,000,000	17.38	(173,840,000)
2023060803037	S	USDMXN	06/12/2023	(313,047)	17.39	5,443,941
2023060903000	B	USDMXN	06/12/2023	313,047	17.31	(5,418,530)
2023041003267	BON	USDMXN	06/13/2023	35,000,000	18.43	(645,197,000)
2023060903102	B	USDMXN	06/13/2023	25,000,000	17.31	(432,700,000)
2023060903126	B	USDMXN	06/13/2023	15,713	17.32	(272,184)
2023060903425	B	USDMXN	06/13/2023	35,000,000	17.26	(604,212,000)
2023060903474	BO	USDMXN	06/13/2023	0	17.33	(38,664,500)
2023060903001	S	USDMXN	06/13/2023	(313,047)	17.31	5,419,461
2023060903473	SON	USDMXN	06/13/2023	(35,000,000)	18.43	645,197,000
2023060903523	S	USDMXN	06/13/2023	(15,713)	17.27	271,380
2023061203059	B	USDMXN	06/13/2023	313,047	17.29	(5,412,626)
2023041203583	B	USDMXN	06/14/2023	20,000,000	18.31	(366,200,000)
2023060903524	B	USDMXN	06/14/2023	15,713	17.27	(271,432)
2023060903127	S	USDMXN	06/14/2023	(15,713)	17.33	272,232
2023061203060	S	USDMXN	06/14/2023	(313,047)	17.29	5,413,545
2023061403115	S	USDMXN	06/14/2023	(78,000,000)	17.12	1,335,360,000
2023031303252	BON	USDMXN	06/15/2023	35,000,000	19.10	(668,552,500)
2023031303145	S	USDMXN	06/15/2023	(30,000,000)	19.16	574,845,000
2023031303239	S	USDMXN	06/15/2023	(10,000,000)	19.10	191,015,000
2023051103305	B	USDMXN	06/15/2023	30,000,000	17.73	(531,780,000)
2023051103584	S	USDMXN	06/15/2023	(10,000,000)	17.71	177,055,000
2023061303268	BO	USDMXN	06/15/2023	0	17.24	(65,117,500)
2023061303267	SON	USDMXN	06/15/2023	(35,000,000)	19.10	668,552,500
2023061403116	B	USDMXN	06/15/2023	78,000,000	17.12	(1,335,595,560)
2023041703097	S	USDMXN	06/20/2023	(35,000,000)	18.36	642,495,000
2023051503647	S	USDMXN	06/20/2023	(20,000,000)	17.56	351,170,000
2023051703593	B	USDMXN	06/20/2023	20,000,000	17.68	(353,556,000)
2023051703134	S	USDMXN	06/20/2023	(30,000,000)	17.75	532,440,000
2023052503347	B	USDMXN	06/20/2023	20,000,000	17.89	(357,820,000)
2022101903475	S	USDMXN	06/21/2023	(80,000,000)	21.06	1,684,920,000
2022101903477	S	USDMXN	06/21/2023	(77,000,000)	21.06	1,621,735,500
2022102103604	BO	USDMXN	06/21/2023	50,000,000	20.88	(1,044,150,000)
2022102403490	B	USDMXN	06/21/2023	100,000,000	20.84	(2,083,850,000)
2022112903181	B	USDMXN	06/21/2023	37,716,872	19.89	(750,000,000)
2022112903198	S	USDMXN	06/21/2023	(20,000,000)	19.88	397,622,298
2022112903201	S	USDMXN	06/21/2023	(18,000,000)	19.88	357,924,496
2022112903437	S	USDMXN	06/21/2023	(20,000,000)	19.87	397,383,890



External_Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022112903439	S	USDMXN	06/21/2023	(18,000,000)	19.87	357,739,281
2023011103098	B	USDMXN	06/21/2023	35,000,000	19.65	(687,750,000)
2023011103102	S	USDMXN	06/21/2023	(10,000,000)	19.64	196,400,000
2023011103109	SO	USDMXN	06/21/2023	(20,000,000)	19.65	393,000,000
2023031603452	B	USDMXN	06/21/2023	10,000,000	19.20	(192,015,000)
2023041003505	BO	USDMXN	06/21/2023	35,000,000	18.41	(644,385,000)
2023041703152	BON	USDMXN	06/21/2023	35,000,000	18.38	(643,377,000)
2023061603275	BO	USDMXN	06/21/2023	0	17.14	(43,617,000)
2023061603274	SON	USDMXN	06/21/2023	(35,000,000)	18.38	643,377,000
2023031703114	S	USDMXN	06/22/2023	(20,000,000)	19.26	385,270,000
2023051803579	S	USDMXN	06/22/2023	(20,000,000)	17.82	356,440,000
2023062203119	B	USDMXN	06/22/2023	10,000	17.17	(171,676)
2023062203106	S	USDMXN	06/22/2023	(7,290,000)	17.15	125,045,370
2023062203113	S	USDMXN	06/22/2023	(35,220,000)	17.14	603,706,020
2023032103136	B	USDMXN	06/23/2023	20,000,000	19.03	(380,620,000)
2023062203026	B	USDMXN	06/23/2023	937,424	17.15	(16,073,007)
2023062203107	B	USDMXN	06/23/2023	7,290,000	17.16	(125,066,876)
2023062203114	B	USDMXN	06/23/2023	35,220,000	17.14	(603,809,919)
2023062203406	B	USDMXN	06/23/2023	11,989,806	17.18	(205,984,869)
2023062203120	S	USDMXN	06/23/2023	(10,000)	17.17	171,702
2023062203414	S	USDMXN	06/23/2023	(11,986,318)	17.19	205,984,869
2023062203417	S	USDMXN	06/23/2023	(3,488)	17.17	59,895
2023062203611	S	USDMXN	06/23/2023	(11,986,318)	17.19	205,984,869
2023062303444	S	USDMXN	06/23/2023	(30,000,000)	17.21	516,390,000
2023052203218	B	USDMXN	06/26/2023	20,000,000	17.99	(359,780,000)
2023052203261	B	USDMXN	06/26/2023	20,000,000	17.98	(359,620,000)
2023052403083	S	USDMXN	06/26/2023	(10,000,000)	17.94	179,410,000
2023052403547	S	USDMXN	06/26/2023	(30,000,000)	17.94	538,071,000
2023062203415	B	USDMXN	06/26/2023	11,979,626	17.19	(205,984,869)
2023062203418	B	USDMXN	06/26/2023	3,488	17.18	(59,930)
2023062203612	B	USDMXN	06/26/2023	11,979,626	17.19	(205,984,869)
2023062203027	S	USDMXN	06/26/2023	(937,424)	17.16	16,081,596
2023062203407	S	USDMXN	06/26/2023	(11,983,110)	17.19	205,984,869
2023062303000	B	USDMXN	06/26/2023	937,420	17.21	(16,128,705)
2023062303445	B	USDMXN	06/26/2023	30,000,000	17.22	(516,660,000)
2023062603319	B	USDMXN	06/26/2023	19,128,631	17.13	(327,616,069)
2023062603067	S	USDMXN	06/26/2023	(50,000,000)	17.14	857,225,000
2023062603344	B	MXNUSD	06/26/2023	180,000,000	17.14	(10,504,815)
2023062603378	S	USDMXN	06/26/2023	(8,617,400)	17.13	147,616,069
2023062603419	S	USDMXN	06/26/2023	(10,504,815)	17.14	180,000,000
2023022303632	B	USDMXN	06/27/2023	10,000,000	18.80	(188,015,000)
2023042503040	S	USDMXN	06/27/2023	(20,000,000)	18.26	365,240,000
2023062303001	S	USDMXN	06/27/2023	(937,420)	17.21	16,131,588
2023062603005	B	USDMXN	06/27/2023	937,420	17.15	(16,076,819)
2023062603068	B	USDMXN	06/27/2023	50,000,000	17.15	(857,380,000)
2023062603345	S	MXNUSD	06/27/2023	(180,000,000)	17.14	10,502,976
2023062603379	B	USDMXN	06/27/2023	8,615,866	17.13	(147,616,069)
2023062603420	B	USDMXN	06/27/2023	10,502,976	17.14	(180,000,000)
2023062603320	S	USDMXN	06/27/2023	(19,125,170)	17.13	327,616,069
2023062703036	S	USDMXN	06/27/2023	(42,600,000)	17.07	726,969,000
2023052603316	BON	USDMXN	06/28/2023	40,000,000	17.77	(710,648,000)
2023062603148	BO	USDMXN	06/28/2023	0	17.15	(24,488,000)
2023062603149	B	USDMXN	06/28/2023	35,000,000	17.15	(600,390,000)
2023062603006	S	USDMXN	06/28/2023	(937,420)	17.15	16,079,561
2023062603147	SON	USDMXN	06/28/2023	(40,000,000)	17.77	710,648,000
2023062603280	S	USDMXN	06/28/2023	(30,000,000)	17.12	513,600,000
2023062703002	B	USDMXN	06/28/2023	18,179,316	17.07	(310,375,469)
2023062703037	B	USDMXN	06/28/2023	42,600,000	17.07	(727,098,930)
2023062703063	B	USDMXN	06/28/2023	758,103	17.05	(12,928,751)
2023062803031	S	USDMXN	06/28/2023	(27,800,000)	17.08	474,907,400
2023062803247	S	USDMXN	06/28/2023	(27,800,000)	17.08	474,907,400
2023042803258	BON	USDMXN	06/29/2023	40,000,000	18.25	(729,960,000)
2023062703174	B	USDMXN	06/29/2023	35,000,000	17.08	(597,940,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023062703181	BO	USDMXN	06/29/2023	0	17.08	(46,600.000)
2023062703003	S	USDMXN	06/29/2023	(18,176.016)	17.08	310,375,469
2023062703064	S	USDMXN	06/29/2023	(758.103)	17.06	12,931,045
2023062703180	SON	USDMXN	06/29/2023	(40,000.000)	18.25	729,960.000
2023062803032	B	USDMXN	06/29/2023	27,800.000	17.09	(474,992.190)
2023062803145	B	USDMXN	06/29/2023	934.119	17.09	(15,963.369)
2023062803248	B	USDMXN	06/29/2023	27,800.000	17.09	(474,992.190)
2023062803157	S	USDMXN	06/29/2023	(25,000.000)	17.10	427,500.000
2023062903088	S	USDMXN	06/29/2023	(26,300.000)	17.10	449,651.100
2023062903095	S	USDMXN	06/29/2023	(44,200.000)	17.13	757,101.800
2023032903556	B	USDMXN	06/30/2023	30,000.000	18.43	(552,870.000)
2023052503180	B	USDMXN	06/30/2023	30,000.000	17.97	(538,995.000)
2023052603325	S	USDMXN	06/30/2023	(30,000.000)	17.80	534,090.000
2023052603329	S	USDMXN	06/30/2023	(10,000.000)	17.80	178,030.000
2023052603336	S	USDMXN	06/30/2023	(30,000.000)	17.78	533,355.000
2023062803158	B	USDMXN	06/30/2023	25,000.000	17.10	(427,577.500)
2023062803560	B	USDMXN	06/30/2023	35,000.000	17.07	(597,520.000)
2023062803563	B	USDMXN	06/30/2023	20,000.000	17.07	(341,400.000)
2023062803146	S	USDMXN	06/30/2023	(934.119)	17.09	15,966.157
2023062803574	S	USDMXN	06/30/2023	(20,000.000)	17.08	341,500.000
2023062903089	B	USDMXN	06/30/2023	26,300.000	17.10	(449,730.000)
2023062903096	B	USDMXN	06/30/2023	44,200.000	17.13	(757,234.400)
2023062903017	S	USDMXN	06/30/2023	(65.881)	17.09	1,125.793
2023062903056	S	USDMXN	06/30/2023	(40,000.000)	17.13	685,000.000
2023063003604	S	USDMXN	06/30/2023	(3,000.000)	17.12	51,360.000
2023063003609	S	USDMXN	06/30/2023	(3,000.000)	17.12	51,360.000

## Liquidados anticipadamente

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
C77391	22/05/2026	Unwound		mxn/usd	220,500,000	10,824,742		418307
C77597	22/05/2026	Unwound		usd/mxn	10,824,742	220,500,000		418307
E82367	08/05/2023	Unwound	729,930,000	mxn			729,930,000	418196
E82368	08/05/2023	Unwound	729,930,000	mxn			729,930,000	418196
E82369	08/05/2023	Unwound	729,930,000	mxn			729,930,000	26492
E82370	08/05/2023	Unwound	729,930,000	mxn			729,930,000	26492
E83631	23/06/2023	Unwound	40,720,000	mxn			40,720,000	418196
E83632	23/06/2023	Unwound	40,720,000	mxn			40,720,000	418196
E83636	24/04/2024	Unwound	486,650,000	mxn			486,650,000	418196
E85323	05/06/2023	Unwound	40,235,000	mxn			40,235,000	418196
E85324	05/06/2023	Unwound	40,235,000	mxn			40,235,000	418196
E85325	05/06/2023	Unwound	40,235,000	mxn			40,235,000	26492
E85326	05/06/2023	Unwound	40,235,000	mxn			40,235,000	26492
E85331	24/04/2024	Unwound	485,460,000	mxn			485,460,000	418196
E85332	24/04/2024	Unwound	485,460,000	mxn			485,460,000	26492
E85333	24/04/2024	Unwound	485,460,000	mxn			485,460,000	26492
M00070506	22/11/2024	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000			484237
MNF338	16/04/2025	Unwound	93,677,757	mxn		93,677,757		484237
MNF354	11/08/2023	Unwound	450,000,000	mxn		450,000,000		484237
MNF449	20/07/2023	Unwound	70,000,000	mxn		70,000,000		484237
MU0605	20/10/2025	Unwound	30,000,000	usd		30,000,000		484237
P17065	30/04/2024	Unwound	35,000,000	mxn			35,000,000	417998
P17066	30/04/2024	Unwound	35,000,000	mxn			35,000,000	417998
P17100	30/10/2024	Unwound	5,000,000	mxn			5,000,000	417998
P17101	30/10/2024	Unwound	5,000,000	mxn			5,000,000	417998
P17102	30/10/2024	Unwound	5,000,000	mxn			5,000,000	417998
P17103	30/10/2024	Unwound	5,000,000	mxn			5,000,000	417998
P17212	29/08/2023	Unwound	19,000,000	mxn			19,000,000	417998
P17213	29/08/2023	Unwound	19,000,000	mxn			19,000,000	26492
P17215	29/08/2023	Unwound	14,702,381	mxn			14,702,381	417998
P17502	16/04/2025	Unwound	88,993,869	mxn			88,993,869	417998
P17503	16/04/2025	Unwound	88,993,869	mxn			88,993,869	417998
P17504	16/04/2025	Unwound	88,993,869	mxn			88,993,869	26492
P17505	16/04/2025	Unwound	88,993,869	mxn			88,993,869	26492
P18773	15/03/2025	Unwound	50,000,000	mxn			50,000,000	417998
P18874	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd			54,000,000	417998
P18875	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd			54,000,000	417998
SDR995	27/09/2029	Unwound	10,948,847	usd	10,948,847	10,948,847		418307
SDR996	27/09/2029	Unwound	10,948,847	usd	10,948,847	10,948,847		418307
SDS173	30/08/2024	Unwound	9,000,000	mxn	9,000,000	9,000,000		418307
SDS328	30/03/2024	Unwound	7,300,000	mxn	7,300,000	7,300,000		406503
SDS340	30/03/2024	Unwound	7,300,000	mxn	7,300,000	7,300,000		26492
SDS495	20/07/2023	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000		406503
SDS505	20/07/2023	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000		484237
SDS577	30/09/2029	Unwound	179,000,000	mxn	179,000,000	179,000,000		418307
SDS799	11/09/2023	Unwound	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000		406503
SDS813	11/09/2023	Unwound	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000		406503

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional	Booking Point
SDS814	11/09/2023	Unwound	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000		406503
SDS862	11/09/2023	Unwound	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000		26492
SDS868	11/09/2023	Unwound	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000		26492
SDS870	11/09/2023	Unwound	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000		26492
SDT139	27/09/2029	Unwound	31,801,139	usd	31,801,139	31,801,139		418307
SDT314	30/04/2024	Unwound	35,000,000	mxn	35,000,000	35,000,000		418307
SDT439	07/06/2024	Unwound	55,000,000	mxn	55,000,000	55,000,000		406503
SDT446	07/06/2024	Unwound	55,000,000	mxn	55,000,000	55,000,000		26492
SDT969	16/04/2025	Unwound	93,677,757	mxn	93,677,757	93,677,757		406503
SDT970	16/04/2025	Unwound	93,677,757	mxn	93,677,757	93,677,757		406503
SDU006	16/04/2025	Unwound	93,677,757	mxn	93,677,757	93,677,757		484237
SDU266	22/09/2025	Unwound	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000		418307
SDU274	22/09/2025	Unwound	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000		418307
SDU278	22/09/2025	Unwound	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000		418307
SDU294	22/09/2025	Unwound	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000		418307
SDV768	11/08/2023	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000		406503
SDV788	11/08/2023	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000		484237
SDV806	11/08/2023	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000		406503
SDW793	20/07/2023	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000		406503
SDX946	26/02/2026	Unwound	7,178,861	usd	7,178,861	7,178,861		418307
SDY007	30/06/2026	Unwound	5,792,812	usd	5,792,812	5,792,812		418307
SDY012	30/06/2026	Unwound	5,792,812	usd	5,792,812	5,792,812		418307
SEB022	22/06/2031	Unwound	5,650,000	usd	5,650,000	5,650,000		418307
SEB028	22/06/2031	Unwound	5,650,000	usd	5,650,000	5,650,000		418307
SEE306	16/06/2026	Unwound	75,000,000	usd	75,000,000	75,000,000		418307
SFR888	30/06/2028	Unwound	2,197,142	usd	2,197,142	2,197,142		418307
SFR889	30/06/2028	Unwound	2,197,142	usd	2,197,142	2,197,142		418307
SGO560	30/06/2025	Unwound	425,000	usd	425,000	425,000		418307
SGO561	30/06/2025	Unwound	425,000	usd	425,000	425,000		418307
SGO562	30/06/2025	Unwound	400,000	usd	400,000	400,000		418307
SGO565	30/06/2025	Unwound	400,000	usd	400,000	400,000		418307
SGO567	26/02/2026	Unwound	7,178,861	usd	7,178,861	7,178,861		418307
SHH638	20/10/2025	Unwound	30,000,000	usd	30,000,000	30,000,000		406503
SHH639	20/10/2025	Unwound	30,000,000	usd	30,000,000	30,000,000		406503
SHH641	20/10/2025	Unwound	30,000,000	usd	30,000,000	30,000,000		484237
SIF106	15/03/2025	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000		418307
SIN702	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd	54,000,000	54,000,000		418307
SIN703	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd	54,000,000	54,000,000		418307
SJB005	10/08/2027	Unwound	37,074,511	mxn	37,074,511	37,074,511		418307
SJB771	22/05/2026	Unwound	162,000,000	mxn	162,000,000	162,000,000		418307

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

Producto	Fecha de evento	Contraparte /Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Caps & Floors	10/04/2023	Cliente 1	MXN	(29,254)	No reconoce la operación
LLAMADA DE MARGEN	11/04/2023	Cliente 2	MXN	11,400,000	No envió los fondos
LLAMADA DE MARGEN	11/04/2023	Cliente 3	MXN	12,700,000	No envió los fondos
Interest Rate Swap	28/04/2023	Cliente 4	MXN	(840,160)	No se liquida por incumplimientos
Interest Rate Swap	02/05/2023	Cliente 5	MXN	(1,430,194)	No se liquida cuenta congelada
Forwards FX	04/05/2023	Cliente 6	MXN	1,862,550	Problemas con el fondeo de la cuenta
INTERESES COLATERALES	05/05/2023	Cliente 7	USD	2,706	No envió los fondos
Forwards FX	10/05/2023	Cliente 8	MXN	616,730	Envío los fondos en fecha equivocada
Interest Rate Swap	12/05/2023	Cliente 9	USD	395	No envió los fondos
Forwards FX	10/05/2023	Cliente 10	MXN	616,730	No envió los fondos
FX Options (Vanilla)	19/05/2023	Cliente 11	MXN	9,660,000	Fuera de horario
Interest Rate Swap	29/05/2023	Cliente 12	MXN	(1,176,011)	No se liquida cuenta congelada
Interest Rate Swap	29/05/2023	Cliente 13	MXN	(877,033)	No se liquida por incumplimientos
FX Options (Vanilla)	31/05/2023	Cliente 14	MXN	888,200	No fondeo su cuenta
FX Options (Vanilla)	31/05/2023	Cliente 15	MXN	(428,200)	No fondeo su cuenta
FX Options (Vanilla)	02/06/2023	Cliente 16	MXN	1,920,000	No fondeo su cuenta
INTERESES COLATERALES	02/06/2023	Cliente 17	MXN	501,416	No envió los fondos
LLAMADA DE MARGEN	02/06/2023	Cliente 18	USD	2,350,000	No envió los fondos
Caps & Floors	08/06/2023	Cliente 19	MXN	2,350,000	No envió los fondos
FX Options (Vanilla)	12/06/2023	Cliente 20	MXN	1,416,100	No fondeo su cuenta
FX Options (Vanilla)	12/06/2023	Cliente 21	MXN	(772,100)	No fondeo su cuenta
FX Options (Vanilla)	14/06/2023	Cliente 22	MXN	1,980,000	No fondeo su cuenta
Forwards FX	15/06/2023	Cliente 23	MXN	1,010,669	No fondeo su cuenta
Caps & Floors	15/06/2023	Cliente 24	MXN	66,706	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	15/06/2023	Cliente 25	MXN	(88,234)	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	20/06/2023	Cliente 26	USD	5,271	No envió los fondos
FX Options (Vanilla)	22/06/2023	Cliente 27	MXN	930,000	No fondeo su cuenta
FX Options (Vanilla)	22/06/2023	Cliente 28	MXN	(470,000)	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	26/06/2023	Cliente 29	USD	9,522	No envió los fondos
Interest Rate Swap	26/06/2023	Cliente 30	USD	220	No envió los fondos
Interest Rate Swap	27/06/2023	Cliente 31	USD	37,455	No envió los fondos
FX Options (Vanilla)	28/06/2023	Cliente 32	MXN	3,936,807	No fondeo su cuenta
Forwards FX	28/06/2023	Cliente 33	MXN	17,439,667	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	28/06/2023	Cliente 34	MXN	(830,921)	No se liquida por incumplimientos
Interest Rate Swap	29/06/2023	Cliente 35	MXN	(1,322,180)	No se liquida cuenta congelada
Interest Rate Swap	30/06/2023	Cliente 36	USD	733	Discrepancia entre MO y FO

## Resumen de 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	2,480,650,367	Compra	Divisas	Divisas	113,552,303,250	88,352,313,193	2,442,557,372	38,092,995	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	2,890,902,487	Venta	Divisas	Divisas	(113,005,840,164)	(87,568,803,012)	2,852,771,741	38,130,746	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,345,395,000	Compra	Acción	Acción	100,689,423	152,643,314	122,500,000	1,222,895,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,056,535,000	Venta	Acción	Acción	(92,950,634)	(143,932,914)	122,500,000	934,035,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	6,365,243,230	Compra	Divisas	Divisas	254,861,958	204,507,433	6,141,603,023	223,640,207	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	6,108,509,230	Venta	Divisas	Divisas	(239,612,713)	(186,500,272)	5,884,869,023	223,640,207	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,342,155,000	Compra	Índice	Índice	168,961,369	108,996,316	-	3,342,155,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	678,380,000	Venta	Índice	Índice	(60,215,902)	(31,767,055)	-	678,380,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	44,433,154,693	Compra	Tasas	Tasas	1,267,993,544	1,040,951,144	2,878,217,710	37,359,353,015	4,195,583,968	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	43,754,360,977	Venta	Tasas	Tasas	(1,231,596,259)	(1,015,538,379)	2,878,217,710	36,853,248,293	4,022,894,974	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	181,405,000	Compra	Acción NE	Acción NE	6,384,725	6,468,960	-	181,405,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	181,405,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(14,123,515)	(15,179,361)	-	181,405,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,660,065,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(108,742,524)	(77,216,125)	-	2,660,065,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	201,074,820	Compra	Divisas NE	Divisas NE	2,167,879	316,187	-	201,074,820	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	201,074,820	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(5,140,918)	(1,150,715)	-	201,074,820	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	8,284,141,319	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	531,848,216	690,952,991	-	5,784,348,875	2,499,792,444	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	4,478,917,486	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	40,421,980	52,180,688	3,423,120,000	602,647,823	453,149,663	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	62,448,238,844	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	1,441,654,264	814,216,556	-	39,460,110,162	22,988,128,682	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	4,020,880,000	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	371,532,306	639,528,183	4,020,880,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	76,910,000	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	258,516,236	139,561,118	-	76,910,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	56,258,339,767	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	956,130,747	1,936,269,343	936,576,987	29,821,166,654	25,500,596,127	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	352,250,343,970	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	9,162,380,757	6,550,249,965	102,050,000,000	146,889,875,632	103,310,468,338	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	60,866,616,322	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(373,653,908)	(813,410,977)	201,443,559	35,781,199,250	24,883,973,513	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	346,062,523,401	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(10,055,512,968)	(7,735,343,172)	94,871,316,441	141,864,870,289	109,326,336,671	LINEA DE CREDITO



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			<b>A C T I V O</b>	775,992,842,182	720,520,798,331
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	70,383,884,085	51,075,132,115
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	1,253,565,449	839,400,968
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	154,218,644,731	140,917,013,036
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	69,144,825,679	70,482,153,033
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	80,254,960,641	65,228,673,637
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,818,858,411	5,206,186,366
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,819,390,717	5,207,399,336
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-532,306	-1,212,970
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	133,993,244	688,971,454
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	41,589,059,913	36,454,494,629
	101400102001		Con fines de negociación	31,689,990,378	30,156,421,721
	101400102002		Con fines de cobertura	9,899,069,535	6,298,072,908
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-970,873,328	-1,256,331,883
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	457,870,144,015	439,757,686,826
	101800105001		Créditos comerciales	230,162,395,113	232,322,806,414
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	196,994,038,020	196,589,871,096
		101800107002	Entidades financieras	15,909,069,623	19,672,071,100
		101800107003	Entidades gubernamentales	17,259,287,470	16,060,864,218
	101800105002		Créditos de consumo	32,665,300,381	33,685,216,840
	101800105003		Créditos a la vivienda	195,042,448,521	173,749,663,572
		101800507023	Media y residencial	189,897,341,902	167,945,874,159
		101800507024	De interés social	4,399,500	5,024,419
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,140,707,119	5,798,764,994
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
101800104002			<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2</b>	8,152,400,826	3,835,224,642
101800205005			Créditos comerciales	4,231,971,199	707,650,300
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	4,231,971,199	489,268,688
		101800506008	Entidades financieras	0	196,692,642
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	21,688,970
	101800205006		Créditos de consumo	702,612,969	628,144,315
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,217,816,658	2,499,430,027
		101800706018	Media y residencial	3,092,300,133	2,379,895,547
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	125,516,525	119,534,480
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
101800104003			<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3</b>	19,262,257,003	16,428,498,940
101800305008			Créditos comerciales	9,441,678,343	8,024,633,205
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	9,385,311,883	7,847,416,098
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	91,312,618
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	85,904,489
	101800305009		Créditos de consumo	857,333,568	967,210,444
	101800305010		Créditos a la vivienda	8,963,245,092	7,436,655,291
		101801006034	Media y residencial	8,537,355,049	7,210,515,665
		101801006035	De interés social	9,868,098	11,725,403
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	416,021,945	214,414,223
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
101800104004			<b>Cartera de crédito valuada a valor razonable</b>	0	0
101800405011			Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
	101801306050		Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	485,284,801,844	460,021,410,408
	131800103002		Partidas diferidas	2,861,433,469	0
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-15,837,066,952	-15,648,038,646
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	472,309,168,361	444,373,371,762
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	472,309,168,361	444,373,371,762
102000001001			<b>Activos virtuales</b>	0	0
102200001001			<b>BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
132400001001			<b>Otras cuentas por cobrar (neto)</b>	16,216,301,625	24,972,623,659
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	451,615,387	196,913,716
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	16,533,054
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,431,789,308	5,022,625,795
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	4,790,128,252	4,182,889,805
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,611,784,539	2,685,531,750
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	53,847,667	52,132,294
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,984,583,958	5,675,046,124
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,521,407,497	4,624,450,053
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			<b>P A S I V O</b>	698,167,222,907	645,630,099,083
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	508,628,767,265	439,729,162,368
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	257,432,889,717	221,198,858,397
	200200102002		Depósitos a plazo	246,956,556,012	195,240,240,380
		200200203003	Del público en general	204,186,899,869	192,934,636,714
		200200203004	Mercado de dinero	42,769,656,143	2,305,603,666
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	3,007,378,546	22,354,674,668
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,231,942,990	935,388,923
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	34,690,282,483	41,854,739,229
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	20,866,541,166	17,735,985,334
	200400102003		De largo plazo	13,823,741,317	24,118,753,895
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	2,800,651,773	11,262,297,601
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	66,751,047,708	68,665,753,661
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	139,721	0
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	4,239,329,860	222,305,367
	201200102001		Reportos	0	252
	201200102002		Préstamo de valores	4,239,329,860	222,305,115
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	38,376,539,996	33,365,196,441
	201400102001		Con fines de negociación	30,673,334,636	29,756,976,512
	201400102002		Con fines de cobertura	7,703,205,360	3,608,219,929
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	-187,289	5,071,226
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,719,867,057	2,786,518,860
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	23,151,887,629	30,185,071,939
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	11,461,563,858	16,008,563,377
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,659,950,161	1,887,085,482
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	3,606,077,296	4,069,908,482
	202400102004		Contribuciones por pagar	462,992,036	442,407,552
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	5,961,304,278	7,777,107,046
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,054,250,281	9,051,585,649
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	9,054,250,281	9,051,585,649
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
203400001001			Pasivo por impuestos a la utilidad	610,510,644	1,403,697,654
203600001001			Pasivo por beneficios a los empleados	6,085,248,361	5,609,839,432
203800001001			Créditos diferidos y cobros anticipados	1,058,887,418	1,488,859,656
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	77,825,619,275	74,890,699,248
440200001001			Participación controladora	77,824,291,518	74,889,528,699
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	13,468,335,561	12,906,542,339
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,155,059,263
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		<b>CAPITAL GANADO</b>	64,355,955,957	61,982,986,360
		400200203010	Reservas de capital	8,949,346,887	7,839,163,707
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	55,352,780,320	53,429,744,854
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	49,837,386,812	47,118,580,284
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	5,515,393,508	6,311,164,570
	400200203013		Otros resultados integrales	-106,562,651	551,721,561
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-274,604,447	-267,642,351
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	645,389,241	936,734,939
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-477,347,445	-117,371,027
		400201304013	Incremento por actualización de la remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	-1,925,893	38,944
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,327,757	1,170,549
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	87,941	51,914
	440400102002		Otra participación no controladora	1,239,816	1,118,635
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	3,295,161,242,994	2,896,541,953,566
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	255,252,079,004	250,881,950,057
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	472,901,993,321	421,605,849,123
	700800102001		Fideicomisos	443,766,042,369	392,383,073,692
	700800102002		Mandatos	29,135,950,952	29,222,775,431
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	691,594,178,122	560,892,681,342
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	9,250,117,599	11,132,876,663
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	4,239,329,860	249
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,524,923,160	1,132,978,315
702000001001			Otras cuentas de registro	1,860,398,621,928	1,650,895,617,817

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2023

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	38,010,900,809	25,174,089,012
600400101002	Gastos por intereses	24,851,499,187	13,029,403,012
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	13,159,401,622	12,144,686,000
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	431,854,571	-1,039,411,521
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	12,727,547,051	13,184,097,521
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	2,449,238,649	2,353,983,622
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	226,465,138	329,387,216
501400301007	Resultado por intermediación	1,123,199,685	842,954,734
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	490,263,211	313,193,680
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	8,713,526,001	8,344,400,005
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	7,850,257,457	8,020,442,336
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	167,795,604	58,244,060
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	8,018,053,061	8,078,686,396
602400501012	Impuestos a la utilidad	2,502,571,612	1,767,469,912
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	5,515,481,449	6,311,216,484
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	5,515,481,449	6,311,216,484
502800701014	Otros Resultados Integrales	-120,072,581	410,775,959
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	81,806,612	-156,604,458
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	-206,599,679	557,444,163
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	4,720,486	9,936,254
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	178,180	38,944
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	5,395,587,048	6,722,031,387
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	5,515,481,449	6,311,216,484
543201602158	Participación controladora	5,515,393,508	6,311,164,570
543201602159	Participación no controladora	87,941	51,914
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	5,395,587,048	6,722,031,387
543401702160	Participación controladora	5,395,587,048	6,722,031,387
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	<b>UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA</b>	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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 2023 Y 2022

CONSOLIDADO  
Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	8,018,053,061	8,078,686,396
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	-1,399,420,669	103,690,043
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	528,554,049	505,638,253
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	408,466,187	280,017,626
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	24,508,936	-57,656,639
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-167,795,604	-58,244,060
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-2,193,154,237	-566,065,137
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	837,127,514	-12,144,686,000
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	1,247,925,277
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	837,127,514	482,298,633
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	-13,874,909,910
851000102004		<b>Cambios en partidas de operación</b>	3,631,296,854	-15,689,310,144
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-14,827,663,047	-6,552,805,639
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	954,327,933	-1,398,439,320
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	-29,218,787,946	-6,971,121,189
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	3,090,499,764	12,758,682,397
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-958,450,978	-12,127,694,692
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	8,516,671,299	-22,296,768,127
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	-798,627,377	-10,993,596,722
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-174,855,400	-73,023,621
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	848,843,028	1,366,929,655
	851000403014	Cambio en captación tradicional	23,163,113,465	-2,325,954,075
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	10,990,142,108	11,020,068,371
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	78,825	-37,122
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	274,005,435	-2,535,351,875
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	3,078,072,690	10,590,958,422
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	-2,664,634	-2,664,634
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	152,147,434	78,415,668
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	464,940,937	524,812,510
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	2,446,674,524	13,393,791,999
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-4,367,171,206	-145,512,150
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	11,087,056,760	-19,651,619,705
		<b>Actividades de inversión</b>		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-253,594,015	-158,179,704
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	-8,152
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	166,903,920	57,687,998
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-341,990,625	-315,018,438
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**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 2023 Y 2022

**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	666,696
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	<b>-428,680,720</b>	<b>-414,851,600</b>
		<b>Actividades de financiamiento</b>		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	-1,247,925,277
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-468,342,242	0
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-2,849,994,662	0
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-837,127,514	-482,298,633
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	-11,011,546
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	25,174,089,012
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	-11,288,167,556
851000001003		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento</b>	<b>-4,155,464,418</b>	<b>12,144,686,000</b>
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>6,502,911,622</b>	<b>-7,921,785,305</b>
	851200000000	<b>Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
	851400000000	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo</b>	<b>63,880,972,463</b>	<b>58,996,917,420</b>
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	<b>70,383,884,085</b>	<b>51,075,132,115</b>



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

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2023

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE  
 CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2023 Y 2022

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Organismo de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
<b>Inicio al inicio del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Ajustes retrospectivos por correcciones de errores</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Inicio ajustado</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	1,110,183,180	-1,110,183,180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	5,515,393,508	0	0	0	0	0	0	0	5,515,393,508	87,941	5,515,481,449
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	81,806,612	-206,599,679	0	4,720,486	0	0	0	-120,072,581	0	-120,072,581
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	81,806,612	0	0	0	0	0	0	81,806,612	0	81,806,612
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	-206,599,679	0	0	0	0	0	-206,599,679	0	-206,599,679
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	4,720,486	0	0	0	4,720,486	0	4,720,486
Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Participación en ORI de otras entidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	178,180	178,180	0	178,180
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	5,515,393,508	81,806,612	-206,599,679	0	4,720,486	0	0	178,180	5,395,499,107	87,941	5,395,587,048
<b>Inicio al final del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	55,352,780,320	-274,604,447	645,389,241	0	-477,347,445	0	0	-1,925,893	77,824,291,518	1,327,757	77,825,619,275

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 1 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Información Financiera

SCOTIABANK INVERLAT

## Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros T3 2022T4 2022T1 2023T2 2023

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)15.1%10.1%15.9%  
13.2%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.6%1.0%1.6%1.3%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos  
productivos promedio)3.5%2.8%3.7%3.4%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total  
promedio)2.3%2.4%2.3%2.2%

Índice de Morosidad

(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del  
trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)3.8%3.7%3.8%4.0%

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

(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del  
trimestre/Saldo de la  
cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)85.8%90.6%  
87.8%82.2%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito20.99%19.78%21.0121.941).

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional)16.41%15.50%16.1216.591).

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos)40.6%45.5%44.0%56.6%

Sujeto a aprobación de Banco Central

Los resultados alcanzados dan una utilidad neta al cierre del segundo trimestre de \$2,520 millones, una disminución anual de \$342 millones; El resultado se debe a un mejor desempeño en los ingresos, los cuales fueron más que compensados por mayores impuestos a la utilidad debido a una menor inflación en el periodo; así como, mayores gastos de administración y promoción. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta disminuyó \$475 millones, principalmente por menores comisiones, un menor margen financiero y mayores requerimientos de reservas crediticias.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio 2023 se ubicó en \$5,515 millones; una disminución anual de \$796 millones o 13%; debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022 y mayores impuestos a la utilidad; compensados parcialmente por mayores ingresos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 2 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

3 meses 6 meses

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%30 jun

202230 jun

2023A/A

Δ%

Ingresos por intereses 13,144 18,392 19,618 49% 25,174 38,010 51%

Gastos por intereses (6,984) (11,733) (13,118) 88% (13,029) (24,851) 91%

Margen Financiero 6,160 6,659 6,500 6% 12,145 13,159 8%

Comisiones 1,023 1,199 1,024 0% 2,025 2,223 10%

Resultado por Intermediación 464 563 560 21% 843 1,123 33%

Otros ingresos/egresos de la operación 178 282 208 17% 313 490 57%

Ingresos no Financieros 1,665 2,044 1,792 8% 3,181 3,836 21%

Total Ingresos 7,825 8,703 8,292 6% 15,326 16,995 11%

Gastos de Administración y Promoción (3,870) (4,434) (4,280) 11% (8,344) (8,714) 4%

PTPP 1). 3,955 4,269 4,012 1% 6,982 8,281 19%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (391) (145) (287) -27% 1,039 (432) > -100%

Resultado de la Operación 3,564 4,124 3,725 5% 8,021 7,849 -2%

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

Controladora 58 79 89 53% 58 168 > +100%

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 3,622 4,203 3,814 5% 8,079 8,017 -1%

Impuestos a la Utilidad (760) (1,208) (1,294) 70% (1,768) (2,502) 42%

Resultado Neto 2,862 2,995 2,520 -12% 6,311 5,515 -13%

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender (108) 52 30 > -100% (157) 82 > -100%

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 201 (42) (165) > -100% 558 (207) > -100%

Remediación de beneficios definidos a los empleados 14 1 4 -71% 10 5 -50%

Resultado Integral 2,969 3,006 2,389 -20% 6,722 5,395 -20%

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

## Margen Financiero

El margen financiero fue de \$6,500 millones al cierre del segundo trimestre de 2023, un incremento de \$340 millones o 6% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente a mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como en inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos por el incremento en la tasa de referencia.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró una disminución de \$159 millones o 2%; debido principalmente a un cambio en la mezcla de cartera y captación. En cartera se observa un incremento en la cartera comercial e hipotecaria. En captación, la participación de depósitos de exigibilidad inmediata aumentó en relación con depósitos a plazo.

El margen financiero acumulado al cierre de junio 2023 ascendió a \$13,159 millones, un

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 3 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

incremento anual de \$1,014 millones u 8%, respecto al mismo periodo de 2022, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera comercial e inversiones en instrumentos financieros; contrarrestando los mayores intereses pagados en depósitos.

## Ingresos no Financieros

El total de ingresos no financieros fue de \$1,792 millones en el segundo trimestre de 2023, un incremento de \$127 millones u 8% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente a mayores ingresos por intermediación. Los ingresos por intermediación se vieron impactados por mayores ingresos provenientes de inversiones en derivados e instrumentos financieros en el trimestre.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$252 millones o 12%, debido principalmente a menores ingresos por colocación de créditos, así como a la cancelación de estimaciones de pérdidas crediticias esperadas en T1-23.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de junio 2023 ascendió a \$3,836 millones, un crecimiento anual de \$655 millones o 21%, debido principalmente a utilidad por intermediación de inversiones en instrumentos financieros, así como mayores ingresos provenientes de comisiones de menudeo.

3 meses 6 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ% 30 jun

202230 jun

2023A/A

Δ%

Aceptaciones por Cuenta de Terceros-1 1 0%- 2 0%

Actividades Fiduciarias 53 60 53 0% 118 113 -4%

Apertura de Cuenta 4 6 5 25% 8 11 38%

Cartas de Crédito sin Refinanciamiento 50 75 61 22% 107 136 27%

Cheques Certificados-1 - 0% 1 1 0%

Cheques de cajal- 1 0% 1 1 0%

Compraventa de instrumentos financieros1- 3 > +100% 1 3 > +100%

Manejo de Cuenta 89 83 82 -8% 172 165 -4%

Operaciones de Crédito 391 400 378 -3% 782 778 -1%

Otras Comisiones y Tarifas 361 495 369 2% 691 864 25%

Servicios de Banca Electrónica 45 51 45 0% 89 96 8%

Transferencia de Fondos 28 27 26 -7% 55 53 -4%

Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,023 1,199 1,024 0% 2,025 2,223 10%

3 meses 6 meses

Scotiabank-

Otros Ingresos/Egresos de la operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 4 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

202330 jun  
2023A/A  
Δ%30 jun  
202230 jun  
2023A/A  
Δ%  
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas (17) 35 (23) 35% (31) 12 > -  
100%  
Aportaciones al IPAB (492) (533) (542) 10% (994) (1,075) 8%  
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 49 35 9 -82% 132 44 -67%  
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados 4630 > +100% 223664%  
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito 1 - -100% 1 - -100%  
Ingresos por Arrendamiento (61) 3 19 > -100% 11 22 100%  
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 32 46 51 59% 61  
97 59%  
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 730762 719 -2% 1,581 1,481 -6%  
Quebrantos (71) (72) (66) -7% (476) (138) -71%  
Recuperaciones 3- 11 > +100% 6 11 83%  
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 17828220817% 31349057%

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses 6 meses

Scotiabank-

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%30 jun

202230 jun

2023A/A

Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (391) (145) (287) -27% 1,039 (432) > -  
100%

En el segundo trimestre de 2023, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$287 millones, una disminución de \$104 millones o 27% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos en la cartera comercial y de reservas voluntarias; compensados parcialmente por mayores requerimientos en la cartera de vivienda y consumo.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra un incremento de \$142 millones o 98% debido a mayores requerimientos en tarjeta de crédito; así como menores requerimientos en la cartera comercial.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de junio 2023 ascendió a \$432 millones, un incremento anual de \$1,471 millones, debido principalmente al efecto en reservas crediticias producto de la implementación de IFRS 9 durante el primer trimestre de 2022.

## Gastos de Administración y Promoción

3 meses 6 meses

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 5 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Scotiabank-

Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%30 jun

202230 jun

2023A/A

Δ%

Gastos de Personal (1,773) (2,367) (2,001) 13% (4,175) (4,368) 5%

Gastos de Operación (2,097) (2,067) (2,279) 9% (4,169) (4,346) 4%

Total de Gastos de Administración y Promoción (3,870) (4,434) (4,280) 11% (8,344) (8,714) 4%

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,280 millones en el segundo trimestre, un incremento de \$410 millones u 11% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a un incremento en gastos de personal por PTU y salarios, así como un incremento en gastos de operación principalmente por mayores amortizaciones.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$154 millones o 3%. Los gastos de personal mostraron una disminución de \$366 millones o 15%, principalmente por PTU y compensación variable, así como un incremento en gastos de operación principalmente por mayores honorarios, seguros e IVA.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de junio 2023 ascendieron a \$8,714 millones, un incremento anual de \$370 millones o 4%. Los gastos de personal mostraron un incremento de \$193 millones o 5%, debido principalmente a mayores salarios. Por su parte, los gastos de operación mostraron un incremento anual de \$177 millones o 4%, debido principalmente a mayores gastos por amortizaciones.

Impuestos a la Utilidad

3 meses 6 meses

Scotiabank-Impuestos - Impuestos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%30 jun

202230 jun

2023A/A

Δ%

Impuesto a la Utilidad Causado (807) (962) (979) 21% (1,429) (1,941) 36%

Impuesto a la Utilidad Diferido 47 (246) (315) > -100% (339) (561) 65%

Total de Impuestos a la Utilidad (760) (1,208) (1,294) 70% (1,768) (2,502) 42%

En el segundo trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$1,294 millones, un incremento de \$534 millones o 70% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por el efecto en la tasa impositiva producto de la disminución de la inflación.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto incrementó \$86 millones o 7%, originado principalmente por la disminución de la inflación en el periodo.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 6 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2023 ascendieron a \$2,502 millones, un incremento anual de \$734 millones o 42%, debido a una menor inflación del periodo.

## Balance General

### Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 228,718,248,273 266,608 17%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2,443,593,472,571 466,023 5%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 316,428,18,550 19,262 17%

Partidas diferidas -2,765 2,861 0%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,648) (16,278) (15,837) 1%

Otros Activos 47,430 50,515 37,076 -22%

Total Activo 720,521,776,396 775,993 8%

Depósitos 439,729 485,731 508,629 16%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 41,855 35,734 34,690 -17%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,052 9,099 9,054 0%

Otros Pasivos 154,994 170,396 145,795 -6%

Capital 74,891 75,436 77,825 4%

Total Pasivo y Capital 720,521,776,396 775,993 8%

Al 30 de junio de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$775,993 millones, un incremento de \$55,472 millones u 8% respecto al cierre de junio de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes de cartera de crédito, así como en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico).

Los activos totales disminuyeron \$403 millones respecto al cierre del trimestre anterior, debido principalmente a menores volúmenes de deudores por liquidación de operaciones (en Otros Activos) y cartera de crédito de riesgo de crédito etapa 1; compensados parcialmente por mayores volúmenes en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico y otras entidades financieras).

El total del pasivo registró \$698,168 millones al 30 de junio de 2023, un incremento de \$52,538 millones u 8% respecto al año pasado, debido principalmente a menores volúmenes mayores volúmenes en depósitos, compensados parcialmente por menores volúmenes de valores asignados por liquidar y acreedores por liquidación de operaciones de inversiones en instrumentos financieros (en Otros Pasivos).

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total disminuyó \$2,792 millones, debido principalmente a menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones, valores asignados por liquidar, colaterales vendidos o dados en garantía, y acreedores por reporto (en Otros Pasivos), que contrarrestan el incremento de volúmenes en depósitos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 7 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ %

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 34,313 33,042 33,368 -3%

Créditos a la Vivienda 176,249 192,939 198,261 12%

Total Préstamos de Menudeo 210,562 225,981 231,629 10%

Actividad Empresarial o Comercial 197,079 216,060 201,226 2%

Entidades Financieras 19,869 16,097 15,909 -20%

Entidades Gubernamentales 16,083 14,433 17,259 7%

Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 233,031 246,590 234,394 1%

Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 443,593 472,571 466,023 5%

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2023 se ubicó en \$234,394 millones, un incremento de \$1,363 millones o 1% respecto al año pasado y una disminución de \$12,196 millones o 5% respecto al trimestre anterior. El incremento anual se dio por mayores créditos de actividad empresarial o comercial y entidades gubernamentales; compensados por una disminución de créditos de entidades financieras. La disminución trimestral se debió principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial.

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2023 alcanzó \$231,629 millones, un incremento anual de \$21,067 millones o 10% y \$5,648 o 2% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados por mayores créditos a la vivienda.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

3 meses

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 16,428 18,550 19,262 17%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,648) (16,278) (15,837) 1%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 780 2,272 3,425 > +100%

Índice de morosidad 3.57% 3.78% 3.97% 40pb

Al 30 de junio de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$19,262 millones, un incremento anual de \$2,834 millones o 17% y un incremento trimestral de \$712 millones o 4%.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,837 millones, un incremento anual de \$189 millones o 1% y una disminución de \$441 millones o 3% respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.3% de la cartera total, una disminución de 14pb respecto al año anterior y de 5pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 82.2%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 8 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

al 30 de junio de 2023, una disminución de 1,300pb respecto del año anterior y de 600pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 30 de junio de 2023 fue de 4.0%, un incremento de 40pb respecto del año anterior y 19pb respecto al trimestre pasado.

## Depósitos

### Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023A/A

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 221,199 229,911 257,433 16%

Público en General 192,935 205,915 204,187 6%

Mercado de Dinero 2,305 43,630 42,770 > +100%

Total Depósitos a Plazo 195,240 249,545 246,957 26%

Títulos de Crédito Emitidos 22,355 5,047 3,007 -87%

Cuenta global de captación sin movimientos 935 1,228 1,232 32%

Total de Depósitos 439,729 485,731 508,629 16%

El total de depósitos registró \$508,629 millones al 30 de junio de 2023, un incremento anual de \$68,900 millones o 16%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo por \$51,717 millones o 26%.

Respecto al trimestre anterior, el total de depósitos aumentó \$22,899 millones o 5%, debido principalmente a un incremento en los depósitos a la vista y ahorro.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 30 de junio de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,054 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

### Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

(millones de pesos al 30 de junio de 2023 valor razonable)

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

Instrumentos financieros negociables	67,365	1,557	23	200	69,145
--------------------------------------	--------	-------	----	-----	--------

Sin restricción:	-	1,557	21	106	1,684
------------------	---	-------	----	-----	-------

Restringidos:	67,365	-	2	94	67,461
---------------	--------	---	---	----	--------

En operaciones de reporto	59,678	-	-	94	59,772
---------------------------	--------	---	---	----	--------

Préstamos de valores	4,523	-	-	-	4,523
----------------------	-------	---	---	---	-------

Otros	3,164	-	2	-	3,166
-------	-------	---	---	---	-------

Instrumentos financieros para cobrar o vender	55,717	22,132	-	2,406	80,255
---	--------	--------	---	-------	--------

Sin restricción:	44,251	22,132	-	2,406	68,789
------------------	--------	--------	---	-------	--------

Restringidos:	11,466	-	-	-	11,466
---------------	--------	---	---	---	--------

En operaciones de reporto	10,855	-	-	-	10,855
---------------------------	--------	---	---	---	--------

En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
---------------------------------------	---	---	---	---	---

Otros	611	-	-	-	611
-------	-----	---	---	---	-----

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	4,819	-	-	-	4,819
--	-------	---	---	---	-------

Sin restricción	4,819	-	-	-	4,819
-----------------	-------	---	---	---	-------

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 9 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

Total 127,90123,689232,606154,219

Scotiabank

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

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I-BANSAN-2327114,913,906,62011.20% 314,900

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

(millones de pesos al 30 de junio de 2023 valor razonable)

Con fines de: Contratos Adelantados Futuros Opciones Operaciones Estructuradas Swaps Paquetes de Instrumentos Derivados Total activo Total Pasivo

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva

Negociación 4,165 3,383 - - 1,424 1,291 216 181 25,885 25,818 - - 31,690  
 30,673

Cobertura - - - - - - - - - 9,899 7,703 - - 9,899 7,703

Scotiabank-Montos nomenclaturales en operaciones derivadas

(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2023)

Con fines de: Contratos Adelantados Futuros Operaciones Estructuradas Opciones Swaps Paquetes de Instrumentos Derivados

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva

Con fines de negociación

Posición USD 2,454,879

Posición EUR 266

Posición CHF

Posición GBP 11

Posición CAD

Divisas CAD

Divisas USD -1212360345

Divisas EUR -99

Divisas MXN -3030

Acciones MXN -1811811,3451,057

Índices MXN -2,6603,342678

Tasa de interés

Pesos -33,00232,338363,284356,368

Dólares -6686673,9823,791

Euros

Pesos Colombianos -177,500

Con fines de cobertura

Tasa de interés

Pesos -62,4483,500

Dólares -597482

Euros

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 10 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de junio de 2023) Pesos Dólares Udis Total

Actividad empresarial o comercial	154,336	42,658	-	196,994
Créditos a entidades financieras	15,738	171	-	15,909
Créditos a entidades gubernamentales	13,830	3,429	-	17,259
Créditos al consumo	32,665	-	-	32,665
Créditos a la vivienda	195,027	11 5	195,043	
Total	411,596	46,269	5 457,870	

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de junio de 2023) Pesos Dólares Udis Total

Actividad empresarial o comercial	4,231	1	-	4,232
Créditos al consumo	703	-	-	703
Créditos a la vivienda	3,210	4 4	3,218	
Total	8,144	5 4	8,153	

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de junio de 2023) Pesos Dólares Udis Total

Actividad empresarial o comercial	17,981	1,404	0 9,385	
Créditos a entidades financieras	57	0 0	57	
Créditos al consumo	857	0 0	857	
Créditos a la vivienda	8,926	30 7	8,963	
Total	17,821	1,434	7 19,262	

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

Saldo al 31 de marzo de 2023	18,550
Reestructuras	160
Recuperaciones (495)	
Castigos y quitas (672)	
Traspos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 31,800	
Fluctuación Tipo Cambio (81)	
Saldo al 30 de junio de 2023	19,262

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

Saldo al 31 de marzo de 2023	16,278
Más:	
Creación de reservas	40
Calificación	303
Menos: Adjudicaciones y otros	53
Castigos y quitas	649
Comercial	17
Hipotecario	169
Consumo	473
Desliz cambiario	82
Saldo al 30 de junio de 2023	15,837

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico (millones de pesos al 30 de junio de 2023)

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
	19,960	14.48%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 11 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

27,56411.00%	
37,04810.25%	
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos	24,572

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

30 jun					
2022	31 mar	2023	30 jun	2023	
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2					
Metropolitano	57.7%	63.8%	64.2%		
Noroeste - Centro	12.1%	10.5%	10.4%		
Norte	14.8%	13.2%	12.9%		
Bajío	9.2%	7.3%	7.1%		
Sur	6.2%	5.2%	5.4%		
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3					
Metropolitano	39.5%	51.0%	53.4%		
Noroeste - Centro	17.8%	16.3%	15.9%		
Norte	8.3%	6.1%	5.8%		
Bajío	16.6%	13.0%	12.1%		
Sur	17.8%	13.6%	12.8%		

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia  
(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Grado de Riesgo

Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas	Necesarias			
Cartera Comercial	Consumo	Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas		
No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos	Revolventes			
Exceptuada calificada					
Riesgo A1	397,208	826	100	471	331 1,728
Riesgo A2	72,818	731	29	196	30 986
Riesgo B1	9,009	89	38	54	19 200
Riesgo B2	7,672	8	50	31	73 162
Riesgo B3	6,399	47	23	34	74 178
Riesgo C1	2,887	23	36	63	49 171
Riesgo C2	3,638	78	28	88	223 417
Riesgo D	8,044	749	50	267	1,311 2,377
Riesgo E	11,352	5,813	631	292	1,736 8,472
Total	519,027	8,364	985	1,496	3,846 14,691
Exceso	1,146				
Reservas Constituidas	15,837				

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 2023.

La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 12 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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	\$	
7		
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		
25		
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		5
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		1,109
Total	\$	1,146

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

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes  
(millones de pesos al 30 de junio de 2023)  
TítulosImporteVencimiento  
B4 27070111,209,6861,70901-jul-27  
BV 2707016-01-jul-27  
Total11,209,6921,709

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de junio de 2023)ISRPTU  
Futuros castigos de crédito4,751 1,070

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 13 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Pagos anticipados(1,141) (257)  
Comisiones cobradas por anticipado494 110  
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo731 164  
Plan de pensiones1,006 226  
Provisiones y otros896 162  
Otros (752) (74)  
Efecto Neto en Diferido5,985 1,401

Al 30 de junio de 2023, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de junio de 2023)

VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal

Banca

MúltipleBanco de

MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos

Pesos

Inmediato-----

Mediano - - 7,313 3,035 - 10,348

Largo - - 9,500 3,947 - 13,447

Total - - 16,813 6,982 - 23,795

Tasa Promedio0.00%0.00%12.91%10.89%0.00%

Otros

Inmediato-----

Mediano8,186 - 13 560 1,759 10,518

Largo - - - 377 - 377

Total 8,186 - 13 937 1,759 10,895

Tasa Promedio5.84%0.00%6.41%5.64%5.83%

Total Préstamos Interbancarios 8,186 - 16,826 7,919 1,759 34,690

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 2023.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional 30 jun

202231 mar

202330 jun

2023

Depósitos a la Vista53.2%48.1%51.2%

Metropolitano22.5%21.5%24.8%

Noroeste - Centro11.4%9.0%9.1%

Norte7.6%6.7%6.9%

Bajío6.0%5.1%4.8%

Sur5.7%5.8%5.6%

Depósitos Ventanilla46.2%42.8%40.3%

Metropolitano18.0%19.9%16.3%

Noroeste - Centro5.8%4.4%4.0%

Norte9.4%7.6%7.3%

Bajío6.8%5.3%6.6%

Sur6.2%5.6%6.1%

Total de Captación del Público99.4%90.9%91.5%

Fondeo Profesional0.6%9.1%8.5%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 14 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio

(millones de pesos al 30 de junio de 2023) Pesos Dólares

Depósitos a la vista (incluye ahorro) 5.73% 2.49%

Depósitos a plazo 9.99% 0.00%

## Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos) 30 jun

2023

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable 98

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

Resultado por valuación de divisas (1,380)

Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados 1,754

Resultado por compraventa de divisas 662

Costos de transacción (2)

Total 1,123

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-1405	diciembre-24	MX0QSC1N00163	10	6,402,093,000	7.4
28-junio-1809	junio-33	MX0QSC1N00245	5	4,603,360,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032-3	3	4,455,000,000	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	Subyacente	Monto
99-SCOTIAB	04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080 Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB	05-21	4,842,100	29-abr-21	26-abr-24	1,093 Index (IDBTVER)	484,210,000
99-SCOTIAB	06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093 Index (IDBTVER)	57,230,000
99-SCOTIAB	08-21	802,900	12-ago-21	10-ago-23	728 Index (IDBTVER)	80,290,000
99-SCOTIAB	09-21	3,938,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093 Index (BNPIUIL5)	393,820,000
99-SCOTIAB	10-21	3,841,300	25-nov-21	22-nov-24	1,093 Index (BNPIUIL5)	384,130,000
99-SCOTIAB	01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093 MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB	02-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729 Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99-SCOTIAB	03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546 iShares MSCI China ETF	36,975,000
99-SCOTIAB	04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547 SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99-SCOTIAB	05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094 MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99-SCOTIAB	06-22	1,826,500	15-jun-22	13-jun-25	1,094 MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	182,650,000
99-SCOTIAB	07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093 MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99-SCOTIAB	08-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093 MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 15 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

99_SCOTIAB_09-22	490,000	23-jun-2222-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,000,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-2229-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-2214-nov-25	1,093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-2214-nov-25	1,092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-2221-nov-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-2217-dic-25	1,094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-2303-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2023					
232,948,680,000					

## 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 2023)

ReferenciaCapital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservasMonto

1Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468

2Resultados de ejercicios anteriores 49,837

3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 14,520

4Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones) No aplica

5Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1) No aplica

6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios77,826

Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios

7Ajustes por valuación prudencial No aplica

8Crédito mercantil

(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -

9Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -

10

conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)1,402

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -

12Reservas pendientes de constituir -

13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización -

14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable No aplica

15Plan de pensiones por beneficios definidos -

16

conservadorInversiones en acciones propias -

17

conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario -

18

conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 16 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

(monto que excede el umbral del 10%) -

19

conservadorInversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -

20

conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) -

21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo) -

22Monto que excede el umbral del 15% No aplica

23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras No aplica

24 del cual: Derechos de servicios hipotecarios No aplica

25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales No aplica

26Ajustes regulatorios nacionales 9,125

A del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) -

B del cual: Inversiones en deuda subordinada -

C del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras) -

D del cual: Inversiones en organismos multilaterales -

E del cual: Inversiones en empresas relacionadas -

F del cual: Inversiones en capital de riesgo -

G del cual: Inversiones en sociedades de inversión -

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

I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones -

J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 8,482

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 643

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

28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 10,527

29Capital común de nivel 1 (CET1) 67,299

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,581

31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,581

32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables No aplica

33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1 -

34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1) No aplica

35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica

36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios3,581

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 17 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

37

conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica

38

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

39

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

40

conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica

41Ajustes regulatorios nacionales -

42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica

43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -

44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,581

45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 70,881

Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 3,791

47Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2 -

48Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2) No aplica

49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica

50

conservadorReservas 1,109

51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 4,900

Capital de nivel 2: ajustes regulatorios

52

conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 No aplica

53

conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 No aplica

54

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

55

conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica

56Ajustes regulatorios nacionales -

57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 -

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 18 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

58Capital de nivel 2 (T2) 4,900  
59Capital total (TC = T1 + T2) 75,780  
60Activos ponderados por riesgo totales 456,829  
Razones de capital y suplementos  
61Capital Común de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.73%  
62Capital de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.52%

63Capital Total  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.59%  
64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)17.83%  
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%  
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%  
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%  
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)7.73%  
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)  
69Razón mínima nacional de CET1  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
70Razón mínima nacional de T1  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
71Razón mínima nacional de TC  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)  
72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No aplica  
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica  
74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo) No aplica  
75Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -  
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2  
76Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite) 1,109  
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,030  
78Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -  
79Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas -  
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)  
80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual No aplica  
81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) No aplica  
82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual -  
83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amotizaciones y vencimientos) -  
84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual -

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 19 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

ReferenciaDescripción

1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6

de las presentes disposiciones.

2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto

acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo,

resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remedaciones por beneficios definidos

a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

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

representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté

representado por títulos representativos o acciones.

5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este

concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.

6Suma de los conceptos 1 a 5.

7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.

8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

10\*Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12\*Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como 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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 20 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.

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

14No aplica.

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

16\*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:

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

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

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

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

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

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

19\*Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 21 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 23 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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.

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 24 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

65Reportar 2.5%

66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción

III, del Artículo 2 Bis 5.

67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.

68Renglón 61 menos 7%.

69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.

73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.

76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

790.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

81No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

82Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.

83Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.

84Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.

85Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 25 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General  
(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Referencias de los rubros del balance general Rubros del Balance General Monto presentado  
en el balance general

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de efectivo 72,528

BG2Cuentas de Margen 1,244

BG3Inversiones en instrumentos financieros 154,219

BG4Deudores por reporto 130

BG5Préstamo de valores -

BG6Instrumentos financieros derivados 41,589

BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros (971)

BG8Total de cartera de crédito (neto) 472,309

BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -

BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 15,997

BG11Bienes adjudicados (neto) 452

BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) 2,355

BG13Inversiones permanentes 3,849

BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta 14

BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto) 5,942

BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) 2,462

Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,805

Activos Intangibles (neto) 4,521

Pasivo

BG17Captación tradicional 508,655

BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 34,690

Valores Asignados por liquidar 2,801

BG19Acreedores por reporto 70,647

BG20Préstamo de valores -

BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 4,239

BG22Instrumentos financieros derivados 38,377

BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros -

BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -

BG25Otras cuentas por pagar 22,573

BG26Obligaciones subordinadas en circulación -

BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad 576

BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,059

Pasivos por arrendamiento 1,907

Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,054

Pasivos por Beneficio a los Empleados 6,043

Capital contable

BG29Capital contribuido 13,468

BG30Capital ganado 64,356

Cuentas de orden

BG31Avales otorgados -

BG32Activos y pasivos contingentes -

BG33Compromisos crediticios 255,252

BG34Bienes en fideicomisos o mandato 472,902

BG35Agente financiero del gobierno federal -

BG36Bienes en custodia o en administración 74,425

BG37Colaterales recibidos por la entidad 9,246

BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 4,239

BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -

BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 26 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

crédito etapa 3 1,525  
BG41Otras cuentas de registro 1,860,300

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 2023)

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

ACTIVO

1Crédito mercantil8 -

2Otros Intangibles9 -

3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales

10 1,402 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,402

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13 -

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado15 -

6Inversiones en acciones de la propia institución16 -

7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17 -

8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18 -

9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido18

10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19 -

11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido19

12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21 -

13Reservas reconocidas como capital complementario50 1,109 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,109

14Inversiones en deuda subordinada26-B -

15Inversiones en organismos multilaterales26-D -

16Inversiones en empresas relacionadas26-E -

17Inversiones en capital de riesgo26-F -

18Inversiones en sociedades de inversión26-G -

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -

20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 8,482 BG 16 Activos Intangibles \$4,521 más Gastos de Instalación \$3,961

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

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

23Inversiones en cámara de compensación26-P 643 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 643

PASIVO

24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil8 -

25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles9 -

26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado15 -

27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos15

28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores21 -

29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R31 3,581 BG 26

Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,581

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 27 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Fundamental133 -

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,791 BG 26

Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,791

32Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario47 -

33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados26-J -

**CAPITAL CONTABLE**

34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q1 13,468 BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797

35Resultado de ejercicios anteriores2 49,837 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$49,837

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 645 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$645

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 13,875 BG 30 Reservas de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$275) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$477) más Resultado Neto \$5,515

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

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

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

41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -

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

**CUENTAS DE ORDEN**

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -

**CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL**

44Reservas pendientes de constituir12 -

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

46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -

47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -

48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

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

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

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

6Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18

7Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades

---

financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.

8Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

9Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

10Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

11Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

12Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.

13Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

14Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

15Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

16Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

17Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

18Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

19Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

20Cargos diferidos y pagos anticipados.

21La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.

23Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 29 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

24Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.

25Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).

26Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.

27Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.

28Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.

29Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

30Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental.

31Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

32Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.

33Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.

34Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.

35Resultado de ejercicios anteriores.

36Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.

37Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.

38Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

39Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.

41Efecto acumulado por conversión.

42Resultado por tenencia de activos no monetarios.

43Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

44Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

45El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

46Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

47El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

48Derogado

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 30 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgoImporte de posiciones  
equivalentesRequerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 56,334 4,507

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable  
938 75

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA's 3,119 249

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

Posiciones en UDI's, UMA's o con rendimiento referido al INPC 50 4

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

Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 6,104 488

Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 1,100 88

Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de  
acciones 94 8

Posiciones en Mercancía - -

Requerimiento de capital por impacto Gamma - -

Requerimiento de capital por impacto Vega 20 2

Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo

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

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

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

Grupo I-B (ponderados al 2%) 18 1

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%) 826 66

Grupo III (ponderados al 11.5%) - -

Grupo III (ponderados al 20%) 4,452 356

Grupo III (ponderados al 25%) 1 -

Grupo III (ponderados al 50%) 336 27

Grupo III (ponderados al 57.5%) - -

Grupo III (ponderados al 100%) 257 21

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%) 3,200 256

Grupo V (ponderados al 10%) - -

Grupo V (ponderados al 20%) 196 16

Grupo V (ponderados al 50%) - -

Grupo V (ponderados al 115%) - -

Grupo V (ponderados al 150%) 27 2



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 31 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Grupo VI (ponderados al 20%)	3,103	248
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,188	175
Grupo VI (ponderados al 30%)	8,345	668
Grupo VI (ponderados al 40%)	9,104	728
Grupo VI (ponderados al 50%)	37,005	2,960
Grupo VI (ponderados al 70%)	27	2
Grupo VI (ponderados al 75%)	22,444	1,796
Grupo VI (ponderados al 85%)	9,729	778
Grupo VI (ponderados al 100%)	53,350	4,268
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	129	10
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	17,664	1,413
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	14	1
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	10,628	850
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	114,858	9,189
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	104	8
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,640	131
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%)	504	40
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%)	8,064	645
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,708	297
Grupo IX (ponderados al 100%)	30,256	2,420
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	35	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,100	248

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 32 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación 17 1  
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega 12 1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional  
Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital  
Indicador de Negocio 43,729 3,498

## Categoría Capitalización

Al 30 de junio del 2023, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 12.73% (Índice regulatorio más suplemento de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local más Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

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

2 Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg N.A.

3 Marco legal Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.

Tratamiento regulatorio

4 Nivel de capital con transitoriedad N.A.

5 Nivel de capital sin transitoriedad Fundamental

6 Nivel del instrumento Institución de crédito sin consolidar subsidiarias

7 Tipo de Instrumento Acción series "F" y "B"

8 Monto reconocido en el capital regulatorio 13,468,335,561

9 Valor nominal del instrumento Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales

9A Moneda del instrumento Pesos mexicanos

10 Clasificación contable Capital

11 Fecha de emisión 13-ene-01

12 Plazo del instrumento Perpetuidad

13 Fecha de vencimiento Sin vencimiento

14 Cláusula de pago anticipado No

15 Primera fecha de pago anticipado N.A.

15A Eventos regulatorios o fiscales No

15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado N.A.

16 Fechas subsecuentes de pago anticipado N.A.

Rendimientos / dividendos

17 Tipo de rendimiento / dividendo Fijo o Variable

18 Tasa de Interés / Dividendo La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.

19 Cláusula de cancelación de dividendos Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.

20 Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.

21 Cláusula de aumento de intereses No

22 Rendimientos / dividendos No Acumulable

23 Convertibilidad del instrumento N.A.

24 Condiciones de convertibilidad N.A.

25 Grado de convertibilidad N.A.

26 Tasa de conversión N.A.

27 Tipo de convertibilidad del instrumento N.A.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 33 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

ReferenciaDescripción

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 34 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 35 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Canadá-Japón-Turquía-  
China-Corea-Otras jurisdicciones diferentes a las anteriores-  
España-Luxemburgo-  
Estados Unidos-México-

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

ReferenciaRUBROJun-231

TMar-23

T-1Dic-22

T-2

1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 7,585 7,638 7,719

1aNo aplica

2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 456,829 459,745 475,011

3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)1.63%1.63%1.6%

3aNo aplica

4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones809,032 814,737 807,899

5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)0.94%0.94%0.94%

5aNo aplica

6aComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNo

6bComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNo

6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?0%0%0%

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

Scotiabank

Composición del Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 30 de junio de 2023)

ReferenciaMonto

Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes

1Capital Fundamental 67,299

2Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto 3,581

3 Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 36 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

4 Otros ajustes -

5 Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto 3,581

6 Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto 4,900

7 Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año -

8 "Capital complementario no elegible, como Suplemento al Capital Neto emitido por la institución en tenencia de terceros

9 Otros ajustes -

10 Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales 4,900

11 Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio 75,780

Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio

12 Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos -

13 "Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco los cuales no son subordinados a pasivos excluidos, pero que cumplen con todos los demás requisitos de la hoja de términos de Suplemento al Capital Neto

14 Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores. No aplica

15 Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022 No aplica

16 Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia sistémica local en resolución No aplica

17 Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes -

Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes

18 Suplemento al Capital Neto antes de deducciones 75,780

19 Deducciones de exposiciones que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto (no aplicable a una institución de importancia sistémica local con un solo punto de entrada). No aplica

20 Deducciones de inversiones en otros pasivos elegibles de Suplemento al Capital Neto -

21 Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto -

22 Suplemento al Capital Neto después de deducciones 75,780

"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto"

23 Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto 4 456,829

24 Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones 809,032

Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos

25 "Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto) 16.59%

26 "Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto) 9.37%

27 Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto 14.73%

28 "Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más requerimiento por suplemento de capital contracíclico más requerimientos por suplemento al capital neto, expresado como porcentaje de APSRT) 2.23%

29 " Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital 0.60%

30 Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco 0.00%

31 Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto 1.63%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 37 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Scotiabank

Composición del Suplemento al Capital Neto

ReferenciaExplicación

Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes

1El Capital Fundamental calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.

2Capital Básico No Fundamental. Esta línea proporcionará información sobre el Capital No Fundamental, calculado de conformidad con los artículos 2 Bis 5 y 2 Bis 6 de la CUB.

3Los instrumentos de capital Básico No Fundamental emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

4Otros elementos del Capital Básico No Fundamental que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

5Instrumentos de Capital Básico No Fundamental de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como línea 2 menos líneas 3 y 4.

6Capital Complementario, calculado con base en lo establecido en el artículo 2 Bis 5 y 2 Bis 7.

7Porción amortizada de Instrumentos de Capital Complementario donde el vencimiento remanente es mayor a un año. Esta línea reconoce que, en tanto el plazo remanente de un instrumento de capital complementario sea mayor al requerimiento de vencimiento residual de un año, el monto total podrá ser incluido en el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales, incluso si el instrumento es parcialmente del capital regulatorio vía el requerimiento para amortizar el instrumento en cinco años previo al vencimiento. Solo el monto no reconocido en el capital regulatorio, que cumpla con todos los criterios de elegibilidad del Suplemento al Capital Neto deberá ser reportados en esta línea.

8Instrumentos de capital complementario emitidos por la Institución en tenencia de terceros que no son elegibles para el Suplemento al Capital Neto. De acuerdo con la fracción IV, del artículo 2 Bis 5 de la CUB y los Anexos 1-R y 1-S, para cumplir con los requerimientos mínimos de Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales hasta el 31 de diciembre de 2021

9Otros elementos de capital complementario que no son elegibles como Suplemento al Capital Neto.

10Instrumentos de capital Complementario elegibles de Suplemento al Capital Neto de acuerdo al último párrafo del artículo 2 Bis 5 de la CUB, para ser calculado como: línea 6 - línea 7 - línea 8 - línea 9.

11Suplemento al Capital Neto surgido del capital regulatorio para ser calculado como: línea 1 + línea 5 + línea 10.

Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio

12Instrumentos externos del Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por la institución y deuda subordinada excluida. El monto reportado en esta línea debe cumplir los requerimientos de subordinación señalados en el Anexo 1-R o Anexo 1-S.

13Instrumentos externos emitidos directamente por institución que no son subordinados a pasivos excluidos, pero cumplen los otros requisitos de los Anexos 1-R o 1-S.

14El monto reportado en la línea 13, después de la aplicación de los límites superiores 2.5% y 3.5% mostrados en el penúltimo párrafo de la sección 11 de la hoja de términos del TLAC

15Instrumentos externos de TLAC emitidos con fines de financiamiento previo al 1 de enero de 2022. Montos emitidos después del 1 de enero de 2022 no son elegibles para efectos de Suplemento al Capital Neto y no deben ser reportados aquí. No aplica.

16Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar una institución de importancia sistémica local en resolución, sujeta a las condiciones mostradas en el segundo párrafo de la sección 7 de la hoja de términos de TLAC. No aplica.

17Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 38 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes

18Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 11 + línea 17.

19Deducciones de exposiciones de la institución de importancia sistémica local que corresponden a cuentas elegibles para Suplemento al Capital Neto. Todos los montos reportados en esta línea deben corresponder a deducciones aplicadas después de los ajustes adecuados acordados por el grupo de administración de crisis (CMG) (siguiendo el penúltimo párrafo de la sección 3 de la hoja de términos de TLAC, el CMG debe discutir y, donde sea adecuado y consistente con la estrategia de resolución, acordar la asignación de las deducciones).

20"Deducciones de inversiones en otros pasivos de TLAC propios, monto para ser deducido de recursos de TLAC. No aplica

21Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto.

22"El Suplemento al Capital Neto (como puede ser el caso) después de deducciones. Para ser calculado como: línea 18 - línea 20 - línea 21.

"Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto

23APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

24Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto.

Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos

25Indicador Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT de la institución bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto), para ser calculada como línea 22 dividido entre línea 23.

26"Indicador Suplemento al Capital Neto (como porcentaje de Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento), para ser calculado como línea 22 entre línea 24.

27Capital Fundamental (como porcentaje de APSRT) disponible después de cumplir con el requerimiento mínimo de capital y requerimiento Suplemento al Capital Neto de la institución. Para ser calculado como índice de capital fundamental adecuado, menos cualquier capital social (como un porcentaje de APSRT) usado para cumplir el capital fundamental, el capital básico, y el capital total mínimo, así como el requerimiento de Suplemento al Capital Neto.

28Requerimientos de suplementos específicos del banco (suplemento de conservación de capital más suplemento de capital contracíclico más requerimiento por suplemento para institución de importancia sistémica local, expresado como un porcentaje de APSRT). Calculado como la suma de: i) el suplemento de conservación de capital de la institución de importancia sistémica local; el requerimiento por suplemento contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local; y iii) los requerimientos por suplemento al capital neto.

29"El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan al suplemento por conservación de capital), de acuerdo al nivel de importancia sistémica local.

30El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con requerimientos por suplemento de capital contracíclico específico de la institución de importancia sistémica local).

31El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan con al requerimiento para absorción de pérdidas mayores.

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 39 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de \$870,000,000.00 (Ochocientos setenta millones de pesos 00/100) M.N., suscrito y pagado en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por la cantidad de \$8,053,500,000.00 (ocho mil cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

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

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

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

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

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

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

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

---

---

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

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

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

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

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

#### Riesgo de mercado

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

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

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

La estructura de límites de riesgo de mercado contempla montos volumétricos o nocionales de valor en riesgo (VaR), de sensibilidad, de concentración, límites de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 41 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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 2023 fue de \$24.75 millones y su promedio durante el segundo trimestre de 2023 fue de \$24.55 millones mismo que corresponde a un 0.032% del capital neto (\$76,930 millones a mayo 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)Cierre

Junio 2023Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados1,051,4031,018,768

Mercado de Dinero 62,08260,194

Tipo de cambio

Cash2,9553,102

Derivados115,120145,732

Capitales

Derivados9,93310,976

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre

Junio 2023Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés27.7820.39

Tipo de cambio7.0919.68

Capitales-0.01

VaR Global24.9024.55

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 2023 muestra una pérdida máxima de \$332.8 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado "Error de diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del rublo" y la crisis financiera asiática.

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

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

---

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

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

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

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

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

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

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

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US95,96575,104  
Liquidity Buffer

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 43 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

(bajo métrica CCL) 122,452113,922

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el segundo trimestre de 2023 de 140% y 108% respectivamente.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen 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  $\pm 100$  puntos base en las tasas de interés y considera la máxima pérdida esperada por escenario. Esta medición se realiza de manera semanal y se reporta a los miembros del Comité de Activos y Pasivos, al Comité de Riesgos y Consejo de Administración en sus respectivas sesiones.

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

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

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Valor Económico (+100 pbs) (1,286) (1,125)

Sensibilidad de Margen (-100 pbs) (369) (369)

Los Instrumentos financieros para cobrar o vender y derivados de cobertura, al ser parte integral del manejo de balance para el Banco, son monitoreados bajo las medidas

---

---

de sensibilidad antes descritas (valor económico y sensibilidad de margen) y por tanto se exceptúan de cálculo de VaR.

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Instrumentos financieros para cobrar o vender 1).80,25579,504

Derivados de Cobertura 80,12478,282

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 2023 y el promedio del segundo trimestre del 2023 fueron \$2,676 millones y \$2,731 millones, respectivamente.

### Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

---



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

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

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

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

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

Estados y Municipios.

Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.

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

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

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

---

cualquier aspecto de subordinación significativa que afecte el respaldo otorgado.

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre corresponde a \$24 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

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

Al cierre del segundo trimestre de 2023, el Banco mantiene \$583 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

#### Información metodológica

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

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito<sup>1</sup>).  
(Cifras al 30 de junio 2023) Pérdida  
Esperada Pérdida no Esperada

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 47 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Hipotecas 0.35% 2.95%

Consumo 3.76% 12.30%

Cartera Comercial 0.63% 4.07%

Total 0.73% 4.17%

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

Parámetros de Riesgo 1).

(Cifras a millones al 30 de junio 2023) EI 2). PISP

Hipotecas 198,260 1.85% 17.13%

Consumo 51,092 4.77% 72.17%

Cartera Comercial 277,367 1.75% 44.33%

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

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

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

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

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

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

---

---

#### Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de junio 2023 y en promedio durante el segundo trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.74% y 0.74% respectivamente.

#### Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

#### Riesgo Operacional

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

---

---

eventos externos, y comprende, entre otros, al riesgo tecnológico y al riesgo legal.

#### Metodología general

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

#### Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

#### Evaluación de riesgo operacional

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

#### Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

#### Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

#### Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

#### Riesgo Legal

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

Además de estar sujeto a la metodología general de riesgos operacionales, el Banco cuenta con una metodología de estimación de pérdidas esperadas y no esperadas de riesgo

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 50 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

legal, a través de la cual se estiman las probables pérdidas como consecuencia de un resultado adverso de sus juicios en proceso. Dicha metodología está basada en la experiencia de pérdidas de ejercicios anteriores, con las que, mediante un análisis estadístico de severidad y ocurrencia, se determina la probabilidad de pérdida de los asuntos legales en curso.

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de abril - junio 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$59.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$197.9 millones, donde \$4.8 millones corresponden a riesgo operacional y \$193.1 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: abril 2023 - junio 2023 (T2 2023)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

(Cifras en millones de pesos)Calculo Individual T2 2023Calculo Consolidado T2 2023

Importe sin ponderar (promedio)Importe

ponderado (promedio)Importe sin ponderar (promedio)Importe

ponderado (promedio)

ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES

1Total de Activos Líquidos Computables No aplica98,689.92 No aplica98,689.92

SALIDAS DE EFECTIVO

2Financiamiento minorista no garantizado166,954.6113,457.38166,954.6113,457.38

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 51 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

3Financiamiento estable	96,746.986,436.61	96,746.986,436.61
4Financiamiento menos estable	70,207.637,020.76	70,207.637,020.76
5Financiamiento mayorista no garantizado	236,483.4387,342.37	236,483.4387,342.37
6Depósitos operacionales	126,643.0530,936.12	126,643.0530,936.12
7Depósitos no operacionales	105,035.9451,601.80	105,035.9451,601.80
8Deuda no garantizada	4804.4414674804.4414674804.4414674804.441467	4804.4414674804.4414674804.4414674804.441467
9Financiamiento mayorista garantizado	No aplica875.001	No aplica875.001
10Requerimientos adicionales:	244,696.1017,865.74	244,696.1017,865.74
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,782.975,302.237,782.975,302.23	7,782.975,302.237,782.975,302.23
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda----		
13Líneas de crédito y liquidez	236,913.1312,563.51	236,913.1312,563.51
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales	19.1524333319.1524333319.15243333	19.1524333319.1524333319.15243333
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,575.062,575.062,575.062,575.06	2,575.062,575.062,575.062,575.06
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica122,134.69	No aplica122,134.69
ENTRADAS DE EFECTIVO		
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	3,073.07225.55455563,073.07	3,073.07225.55455563,073.07
225.5545556		
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	48,127.5131,799.30	48,127.5131,799.30
31,799.30		
19Otras entradas de efectivo	17,841.9817,841.9817,841.9817,841.98	17,841.9817,841.9817,841.9817,841.98
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	69,042.5649,866.84	69,042.5649,866.84
Importe ajustado		
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica98,689.92	No aplica98,689.92
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica72,267.86	No aplica72,267.86
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica140.12	No aplica140.12

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

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

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

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$61,855 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$34,168 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$2,676 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$12,856 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$19,611 millones y por operaciones de call money de \$12,644 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$17,021 millones.

Activos Líquidos:

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 52 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Activos Líquidos totales de \$109,918 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$53,664 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$46,815 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$7,174 millones y \$2,266 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del primer trimestre 2023: 133% - promedio del segundo trimestre 2023: 140% El coeficiente de cobertura de liquidez creció 700 pb respecto del primer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$5,959 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$6,651 millones.

Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$20,406 millones.

Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$24,342 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$8,979, millones.

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

Evolución de Activos Líquidos T2-2023AbrilMayoJunio

Efectivo 8%8%6%

Reservas en el Banco Central28%43%43%

Nivel 162%48%49%

Nivel 2<sup>a</sup>2%1%2%

Nivel 2B0%0%0%

Total de Activos Líquidos Ponderados100%100%100%

La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de FinanciamientoAbrilMayoJunio

CAPTACION TRADICIONAL

Depósitos de exigibilidad inmediata46%48%43%

Depósitos a plazo

Del público en general37%37%39%

Mercado de dinero8%8%6%

Títulos de crédito emitidos1%1%2%

Cuenta global de captación sin movimientos0%0%0%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

De exigibilidad inmediata0%0%0%

De corto plazo4%3%6%

De largo plazo3%3%4%

Total100%100%100%

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

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con

su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

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

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

Exposición Potencial Futura (junio 2023)

(Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación 3,111

Sin contrato de compensación 9,320

Posibles llamadas de margen (junio 2023)

Colateral en Tránsito 49

Downgrade (junio 2023)

Baja calificación 3 niveles 2,676

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

Scotiabank-Exposición en Derivados

(cifras en millones de pesos) Posición Cierre

Factor de Riesgo

Tasas de interés 1,051,403

Tipo de cambio 115,120

Capitales 9,933

Total 1,176,456

El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el segundo trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -7.06% al cierre de junio del 2023 y en promedio durante segundo trimestre del 2023 fue de -5.83%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos Límite MM

Concepto

Concentración de Depósitos (MXN) 9,500 MXN

Concentración de Depósitos (USD) 175 USD

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 55 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

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

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

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

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

Descripción Promedio

T2 2023Junio 2023

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM)45,29851,080

Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM)179,024184,855

Horizonte de Supervivencia - Banco (días)4541

Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días)4139

Horizonte de Supervivencia - Grupo (días)4541

Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días)4139

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 2023 y el promedio del segundo trimestre de 2023 son:

Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)95,96575,104

---

Liquidity Buffer  
(bajo métrica CCL) 122,452113,922

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

## II. Información cualitativa

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

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

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

Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y reportados independientemente.

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

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

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

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

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

---

---

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

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

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

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

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

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

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

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

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

---

---

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

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

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

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

Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 59 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

segundo trimestre de 2023, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del segundo trimestre 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

Periodo Reportado: segundo trimestre del 2023

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos) Cifras Individuales Cifras Consolidadas

Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado

Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE

1 Capital: 80,525.930.000.000.0080,525.9380,525.930.000.000.0080,525.93

2 Capital fundamental y capital básico no fundamental. 80,525.930.000.000.0080,525.9380,525.930.000.0080,525.93

3 Otros instrumentos de capital. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

4 Depósitos minoristas: 0.00202,161.872,312.0020.41188,593.370.00202,161.872,312.0020.41188,593.37

5 Depósitos estables. 0.0089,925.511,004.0610.9186,394.000.0089,925.511,004.0610.9186,394.00

6 Depósitos menos estables. 0.00112,236.361,307.939.50102,199.370.00112,236.361,307.939.50102,199.37

7 Financiamiento mayorista: 0.00344,727.4040,344.9716,131.87154,811.120.00344,727.4040,344.9716,131.87154,811.12

8 Depósitos operacionales. 0.0021,082.510.000.0010,541.260.0021,082.510.000.0010,541.26

9 Otro financiamiento mayorista. 0.00323,644.8940,344.9716,131.87144,269.870.00323,644.8940,344.9716,131.87144,269.87

10 Pasivos interdependientes. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

11 Otros pasivos: 0.0030,008.120.003,903.213,903.210.0030,008.120.003,903.213,903.21

12 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.00

13 Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.0030,008.120.003,903.213,903.210.0030,008.120.003,903.213,903.21

14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible. 80,525.93576,897.3942,656.9720,055.49427,833.6380,525.93576,897.3942,656.9720,055.49427,833.63

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO

15 Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto. No Aplica No Aplica No Aplica No Aplica 6,415.82 No Aplica No Aplica No Aplica No Aplica 6,415.82

16 Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.00

17 Préstamos al corriente y valores: 0.00120,236.3536,600.13309,590.18341,079.240.00120,236.3536,600.13309,590.18341,079.24

18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

19 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I. 0.0010,228.493,762.982,235.245,651.000.0010,228.493,762.982,235.245,651.00

20 Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales: 0.0090,222.2329,777.10136,743.01169,603.680.0090,222.23

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 60 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

29,777.10136,743.01169,603.68  
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00  
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.003,327.903,522.47194,232.06155,695.86  
155,695.860.003,327.903,522.47194,232.06155,695.86  
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.00436.91462.4125,598.2117,088.490.00436.91462.4125,598.2117,088.49  
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0016,894.630.001,978.0910,128.690.0016,894.630.001,978.0910,128.69  
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00  
26Otros Activos:0.0045,757.71548.324,673.1337,737.430.0045,757.71548.324,673.1337,737.43  
27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00  
28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica2,183.300.000.001,855.80No Aplica2,183.300.000.001,855.80  
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No Aplica0.000.000.002,505.68No Aplica0.000.000.002,505.68  
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.002,952.25No Aplica0.000.000.002,952.25  
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 43,574.41548.324,673.1330,423.690.0043,574.41548.324,673.1330,423.69  
32Operaciones fuera de balance.No Aplica242,647.550.000.0012,132.38No Aplica242,647.550.000.0012,132.38  
33Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica397,364.87No AplicaNo AplicaNo Aplica397,364.87  
34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica107.67No AplicaNo AplicaNo Aplica107.67

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

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

Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$173,628 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$134,139 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$85,198 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$18,833 millones y \$14,496 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$4,829 millones.

Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$335,901 millones y por operaciones mercado de dinero de \$16,608 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,248 millones, deducciones de capital por \$10,527 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$12,970 millones.

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

Promedio del primer trimestre del 2023: 108.14% -Promedio del segundo trimestre del 2023: 107.67% El coeficiente de financiamiento neto incrementó 47pb respecto al primer

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 61 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 9,061 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 1,880 millones.

El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyeron \$2,789 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)AbrilMayoJunio

Financiamiento Estable Disponible421,783430,595431,123

Financiamiento Estable Requerido397,888398,775395,431

Coficiente de Fondeo Estable Neto106.01%107.98%109.03%

El impacto en el Coficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación.

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

Inmobiliaria Scotia Inverlat, S.A. de C.V.

Scotia Servicios de Apoyo, S.A. de C.V.

Scotia Inverlat Derivados

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

Posiciones en Acciones

Al cierre de junio de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$23 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.35) millones de pesos.

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/  
Minusvalía

ScotiabankPública1-ALFA-A 283,547 3.02 3.04 (0.02)

ScotiabankPública1-ALPEK-A 410,000 7.10 7.48 (0.38)

ScotiabankPública1E-FRES-\* 2,075 0.28 0.35 (0.07)

ScotiabankPública1I-EWZ-\* 2,500 1.39 1.14 0.25

ScotiabankPública1I-GDX-\* 5,000 2.58 2.62 (0.04)

ScotiabankPública1I-SHV-\* 3,500 6.62 6.68 (0.06)

ScotiabankPública1I-IBTA-N 23,300 2.09 2.12 (0.03)

Total 729,922.00 23.08 23.43 (0.35)

Al cierre del segundo trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.60 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosUtilidadPérdidaUtilidad/  
Pérdida

ScotiabankPública1-ALFA-A 70,100 - (0.09) (0.09)

ScotiabankPública1-ARA-\* 125,453 0.01 - 0.01

ScotiabankPública1-TLEVISA-CPO 112,332 0.01 (0.01) -

ScotiabankPública1-ALPEK-A 34,064 - (0.06) (0.06)

ScotiabankPública1-NEMAK-A 222,782 0.05 - 0.05

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 62 / 92  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	20,000	0.08	-	0.08
Scotiabank	Pública	1-LASITE-B-1	124,000	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	95	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	3,000	0.01	(0.03)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	17,116	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	989	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	9,600	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	700	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	401,750	0.05	(0.13)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	68,370	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	39,956	0.09	(0.04)	0.05
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	21,285	0.05	(0.02)	0.03
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	60,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	173,609	-	(0.21)	(0.21)
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	150,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	437	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	900	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,700	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,654	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	697	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-LAB-B	114,698	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	10,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	2,630	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	9,500	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	423,569	0.11	-	0.11
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	178,675	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	10,116	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	62,754	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	18,486	0.04	(0.05)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	155,200	0.09	(0.01)	0.08
Scotiabank	Pública	1-GFNORTE-O	42,621	0.02	(0.08)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	53,405	-	(0.06)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	71,108	0.12	-	0.12
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	76,242	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	50,000	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	100,000	0.05	-	0.05

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	825	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	9,200	0.49	-	0.49
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	2,201	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	400	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	5,693	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	2,296	-	(0.08)	(0.08)
Total			3,061,408	1.59	(0.99)	0.60

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

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Pérdida
-------------	--------------------	---------	---------	---------	---------	-------	-----------------------

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 63 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Minusvalía

ScotiabankSin cotizaciónEMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.1,222---

ScotiabankSin cotizaciónBLADEX COM8,095---

Total9,317---

Al 30 de junio de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$7.54 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 5.55 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de \$1.99 millones de pesos.

Requerimientos de CapitalizaciónTotal LargaTotal CortaValor Absoluto de la posición

Coeficiente de Riesgo de mercadoRequerimiento de capital

Por Riesgo General de Mercado24.95-24.9522.23% 5.55

Por riesgo específico

Canasta de acciones, 23.16-23.168.00% 1.85

Índices accionarios1.79-1.794.00%0.07

Requerimiento por riesgos específico1.79-1.794.00%0.07

Total Requerimiento de capital7.54

Anexo 1-0 Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

ReferenciaRubromar-23jun-23

1Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 732,429 736,726

2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,135) (10,527)

3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 722,293 726,200

Exposiciones a instrumentos financieros derivados

4Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) 8,290 7,944

5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 4,478 4,364

6Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo

7(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) (2,820) (3,112)

8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)

9Importe nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos

10(Compensaciones realizadas al nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)

11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 9,948 9,195

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 4,847 130

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 64 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (846) (130)  
14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT - 3  
15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros - -  
16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 4,002 3  
Otras exposiciones fuera de balance  
17Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) 248,799 255,252  
18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (170,305) (181,618)  
19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 78,495 73,634  
Capital y exposiciones totales  
20Capital de Nivel 1 68,783 70,881  
21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 814,737 809,032  
Coeficiente de apalancamiento  
22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 8.44% 8.76%

## TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

Referencia DESCRIPCIÓN mar-23 jun-23

1 Activos totales 778,865 778,445  
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 (482) (643)  
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 (31,642) (32,394)  
5 Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores (846) (127)  
6 Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 78,495 73,634  
7 Otros ajustes (9,653) (9,884)  
8 Exposición del coeficiente de apalancamiento 814,737 809,032

## TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

Referencia DESCRIPCIÓN mar-23 jun-23

1 Activos totales 778,865 778,445  
2 Operaciones en instrumentos financieros derivados (41,589) (41,589)  
3 Operaciones en reporto y préstamos de valores (4,847) (130)  
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 732,429 736,726

## TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODO mar-23 jun-23 Variación

Capital Básico 1) 68,783 70,881 2,097  
Activos Ajustados 2) 814,737 809,032 (5,705)  
Razón de Apalancamiento 3) 8.44% 8.76% 32 pb  
Reportado en la fila 20  
Reportado en la fila 21 y  
Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1  
Cifras previas a la réplica de Banxico

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

---

El indicador se ubicó en 8.76%, 32pb superior respecto al trimestre anterior, debido a una mejora del capital nivel 1 (+26 pbs) por la utilidad del periodo, así como a la disminución en los activos ajustados (+6pb), principalmente por las partidas fuera del balance (\$4,861 millones o +5pb).

## TABLA I.2

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

## ReferenciaExplicación

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico

(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.

2Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.

5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.

En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.  
7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.

8No aplica.

9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 66 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:

Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.

15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.

Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.

16Suma de las líneas 12 a 15

17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

18Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.

El monto se debe registrar con signo negativo.

19Suma de las líneas 17 y 18

20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

TABLA II.2

NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 67 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

## ReferenciaExplicación

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.

.El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo

5Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

6Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

8Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1.

## TABLA III.2

### NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

#### ReferenciaDescripción

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

#### Agencias Calificadoras

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA (mex) F1+ (mex) Estable

Standard & Poor'ssmxAAAmxA-1+Estable

La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 68 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Agencias Calificadoras (Fitch Ratings y Standard & Poor's), en su calidad de emisor a escala nacional y están sujetas a modificaciones sin previo aviso por parte de las Agencias Calificadoras.

## Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 13 de noviembre del 2013,

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 69 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 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 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,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 70 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

GFSBI, para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 30 de junio del 2023, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$72,613 millones de pesos.  
Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$72,528 millones de pesos.

Adicionalmente:

Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$250 millones de dólares.

Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.

Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución. Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

Inversiones relevantes en capital

Al 30 de junio de 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

---

I. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 72 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

**Negociación:** La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

**Cobertura:** Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

**Arbitraje:** Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

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

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

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

Núm.Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

1. Flujos de Efectivo Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

2. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente. Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

3. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante Activa Cobertura ante una posible



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 73 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)

4. Valor Razonable Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera Activa Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

5. Flujos de Efectivo Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

6. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)

7. Flujos de Efectivo Reportos Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)

9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Subyacente\* Futuros Opciones Swaps

MR MEMR MEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en

---

los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

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

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

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)

El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.

Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.

Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.

Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.

Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.

---

Diversificar fuentes de fondeo.

Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.

Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de junio 2023 y en promedio para el segundo trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 95,96575,104

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,452113,922

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 Opciones Europea Caps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$Cap = \sum_{i=1}^n Caplet_i$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$Floor = \sum_{i=1}^n Floorlet_i$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto nominal 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 nominal predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEL intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 76 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{(t<T)}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

Forward Forward OTC Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Clase de

activo Derivado Tipo Breve descripción

Índices, capitales y metales Opciones

Europea Opción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

Binaria Tipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listados Mexder

Futures IRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de

activo Derivado Tipo Breve descripción

FI Security Bonos Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ Cash Acciones Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversión ETFs Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadas Bonos Los precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente. La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

---

#### Políticas Líneas de Crédito

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

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

a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

Metales

Sujetos de Crédito

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

Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".

La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.

Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de

---

---

mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

#### Idoneidad del Cliente

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

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

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

#### Políticas de VaR

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

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

#### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

##### Métodos y técnicas de Valuación:

##### Cálculo de Sensibilidades

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

##### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

---

---

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

#### Bonos de Tasa Flotante

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

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

#### Bonos Cupón Cero

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

#### Riesgo de Crédito

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

#### Sensibilidad del Pasivo

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

#### Derivados de Tasas de Interés

##### Swaps de Tasa de Interés

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

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

##### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

---



---

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

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

Durante el segundo trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 81 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

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

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,452,113,922

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:

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 82 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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

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

Scotiabank

(millones de pesos) Normal Escenario Posible Escenario Probable Escenario de Estrés

Gap 30d Gap Acum 95,96593,28993,28993,289

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (2,676) (2,676) (2,676)

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

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

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

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una

---

---

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

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

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

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

#### Gamma

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

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas  $\gamma_{1\%}$  y  $\gamma_{5\%}$ .

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

#### Vega

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

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

#### Rho

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 84 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

## II. Información Cuantitativa

### Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2023:

Scotiabank

0-3 Meses3 - 12 Meses1 - 3 Años3 - 5 Años5 - 10 Años10 - 30 AñosTotal

Swaps (67,208.03) (87,150.30) (205,016.86) 157,077.7282,346.02806,302.11686,350.66

CCS18,906.30 (3,522.27) 25.90388.49233.09 (12.95) 16,018.56

Caps&Floors (258.99) 3,276.232,175.5277.70--5,270.46

Binary Caps&Floors-----

TIIE Futures-----

Mbonds Futures-----

Total DERIVADOS (48,560.72) (87,396.34) (202,815.44) 157,543.9182,579.11806,289.16

707,639.68

Cifras expresadas en pesos

### Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 85 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 (190.87) Millones de pesos.  
Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (381.74) Millones de pesos.  
Y finalmente con el escenario muy poco probable (918.98) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock(+/-) P&L Stress 1

Shock(+/-) P&L Stress 2

Shock(+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIE

y Bono M--50.00-100.000.00200.00-

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps 0.71188.9150.00(35.38)100.00(70.76)200.00(141.53)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.04) (0.74) 0.10-0.40 (0.02) 1.00 (0.04)

a FX %Forwards 90.841,554.820.10(155.48)0.20(310.96)0.50(777.41)

a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-

Total (190.86) (381.74) (918.98)

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 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones Delta Vega Gamma

Options BNPUI5.INDX---

Options EEM.P216,886.005,012.0077,247.00

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options EZU.P---

Options FXI.P---

Options GLD.P---

Options ICLN.OQ---

Options IDBTV1.INDX---

Options MCHI.OQ335,934.004,076.0088,017.00

Options MSFDV1.INDX---

Options NVDA.OQ---

Options QQQ.OQ---

Options SOXX.OQ---

Options SPXSR5.INDX---

Options SOXX.OQ---

Options SPXSR5.INDX---

TOTAL 552,820.009,088.00165,264.00

Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 86 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja(0.1) (0.3) (0.5)  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P(21,688.60) (65,065.80) (108,443.00)  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options MEXIBX.INDX(33,593.4) (100,780.2) (167,967)  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
TOTAL(55,282.00) (165,846.00) (276,410.00)  
Cifras expresadas en pesos

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

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P10,844.3032,532.9043,377.20  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options MEXIBX.INDX16,796.750,390.167,186.8  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
TOTAL27,641.0082,923.00110,564.00  
Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 87 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

ScotiabankMonto  
Probable(55,282.00)  
Poco Probable(165,846.00)  
Muy poco Probable(276,410.00)  
Cifras expresadas en pesos

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

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN333,000,000 (393,000,000)  
CLIENTE 2MXN305,800,000 (107,200,000)  
CLIENTE 3MXN31,200,000 (16,600,000)  
CLIENTE 4MXN258,700,000 (361,300,000)  
CLIENTE 5USD60,040,000 (53,710,000)  
CLIENTE 6USD34,460,000 (26,000,000)  
CLIENTE 7USD113,900,000 (328,200,000)  
CLIENTE 8USD520,000 (270,000)  
CLIENTE 9USD14,940,000 (3,380,000)  
CLIENTE 10USD-(400,000)  
CLIENTE 11USD15,380,000 (19,420,000)  
CLIENTE 12MXN74,900,000 (239,100,000)  
CLIENTE 13MXN251,100,000 (256,900,000)  
CLIENTE 14MXN550,700,000 (1,822,400,000)  
CLIENTE 15MXN276,929,370 (353,789,203)  
CLIENTE 16MXN4,000,000-  
CLIENTE 17USD5,720,000 (7,140,000)  
CLIENTE 18USD860,000 (400,000)  
CLIENTE 19MXN12,000,000-  
CLIENTE 20USD12,110,000 (10,040,000)  
TOTAL2,356,259,370 (3,999,249,203)

Cifras expresadas en pesos

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



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 88 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 89 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 90 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 91 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 92 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(1) Autorización y bases de presentación-

## Autorización

El 19 de julio de 2023, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2022 adjuntos se someterán a la aprobación de los Accionistas.

## Bases de presentación

### a) Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 "Estructura de las normas de información financiera", considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A "Marco conceptual", así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad". Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 "Supletoriedad", y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable ,

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.

## b) Información financiera comparativa

El 13 de marzo de 2020 se publicó en el Diario Oficial de la Federación la resolución que modifica las Disposiciones, la cual establece que las instituciones de crédito reconozcan el efecto de los cambios contables que surgen de dicha resolución en utilidades retenidas, sin reformular los estados financieros de ejercicios anteriores al 1 de enero de 2022, y que los estados financieros básicos consolidados al y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021, no se presenten.

## c) Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

## Juicios

La información sobre juicios realizados en la aplicación de políticas contables que tienen el efecto más importante sobre los importes reconocidos en los estados financieros consolidados se describe en las siguientes notas:

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).

-Nota 9 - Derivados: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.

-Nota 10 - Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).

-Nota 14 - Arrendamientos: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

## Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

La información sobre supuestos e incertidumbres de estimación que tienen un riesgo significativo de resultar en un ajuste material a los importes en libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las notas a continuación:

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

-Nota 3 - Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

-Nota 10 - Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.

-Nota 18 - Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.  
-Nota 20 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto, correspondiente a precios obtenidos exclusivamente con datos de entrada de Nivel 1.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios) que corresponde a precios obtenidos con datos de entrada nivel 2.

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo, para aquellos previos obtenidos con datos de entrada nivel 3.

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 4 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

- I. Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.
- II. Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.
- III. Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones I y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Banco que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2022.

Al 31 de diciembre de 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

- Nota 7 - Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

d) Moneda funcional y de informe

Los estados financieros consolidados antes mencionados se presentan en moneda de informe peso mexicano, que es igual a la moneda de registro y a su moneda funcional.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 5 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

## e) Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

## f) Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

Los estados financieros consolidados reconocen los activos y pasivos provenientes de operaciones de compraventa de divisas, inversiones en valores, préstamo de valores e instrumentos financieros derivados en la fecha en que la operación es concertada, independientemente de su fecha de liquidación.

## (2) Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, excepto por lo que se indica en la nota 4 que incluye los cambios contables reconocidos durante el ejercicio.

### (a) Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

	Inflación	
31 de diciembre de	UD	Del año Acumulada
2022	7.64	687.58%19.50%
2021	7.10	827.61%14.16%
2020	6.60	563.23%11.31%

### (b) Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 6 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

de las entidades al 31 de diciembre de 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria	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	100%	Ciudad de México	Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder

#### (c) Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

#### (d) Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

#### (e) Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compra de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos; en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo. Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

## (f) Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, en las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

## (g) Inversiones en instrumentos financieros

### i. Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste,

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

## ii. Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como:

-Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

-Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

-Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

-Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

-Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

-Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 9 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Banco deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Banco.

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2022, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados:

-el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

-las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados como se menciona en la hoja siguiente.

-el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

-las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio -

El Banco realiza una evaluación del objetivo del modelo de negocio en el que se mantiene un instrumento financiero a nivel del portafolio, ya que esto es lo que mejor refleja la manera en que se administra el negocio y se entrega la información a la Administración. La información considerada incluye lo que se muestra a continuación:

-las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

-cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

-los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

-cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

-la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en periodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras.

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son SPPI -

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal" se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

-eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

-términos que pudieran generar apalancamiento;

-términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

-términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

-características de pago anticipado y prórroga; y

-términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 11 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas -

Instrumentos financieros negociables (IFN) Posteriormente, y en cada fecha de reporte los títulos se valúan a valor razonable proporcionado por un proveedor de precios independiente; los efectos de valuación y los resultados por compraventa se reconocen en los resultados del ejercicio, dentro del rubro "Resultado por intermediación". Cuando los títulos son enajenados, el resultado por compraventa se determina del diferencial entre el precio de compra y el de venta, debiendo reclasificar el resultado por valuación que haya sido previamente reconocido en los resultados del ejercicio, al resultado por compra venta dentro de dicho rubro.

Los intereses devengados de los títulos de deuda se determinan conforme al método de interés efectivo y se reconocen en los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses".

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura. Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI) Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV) Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".

Inversiones en acciones a través de ORI Estos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

iii. Baja en cuentas

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una

---



---

transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

#### iv. Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el periodo en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del periodo, como una reversión de PCE previamente reconocida.

#### Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contraparte deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

#### (h) Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14

---

---

"Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros que se recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio.

(i) Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses".

(j) Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

-Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

-Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Operaciones con fines de negociación-

-Títulos Opcionales ("Warrants"):

Los títulos opcionales son documentos que se emiten en serie y se colocan entre el gran público inversionista, representan un derecho temporal adquirido por los tenedores a cambio del pago de una prima por la emisión en Acciones o Índices, por lo tanto, dicho derecho expira al término del plazo de vigencia, por lo que la tenencia de estos implica el reconocimiento de que el valor intrínseco y el precio de mercado del título opcional en el mercado secundario puedan variar en función del precio de mercado de los activos de referencia.

-Contratos adelantados ("forwards") y futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria. El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

-Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

-Swaps:

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se transforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Banco, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

-Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

-Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe discontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Banco.

Derivados implícitos-

El Banco mantiene derivados implícitos que no se utilizan para cubrir posiciones, sino como estrategia de negociación; dichos derivados se encuentran relacionados a estructuras y/o notas emitidas bajo las siguientes características.

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 16).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses".

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados financieros OTC por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados CDS a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

## (k) Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de "Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

La estimación de pérdidas crediticias esperadas correspondiente a los montos por cobrar antes mencionados, deberá determinarse de conformidad con lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros por cobrar".

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

## (l) Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de

---

---

crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, hipotecaria de vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación.

Créditos comerciales. Incluye los créditos mencionados a continuación:

- a) los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
  - b) créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
  - c) créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
  - d) créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;
  - e) los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y
  - f) aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

-El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

-El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

con garantía de inmuebles.

## Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte, se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

## Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

## Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3r.

## Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

- a) La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
- b) Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
- c) Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en

---

---

que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

#### Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen a continuación:

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

- cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
- cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM, UMA o UDI);
- concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito;
- prórroga del plazo del crédito;
- modificación al esquema de pagos pactado, o
- ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por lo que da de baja el crédito original.

Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

- Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.
- Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los períodos consecutivos inmediatos anteriores.
- Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.
- En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3o).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

- Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.
  - En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
  - Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
  - Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

## Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

1. Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

2. Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

3. Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como se muestra a continuación:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

c. Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

4. Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

5. Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

- a) los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
- b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
- c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho período representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago	contractual	Equivalencia
30 días	90 días	
Quincenal	2 quincenas	Más de 6 quincenas
Catorcenal	2 catorcenas	Más de 6 catorcenas
Decenal	3 decenas	Más de 9 decenas
Semanal	4 semanas	Más de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

- Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses
- Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en periodos consecutivos inmediatos anteriores.
- Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho período no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses.
- Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 25 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
- b) se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen lo siguiente:

- a) el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración, y

- b) el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen siguiente:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración
  - b) se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
  - c) se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueva y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del periodo de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección "Etapa 3" de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de "Etapa 3".

-Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.

-Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

-Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

-Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

-Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

- a) Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.
- b) Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
- c) En el caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los periodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de periodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a periodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

En los casos de los créditos adquiridos al INFONAVIT, el Banco está obligado a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando ocurra alguno de los siguientes supuestos:

- a) El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,
- b) Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

- a) El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;
  - b) Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y
  - c) La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.
-



---

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los periodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha hasta acreditar pago sostenido y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

En todo caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse de que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, deberá tener a disposición de la Comisión evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener es lo que se señala a continuación:

- a) probabilidad de incumplimiento intrínseca del acreditado,
- b) las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- c) la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- d) la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de "Ingresos por intereses", así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de "Gastos por intereses".

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

1. Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.
2. Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.
3. Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del periodo, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada periodo.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 29 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

crédito pueden ser confiablemente estimados; sin embargo, en aquellos casos en que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, previa autorización del Comité de Crédito.

El Banco considera que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito son confiablemente estimados en la mayoría de las circunstancias, sin embargo, en aquellos casos en que no es posible estimarlos confiablemente, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, lo cual es autorizado por el comité de crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un periodo de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(n) Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

(o) Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 30 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

a) El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).

b) Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determina conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales ordenadas por la Comisión, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

- a) origen de las estimaciones;
- b) metodología para su determinación;
- c) monto de estimaciones por constituir, y
- d) tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

- I. Entidades federativas y municipios.
  - II. Proyectos con fuente de pago propia.
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 31 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

III. Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

IV. Entidades Financieras.

V. Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

a) Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

b) Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA, ix) prórroga.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 32 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y (xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación:

Rangos de porcentaje de estimación preventiva

GradoConsumo

de riesgoNo RevolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial

DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%0.90%

A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%

B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 33 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%  
B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%  
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%  
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%  
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%  
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3r.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

(p)Otras cuentas por cobrar, neto

Se integra de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 34 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro-

El Banco constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por las cuentas por cobrar conforme a lo que se muestra a continuación:

Origen de la cuenta por cobrar Criterio de reconocimiento de la estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro

Cuentas liquidadoras. Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar directamente relacionadas con la cartera de crédito, tales como gastos de juicio. Se aplica el mismo porcentaje de riesgo asignado para el crédito asociado para la constitución de la estimación.

Documentos de cobro inmediato no cobrados con 15 o más días naturales de haber sido registrados como "Otras cuentas por cobrar, neto". Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro. Se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Préstamos a funcionarios y empleados, derechos de cobro y otras cuentas por cobrar diversas pactadas desde su origen. El Banco determina un grado de irrecuperabilidad con base en su experiencia de pérdidas crediticias pasadas, cambios actuales en el comportamiento de sus clientes y previsiones económicas futuras, para lo cual clasifica sus cuentas por cobrar por grado de atraso en pago y asigna diferentes montos de PCE a cada uno de los segmentos de sus cuentas por cobrar.

Amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas en 30 días naturales posteriores a su vencimiento. Se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar distintas a las anteriores de deudores no identificados con 60 días o más de haber sido registrados. Se constituye una estimación por el importe total.

No se reconoce estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro sobre los saldos de impuestos a favor ni por el Impuesto al Valor Agregado (IVA) acreditable.

(q) Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 35 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para dismantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Banco determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

- pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;
  - pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;
  - importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y
  - el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté
-



---

razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar cuando hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa, si hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual, si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o si hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro "Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(r) Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

- a) al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o
- b) al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 37 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

## Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como "Otros ingresos (egresos) de la operación".

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como "Otros ingresos (egresos) de la operación". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra a continuación:

## Porcentaje de reserva

Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago Bienes inmuebles Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores

Hasta 6 meses 0%0%

Más de 6 y hasta 12 10%

Más de 12 y hasta 18 20%

Más de 18 y hasta 24 45%

Más de 24 y hasta 30 60%

Más de 30 y hasta 36 100%

Más de 36 y hasta 42 100%

Más de 42 y hasta 48 100%

Más de 48 y hasta 54 100%

Más de 54 y hasta 60 100%

Más de 60 100%

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

## Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

(s) Propiedades, mobiliario y equipo

Las propiedades, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de las propiedades, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de las propiedades, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

## (t) Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros consolidados a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

Al 31 de diciembre de 2022, no se reconocieron pérdidas por deterioro en las otras inversiones permanentes.

## (u) Activos de larga duración disponibles para su venta

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
  - b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
  - c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 39 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(v) Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

El impuesto a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad y PTU diferidos (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas, y en el caso de impuestos a la utilidad, por las pérdidas fiscales por amortizar y otros créditos fiscales por recuperar.

Los activos y pasivos por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de "Otros activos", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Beneficios a empleados" en el estado de situación financiera consolidado.

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso una reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" en el estado consolidado de resultado integral.

(w) Otros activos

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(x) Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

a) Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una estimación de irrecuperabilidad por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

b) Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

c) Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

d) Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por pagar" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 41 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como un cargo o crédito diferido, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

(y) Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación reúnen las características establecidas por la NIF C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el principal del instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

(z) Préstamos interbancarios y de otros organismos

En este rubro se registran los préstamos directos de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento. Asimismo, incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 42 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

(aa) Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

(bb) Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (v) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 43 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 20).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

(cc)Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren en un período de 12 a 360 meses, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

(dd) Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

(ee) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

(ff)Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

-Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Banco que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

-Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

- Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitado (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la administración de cada fideicomiso.

- Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Banco.

Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el periodo en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio fideicomitado.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Banco existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Banco.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 46 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

-Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

-Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

-Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

-Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3, el monto de los intereses devengados no cobrados derivados de los créditos que se mantengan en cartera con riesgo de crédito Etapa 3.

-Otras cuentas de registro:

Al 31 de diciembre de 2022, las otras cuentas de registro presentan un saldo de \$1,669,462 que se integran principalmente por guardavalores por el Banco.

(gg)Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 47 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

(3) Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2023

En diciembre de 2022 el CINIF emitió el documento llamado "Mejoras a las NIF 2023", que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes. Las principales mejoras no generaron cambios contables para el Banco.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditos Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Acumulado Actual (Cifras en pesos) Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje] Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro] Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje] Tipo de Crédito / Institución Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Desglose de créditos [partidas] Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - - - -  
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - - -  
Banca comercial  
Export Development Canada (EDC) Si 08/07/2020 06/08/2023 5.16543 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD LIBOR 6M 1,759,474,142.33  
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 22/08/2022 21/08/2023 5.12936 + 0.71 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,583,997,358.34  
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 21/10/2022 20/10/2023 5.0555 + 0.78 SPREAD / VARIABLE USD TSOFR 3M 1,731,258,176.64  
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/05/2023 30/05/2024 5.22528 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,150,642,233.15  
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/05/2023 29/02/2024 5.22528 + 0.56 / VARIABLE USD TERM SOFR 1,720,361,647.85

TOTAL - - - - - - - 6,074,729,677.31 3,871,003,881.01 - - -

Otros bancarios  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C. No 20/03/2020 20/02/2024 11.4274 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,500,827,951.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C. No 20/03/2020 20/03/2024 11.4274 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 48 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

TIEE 28D EOM 2,500,827,951.39	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/202411.4274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN	
TIEE 28D EOM 2,500,822,395.83	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202411.4274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN	
TIEE 28D EOM 2,500,822,395.83	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/201925/07/202411.4274 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN	
TIEE 28D EOM 2,500,822,395.83	
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0	
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,005,417,777.78	
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0	
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,017,520,833.33	
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo29/08/201823/08/20238.89 + 0	
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,547,783,750.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa	
Fija 51,059,062.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa	
Fija 66,425,354.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa	
Fija 11,922,274.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa	
Fija 29,473,802.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa	
Fija 7,016,622.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa	
Fija 59,408,732.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/02/202711.5975	
Tasa Fija 73,734,950.41	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/202711.6032	
Tasa Fija 38,589,757.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa	
Fija 27,134,092.87	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.75 Tasa	
Fija 20,275,266.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202611.7532	
Tasa Fija 11,871,327.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202215/05/202611.5995	
Tasa Fija 1,465,851.48	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.7733	
Tasa Fija 16,136,047.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.73 Tasa	
Fija 44,806,481.46	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202224/06/202611.7355	
Tasa Fija 61,794,938.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.7733	
Tasa Fija 20,590,268.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202224/06/202611.7355	
Tasa Fija 15,039,152.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/202206/07/202311.5925	
Tasa Fija 18,756,037.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.71731	
Tasa Fija 8,818,733.65	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.71731	
Tasa Fija 9,760,540.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202204/08/202311.5925	
Tasa Fija 18,756,037.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202225/08/202311.5925	

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

## NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN FINANCIERA

PAGINA 49 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 18,756,037.76  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202215/02/202411.6495  
Tasa Fija 714,792.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202228/08/202611.7425  
Tasa Fija 26,133,521.47  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202208/09/202311.5925  
Tasa Fija 15,004,830.21  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202215/09/202611.7495  
Tasa Fija 4,900,457.25  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202215/09/202311.5925  
Tasa Fija 15,004,830.21  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202206/09/202311.6 Tasa  
Fija 3,024,166.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7745  
Tasa Fija 136,692,695.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7745  
Tasa Fija 5,325,689.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7745  
Tasa Fija 106,513,788.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/09/202218/09/202311.6032  
Tasa Fija 5,019,338.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.7732  
Tasa Fija 136,560,917.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/10/202231/07/202311.7424  
Tasa Fija 7,378,869.46  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202231/10/202311.5925  
Tasa Fija 2,000,644.03  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.7625  
Tasa Fija 23,657,626.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/11/202216/12/202210.8 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202216/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/11/202201/12/202211.37 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/11/202216/12/202211.385 Tasa Fija  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/11/202216/12/202211.3957 Tasa Fija  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.53923  
Tasa Fija 71,175,292.09  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202230/11/202311.5925  
Tasa Fija 20,840,041.93  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202205/07/20235.61249  
Tasa Fija 25,676,949.43  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202217/07/202311.6032  
Tasa Fija 898,461.62  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 5,808,994.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 20,034,546.34  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa  
Fija 54,904,345.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202231/08/20235.53617  
Tasa Fija 132,011,782.42  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.7495  
Tasa Fija 10,537,696.31  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/202224/07/20235.41043

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 50 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 25,700,375.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202304/07/202311.6033  
Tasa Fija 13,108,942.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202303/07/202312.8975 Tasa Fija 726,347.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 899,594.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 53,170.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 100,955.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 79,368.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/01/202304/07/202312.8975 Tasa Fija 269,147.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202304/07/202312.9318 Tasa Fija 93,055.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202305/07/202312.9286 Tasa Fija 2,407,209.87  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202303/07/202311.6033  
Tasa Fija 5,041,900.81  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/01/202304/07/202311.6033  
Tasa Fija 5,041,900.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202307/07/202312.9195 Tasa Fija 373,956.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202305/07/202311.6033  
Tasa Fija 5,041,900.81  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202305/07/202311.6033  
Tasa Fija 10,083,801.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202311/07/202312.9406 Tasa Fija 99,212.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202306/07/202311.6 Tasa  
Fija 5,040,277.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202307/07/202311.598  
Tasa Fija 5,038,660.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202307/07/202311.598  
Tasa Fija 5,038,660.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202310/07/202312.9284 Tasa Fija 613,540.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202311/07/202312.9284 Tasa Fija 31,229.83  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202312/07/202311.6125  
Tasa Fija 5,030,644.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202315/08/20235.36249  
Tasa Fija 42,795,373.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202311/07/202312.9427 Tasa Fija 130,905.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202311/07/202312.9613 Tasa Fija 10,261.01  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202318/07/202311.6032  
Tasa Fija 7,027,074.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202304/07/202312.9613 Tasa Fija 44,357.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 91,745.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 37,764.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202317/07/202312.9572 Tasa Fija 98,596.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 17,109.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202306/07/202312.9572 Tasa Fija 859,821.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 611,765.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202319/07/202312.9572 Tasa Fija 1,057,248.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202318/07/202312.9572 Tasa Fija 59,892.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202313/07/202312.9572 Tasa Fija 1,643,996.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/07/202312.9427 Tasa Fija 10,744,972.96  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202319/07/202312.9427 Tasa Fija 414,634.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202318/07/202312.9427 Tasa Fija 10,784.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/01/202318/07/202312.9427 Tasa Fija 124,297.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202321/07/202312.9638 Tasa Fija 762,053.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.6925  
Tasa Fija 10,003,247.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202323/08/20235.29775  
Tasa Fija 34,568,709.36

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 51 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/01/202321/07/20235.28775  
Tasa Fija 17,721,875.29

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202325/07/202311.608  
Tasa Fija 6,009,673.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202306/07/202312.9884 Tasa Fija 466,884.77

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 125,603.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 19,808.40

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 8,504.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202325/07/202313.0096 Tasa Fija 9,876.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202320/07/202313.0096 Tasa Fija 5,069,458.42

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202320/07/202313.0096 Tasa Fija 1,109,923.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/01/202326/07/202311.608  
Tasa Fija 1,000,644.89

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/01/202326/07/202311.5925  
Tasa Fija 25,008,050.35

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/01/202325/07/202311.608  
Tasa Fija 4,005,159.11

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/01/202328/07/202311.5855  
Tasa Fija 5,004,827.29

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/01/202328/07/202311.5925  
Tasa Fija 25,008,050.35

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202324/07/202313.0085 Tasa Fija 493,197.71

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/01/202328/07/202311.5855  
Tasa Fija 5,004,827.29

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202328/07/202313.0264 Tasa Fija 8,763,895.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202304/07/202313.0264 Tasa Fija 44,406.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/02/202327/07/202311.6005  
Tasa Fija 3,001,933.42

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/02/202301/08/202311.5966  
Tasa Fija 5,048,319.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202325/07/202313.0056 Tasa Fija 325,935.70

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202301/08/202312.9936 Tasa Fija 395,519.69

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/02/202302/08/202311.604  
Tasa Fija 5,046,738.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202301/08/202312.9936 Tasa Fija 47,077.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 1,031,301.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 4,606,141.85

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/02/202303/08/202311.6033  
Tasa Fija 5,041,900.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202327/07/202312.984 Tasa Fija 574,554.55

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/02/202307/08/202311.598  
Tasa Fija 5,038,660.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202307/08/202311.598  
Tasa Fija 5,038,660.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202307/08/202313.0541 Tasa Fija 73,368.97

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202307/08/202313.0541 Tasa Fija 1,851,850.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 49,485.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 16,649.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202304/07/202313.0541 Tasa Fija 13,319.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202308/08/202311.6015  
Tasa Fija 5,037,060.35

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/02/202309/08/202311.609  
Tasa Fija 5,035,471.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202324/07/202313.0875 Tasa Fija 231,277.18

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202327/07/202313.0875 Tasa Fija 601,895.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202311/07/202313.0875 Tasa Fija 233,548.38

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 52 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202313/07/202313.0875	Tasa Fija	258,179.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202303/08/202313.0875	Tasa Fija	7,503,291.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/02/202310/08/202311.6125	Tasa Fija	5,030,644.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202308/08/202313.3822	Tasa Fija	250,765.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202303/08/202313.3822	Tasa Fija	180,713.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202311/08/202311.6125	Tasa Fija	5,030,644.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202304/08/202313.5356	Tasa Fija	229,522.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.6925	Tasa Fija	14,004,547.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202314/08/202311.5975	Tasa Fija	5,027,382.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202301/08/202313.5244	Tasa Fija	211,412.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202304/07/202313.5244	Tasa Fija	346,705.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202304/08/202311.6033	Tasa Fija	17,142,462.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/08/202311.5975	Tasa Fija	22,120,485.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.6925	Tasa Fija	10,003,247.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202315/08/202311.5995	Tasa Fija	5,025,776.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/02/202315/08/202311.5995	Tasa Fija	22,113,417.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202307/07/202313.4808	Tasa Fija	48,926.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202316/08/202311.598	Tasa Fija	6,028,995.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202310/08/202313.5019	Tasa Fija	5,822,973.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202318/08/202311.6032	Tasa Fija	5,019,338.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202306/07/202313.5019	Tasa Fija	153,225.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202314/08/202313.5566	Tasa Fija	1,204,729.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202321/05/202411.5925	Tasa Fija	10,003,220.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202317/08/202313.5566	Tasa Fija	120,377.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202315/02/202411.5995	Tasa Fija	4,020,621.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202318/01/202411.6032	Tasa Fija	3,011,603.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202321/08/202313.5566	Tasa Fija	278,184.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202322/08/202311.6045	Tasa Fija	6,017,406.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202310/08/202313.5449	Tasa Fija	666,355.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202321/09/202311.6067	Tasa Fija	50,161,204.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202314/07/202313.5975	Tasa Fija	61,168.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202312/01/202411.6125	Tasa Fija	8,832,755.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202320/07/202313.5975	Tasa Fija	122,177.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202317/08/202313.5975	Tasa Fija	4,336,783.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/02/202331/07/202311.6057	Tasa Fija	7,733,651.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202317/08/202313.5763	Tasa Fija	1,532,635.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202317/08/202313.5763	Tasa Fija	701,616.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202325/08/202311.608		

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 53 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 8,012,897.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202324/08/202311.608  
Tasa Fija 8,012,897.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202318/07/202313.625 Tasa Fija 31,872.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202329/08/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202321/07/202313.6215 Tasa Fija 53,641.30  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202330/08/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202329/09/202311.5962  
Tasa Fija 700,450.96  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202324/08/202313.6215 Tasa Fija 8,267,660.05  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202303/03/202810.73 Tasa  
Fija 30,232,483.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/03/202330/08/202311.5925  
Tasa Fija 3,000,966.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202301/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202329/08/202313.5967 Tasa Fija 21,527.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202318/07/202313.5967 Tasa Fija 99,340.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202317/08/202313.5967 Tasa Fija 335,004.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202325/07/202313.5967 Tasa Fija 73,017.34  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202314/08/202311.5925  
Tasa Fija 10,003,220.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202301/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202315/08/202311.5925  
Tasa Fija 10,003,220.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202306/07/202311.6 Tasa  
Fija 604,833.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202304/07/202312.726 Tasa Fija 177,533.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202316/08/202311.5925  
Tasa Fija 10,003,220.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/09/202311.6033  
Tasa Fija 2,520,950.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202328/07/202313.6328 Tasa Fija 1,664,962.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202329/08/202313.6328 Tasa Fija 1,033,113.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202301/09/202313.6328 Tasa Fija 299,054.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202304/07/202311.5925  
Tasa Fija 8,002,576.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202305/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202307/07/202311.598  
Tasa Fija 1,007,732.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202324/08/202313.6994 Tasa Fija 1,080,710.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202305/09/202311.6033  
Tasa Fija 2,520,950.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202305/07/202312.725 Tasa Fija 307,924.27  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202317/08/202311.5925  
Tasa Fija 10,003,220.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/202322/05/202411.5925  
Tasa Fija 14,004,508.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202306/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 54 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202307/07/202311.598  
Tasa Fija 1,007,732.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202307/07/202312.727 Tasa Fija 11,054.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 12,995,930.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/09/202313.7418 Tasa Fija 30,021.01  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202306/09/202311.6 Tasa  
Fija 2,520,138.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202306/07/202312.727 Tasa Fija 48,938.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 547,240.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 1,060,117.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202331/08/202313.7418 Tasa Fija 3,177,403.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 1,352,947.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 864,609.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 64,843.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202331/08/202313.7418 Tasa Fija 393,168.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 18,106.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202303/07/202312.727 Tasa Fija 154,128.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202305/07/202312.727 Tasa Fija 49,050.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202308/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202307/07/202312.7365 Tasa Fija 218,324.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202303/07/202312.7365 Tasa Fija 540,224.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/07/202312.7365 Tasa Fija 36,225.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202305/07/202312.7365 Tasa Fija 3,917.66  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/03/202307/09/202311.598  
Tasa Fija 1,704,074.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202303/07/202312.7365 Tasa Fija 111,754.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202308/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202305/07/202312.738 Tasa Fija 31,114.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202324/05/202411.5925  
Tasa Fija 11,003,542.15  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202308/09/202311.6015  
Tasa Fija 2,463,122.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202303/07/202312.738 Tasa Fija 116,639.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202308/09/202313.6279 Tasa Fija 350,905.27  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202313/07/202311.6075  
Tasa Fija 1,005,803.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202312/07/202312.746 Tasa Fija 171,996.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 12,328.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202321/08/202313.4717 Tasa Fija 365,185.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 101,054.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202301/08/202313.4717 Tasa Fija 101,963.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202331/08/202313.4717 Tasa Fija 3,236,107.51  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.6125  
Tasa Fija 2,515,322.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202305/07/202312.746 Tasa Fija 318,225.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202313/07/202312.746 Tasa Fija 4,152,951.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202311/09/202311.5925  
Tasa Fija 8,502,737.12  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202314/07/202311.5975  
Tasa Fija 1,005,476.60  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.5925  
Tasa Fija 5,001,610.07

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 55 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202328/07/202312.9665	Tasa Fija	4,528,088.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.6125	Tasa Fija	2,515,322.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202303/07/202312.763	Tasa Fija	289,660.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763	Tasa Fija	97,510.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763	Tasa Fija	139,867.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202311/09/202313.4665	Tasa Fija	282,253.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202312/09/202311.5925	Tasa Fija	15,004,830.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/07/202312.763	Tasa Fija	492,467.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/07/202312.763	Tasa Fija	11,734.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763	Tasa Fija	106,935.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202307/09/202313.4665	Tasa Fija	3,120,083.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202305/07/202312.763	Tasa Fija	17,596.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202314/07/202311.5975	Tasa Fija	1,005,476.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202310/07/202312.7699	Tasa Fija	723,746.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202305/07/202312.7699	Tasa Fija	856,665.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/09/202313.4665	Tasa Fija	36,360.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202313/09/202311.5925	Tasa Fija	11,503,703.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202307/07/202312.7699	Tasa Fija	1,033.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202310/07/202312.7699	Tasa Fija	1,086,014.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/07/202312.7699	Tasa Fija	148,325.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202305/07/202312.7699	Tasa Fija	160,294.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202312/09/202313.4665	Tasa Fija	96,334.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202314/07/202311.5925	Tasa Fija	4,501,449.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202304/08/202313.3933	Tasa Fija	16,811.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202331/08/202313.3933	Tasa Fija	187,052.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202307/09/202313.3933	Tasa Fija	3,034,973.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749	Tasa Fija	262,785.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202312/07/202312.7749	Tasa Fija	399,827.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749	Tasa Fija	252,254.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749	Tasa Fija	46,960.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587	Tasa Fija	276,812.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749	Tasa Fija	652,206.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202305/07/202312.7749	Tasa Fija	657,950.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587	Tasa Fija	9,076.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202306/07/202312.7749	Tasa Fija	58,362.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202310/07/202312.7749	Tasa Fija	48,103.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202307/09/202313.4587	Tasa Fija	360,200.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202314/09/202311.5975	Tasa Fija	316,725,128.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.5995	Tasa Fija	60,309,320.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.5995	Tasa Fija	26,134,038.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202315/09/202311.5995	Tasa Fija	30,154,660.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202320/07/202311.5995	Tasa Fija	1,003,544.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202307/07/202312.7774	Tasa Fija	22,499.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202319/07/202312.7774	Tasa Fija	1,869,115.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774	Tasa Fija	8,646.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202310/07/202312.7774	Tasa Fija	6,056.85

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 56 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202319/07/202312.7774	Tasa Fija	106,048.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774	Tasa Fija	105,913.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202305/07/202312.7774	Tasa Fija	88,222.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202317/05/202411.5925	Tasa Fija	10,003,220.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202318/09/202311.6032	Tasa Fija	27,104,428.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202318/09/202311.6032	Tasa Fija	2,459,475.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202321/07/202311.6067	Tasa Fija	1,003,224.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785	Tasa Fija	17,838.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785	Tasa Fija	12,334.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202305/07/202312.785	Tasa Fija	49,337.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202319/09/202311.6032	Tasa Fija	2,389,205.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202314/07/202312.785	Tasa Fija	69,432.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202308/09/202313.4671	Tasa Fija	193,308.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202321/07/202311.6067	Tasa Fija	1,003,224.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024	Tasa Fija	375,316.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024	Tasa Fija	4,763,112.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202313/07/202312.8024	Tasa Fija	479,963.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325	Tasa Fija	4,853,033.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202320/09/202311.5995	Tasa Fija	2,508,860.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202317/07/202312.8024	Tasa Fija	381,713.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024	Tasa Fija	2,673,380.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202305/07/202312.8024	Tasa Fija	518,709.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325	Tasa Fija	189,759.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202307/07/202312.8024	Tasa Fija	44,059.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325	Tasa Fija	1,428,138.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202315/09/20235.66432	Tasa Fija	4,356,831.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202317/07/202312.8024	Tasa Fija	1,120,515.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/07/202312.8024	Tasa Fija	278,524.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202305/07/202312.8024	Tasa Fija	12,335.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202319/09/202313.4325	Tasa Fija	198,170.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202314/09/202313.4325	Tasa Fija	2,099,516.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202312/09/202313.4325	Tasa Fija	52,018.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049	Tasa Fija	517,722.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202321/07/202312.8049	Tasa Fija	261,726.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049	Tasa Fija	1,957,816.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202317/07/202312.8049	Tasa Fija	756,959.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049	Tasa Fija	18,467.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049	Tasa Fija	346.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049	Tasa Fija	193,080.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202324/08/202313.464	Tasa Fija	10,117.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/03/202325/07/202311.5925	Tasa Fija	2,500,805.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/07/202312.8049	Tasa Fija	220,620.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049	Tasa Fija	166,660.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/03/202321/09/202311.6067	Tasa Fija	1,504,836.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202319/07/202312.8049	Tasa Fija	4,119.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202305/07/202312.8049	Tasa Fija	49,347.92

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 57 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202314/09/202313.464	Tasa Fija	847,695.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202304/08/202313.464	Tasa Fija	1,394,651.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202310/07/20236.1946	Tasa Fija	94,612.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202315/05/202411.5925	Tasa Fija	10,003,220.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202320/07/202312.8224	Tasa Fija	98,641.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202317/07/202312.8224	Tasa Fija	56,990.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	224,672.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/03/202322/09/202311.6045	Tasa Fija	1,579,569.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	78,768.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	28,259.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	273,669.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	364,679.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202305/07/202312.8224	Tasa Fija	1,121,332.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202308/09/202313.4743	Tasa Fija	845,166.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202317/07/20236.05984	Tasa Fija	34,604.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202327/07/202311.6005	Tasa Fija	1,001,288.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202325/07/202312.8235	Tasa Fija	436,581.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/03/202325/09/202311.608	Tasa Fija	1,752,821.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202305/07/202312.8235	Tasa Fija	63,894.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202305/07/202312.8235	Tasa Fija	339,351.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202322/09/202313.5121	Tasa Fija	319,902.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202317/07/202312.8235	Tasa Fija	29,748.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202322/09/202313.5121	Tasa Fija	3,206,485.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202315/08/202313.5121	Tasa Fija	10,598.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.608	Tasa Fija	1,752,821.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.608	Tasa Fija	1,502,418.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202328/07/202311.5855	Tasa Fija	400,386.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202321/07/202312.8399	Tasa Fija	828,620.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/07/202312.8399	Tasa Fija	69,337.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202326/07/202312.8399	Tasa Fija	61,655.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399	Tasa Fija	4,120.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202321/07/202312.8399	Tasa Fija	513,432.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399	Tasa Fija	206,061.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202305/07/202312.8399	Tasa Fija	24,678.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202319/07/202312.8399	Tasa Fija	232,592.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/03/202326/09/202311.608	Tasa Fija	13,020,958.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202328/07/202311.5855	Tasa Fija	1,000,965.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202310/07/20236.26464	Tasa Fija	193,892.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202327/09/202311.6005	Tasa Fija	1,752,255.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202326/07/202312.8474	Tasa Fija	176,568.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202328/07/202312.8474	Tasa Fija	2,065,664.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474	Tasa Fija	91,212.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202327/09/202311.6005	Tasa Fija	1,752,255.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202317/07/202312.8474	Tasa Fija	87,227.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474	Tasa Fija	106,440.96

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 58 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474	Tasa Fija	140,333.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202315/08/202313.5104	Tasa Fija	53,152.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202304/08/202313.5104	Tasa Fija	326,419.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202318/07/202312.8474	Tasa Fija	121,300.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202324/07/202312.8474	Tasa Fija	2,294,329.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202326/07/202312.8474	Tasa Fija	66,448.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202314/07/202312.8474	Tasa Fija	78,955.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474	Tasa Fija	86,514.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202324/07/202312.8474	Tasa Fija	45,890.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202305/07/202312.8474	Tasa Fija	18,465.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/03/202321/09/202313.5104	Tasa Fija	5,538,073.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/04/202328/09/202311.5855		Tasa Fija	1,751,689.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202324/07/202312.8835	Tasa Fija	233,002.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	93,256.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202324/07/202312.8835	Tasa Fija	2,098,717.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	134,682.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	120,302.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	33,220.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202318/08/202313.4607	Tasa Fija	159,778.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	260,229.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/04/202325/09/202311.608		Tasa Fija	5,008,061.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/04/202328/09/202311.5855		Tasa Fija	1,501,448.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202301/08/202312.8835	Tasa Fija	196,105.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202305/07/202312.8835	Tasa Fija	37,025.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/04/202326/09/202313.4607	Tasa Fija	56,551.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202329/09/202311.5962		Tasa Fija	1,751,127.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202329/09/202311.5962		Tasa Fija	1,751,127.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	47,442.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	209,773.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	1,557.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	485,049.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202326/09/202311.608		Tasa Fija	5,008,061.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202326/09/202313.4862	Tasa Fija	313,759.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	87,046.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	1,014,436.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202305/07/202312.885	Tasa Fija	97,354.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202304/08/202313.4862	Tasa Fija	12,604.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202304/08/202313.4862	Tasa Fija	691,602.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202304/08/202313.4862	Tasa Fija	1,145,495.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/04/202303/07/202312.885	Tasa Fija	207,000.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202329/09/202311.5962		Tasa Fija	2,544,169.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202302/10/202311.604		Tasa Fija	1,766,358.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202302/10/202311.604		Tasa Fija	1,766,358.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202301/11/202311.5966		Tasa Fija	2,100,100.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202324/07/202312.8875	Tasa Fija	35,780.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202305/07/202312.8875	Tasa Fija	161,378.01

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 59 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202329/09/202313.4967	Tasa Fija	2,373,987.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202328/09/202313.4967	Tasa Fija	1,125,632.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202331/07/202312.8875	Tasa Fija	3,172,484.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202331/07/202312.8875	Tasa Fija	651,125.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202305/07/202312.8875	Tasa Fija	148,958.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202331/07/202312.8875	Tasa Fija	218,282.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/04/202305/07/202312.8875	Tasa Fija	124,071.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202306/10/202311.6		Tasa Fija	1,764,097.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202306/10/202311.6		Tasa Fija	1,764,097.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202328/07/202312.8925	Tasa Fija	127,509.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202304/07/202312.8925	Tasa Fija	71,051.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202331/07/202312.8925	Tasa Fija	525,372.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202302/08/202312.8925	Tasa Fija	39,698.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202305/07/202312.8925	Tasa Fija	84,663.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202304/08/202312.8925	Tasa Fija	212,721.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202304/08/202312.8925	Tasa Fija	398,090.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202304/08/202312.8925	Tasa Fija	7,810.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202321/07/202312.8925	Tasa Fija	206,982.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202321/07/202312.8925	Tasa Fija	621,031.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202303/07/202312.8925	Tasa Fija	128,301.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202305/07/202312.8925	Tasa Fija	12,346.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/04/202305/07/202312.8925	Tasa Fija	792,448.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202310/07/202311.6125		Tasa Fija	352,145.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202314/07/202312.895	Tasa Fija	164,929.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202324/07/202312.895	Tasa Fija	114,222.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	18,542.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	70,803.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	84,995.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202326/09/202313.5078	Tasa Fija	9,336.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202329/09/202313.5078	Tasa Fija	69,044.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202321/09/202313.5078	Tasa Fija	789,867.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202327/09/202311.6005		Tasa Fija	5,006,444.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202331/07/202312.895	Tasa Fija	613,603.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	76,790.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	160,514.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202304/08/202312.895	Tasa Fija	18,985.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/04/202305/07/202312.895	Tasa Fija	107,008.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202305/07/202312.8857	Tasa Fija	11,719.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202328/09/202311.5855		Tasa Fija	5,004,827.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202306/07/202312.8857	Tasa Fija	17,659.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202305/07/202312.8857	Tasa Fija	12,348.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202315/08/202313.5587	Tasa Fija	19,053.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202331/07/202312.8857	Tasa Fija	34,690.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202304/08/202312.8857	Tasa Fija	6,260.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202304/08/202312.8857	Tasa Fija	38,060.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202307/09/202313.5587	Tasa Fija	624,049.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202331/03/20285.95249		Tasa Fija	67,248,325.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/04/202305/07/202312.8857	Tasa Fija	127,646.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202331/07/20236.37135	Tasa Fija	8,560.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202305/07/202312.8915	Tasa Fija	220,679.58



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 60 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202329/09/202313.5582	Tasa Fija	23,089.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202304/08/202312.8915	Tasa Fija	300,874.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202304/08/202312.8915	Tasa Fija	515,323.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202304/08/202312.8915	Tasa Fija	240,259.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202321/07/202312.8915	Tasa Fija	1,114,598.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202331/07/202312.8915	Tasa Fija	9,917.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202319/07/202312.8915	Tasa Fija	274,319.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202304/08/202312.8915	Tasa Fija	75,684.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202329/09/202313.5582	Tasa Fija	1,109,006.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202305/10/202313.5582	Tasa Fija	4,762,606.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202305/09/202313.5582	Tasa Fija	19,404.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/04/202305/09/202313.5582	Tasa Fija	398.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202311/08/202311.5925		Tasa Fija	10,003,220.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/04/202313/07/202311.6075		Tasa Fija	452,611.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/04/202311/08/202311.6125		Tasa Fija	1,006,128.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/04/202329/09/202311.5962		Tasa Fija	5,003,221.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202312/07/202312.897	Tasa Fija	527,915.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202303/08/202312.897	Tasa Fija	428,375.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202305/07/202312.897	Tasa Fija	18,470.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537	Tasa Fija	175,797.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202305/10/202313.537	Tasa Fija	1,003,730.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202305/10/202313.537	Tasa Fija	4,401,200.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/04/202311/10/202311.5925		Tasa Fija	15,004,830.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202303/08/202312.897	Tasa Fija	139,747.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202310/07/202312.897	Tasa Fija	26,801.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202305/07/202312.897	Tasa Fija	2,804.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202307/08/202312.897	Tasa Fija	4,816,334.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202309/08/202312.897	Tasa Fija	249,749.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202313/07/202312.897	Tasa Fija	824,262.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202305/07/202312.897	Tasa Fija	261,791.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202304/08/202312.897	Tasa Fija	377,154.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202325/09/202313.537	Tasa Fija	1,169,536.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537	Tasa Fija	21,213.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202328/09/202313.537	Tasa Fija	73,743.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537	Tasa Fija	9,919.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202309/08/202312.902	Tasa Fija	786,454.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202313/07/202312.902	Tasa Fija	80,688.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202307/08/202312.902	Tasa Fija	231,780.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202307/08/202312.902	Tasa Fija	507,340.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202304/08/202312.902	Tasa Fija	24,129.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202304/08/202312.902	Tasa Fija	7,414.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202306/10/202313.5294	Tasa Fija	1,047,634.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202305/09/202313.5294	Tasa Fija	113,798.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202314/07/202312.902	Tasa Fija	50,318.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202310/07/202312.902	Tasa Fija	405,153.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202304/08/202312.902	Tasa Fija	230,763.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202307/08/202312.902	Tasa Fija	117,616.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202304/08/202312.902	Tasa Fija	461,087.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202305/07/202312.902	Tasa Fija	100,328.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202328/08/202313.0294	Tasa Fija	10,073,130.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/04/202305/07/202312.902	Tasa Fija	541,565.49

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 61 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202309/08/202312.902	Tasa Fija	24,349.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/04/202317/07/202311.6032		
Tasa Fija		401,547.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202311/08/202312.907	Tasa Fija	940,235.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202309/08/202312.907	Tasa Fija	381,526.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202303/07/202312.907	Tasa Fija	238,562.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202307/08/202312.907	Tasa Fija	198,584.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202319/07/202312.907	Tasa Fija	11,002.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202304/08/202312.907	Tasa Fija	86,302.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202304/08/202312.907	Tasa Fija	26,226.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202304/08/202312.907	Tasa Fija	380,375.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202304/08/202312.907	Tasa Fija	588,249.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202305/07/202312.907	Tasa Fija	1,198,932.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202315/08/202312.899	Tasa Fija	437,382.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202307/08/202312.899	Tasa Fija	106,949.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	117,081.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202313/10/202313.0402	Tasa Fija	28,231,710.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202310/10/202313.5402	Tasa Fija	2,652.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202305/09/202313.5402	Tasa Fija	5,994.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202309/08/202312.899	Tasa Fija	309,787.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202307/07/202312.899	Tasa Fija	310,009.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	935.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	94,271.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	60,702.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202307/08/202312.899	Tasa Fija	57,842.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	89,862.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202304/08/202312.899	Tasa Fija	27,425.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202305/07/202312.899	Tasa Fija	374,331.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202305/07/202312.899	Tasa Fija	38,392.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202307/08/20236.46809	Tasa Fija	30,406.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/04/202318/08/202311.6032		
Tasa Fija		1,003,867.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202303/07/202312.8949	Tasa Fija	7,378.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202314/07/202312.8949	Tasa Fija	109,736.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202324/07/202312.8949	Tasa Fija	8,809.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202313/10/202313.5272	Tasa Fija	541,591.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202316/10/202313.5272	Tasa Fija	28,861.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202310/10/202313.5272	Tasa Fija	2,652.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202308/08/202312.8949	Tasa Fija	1,891.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202310/10/202313.5272	Tasa Fija	19,645.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202316/08/202312.8949	Tasa Fija	32,057.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202317/07/202312.8949	Tasa Fija	205,855.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/04/202320/07/202311.5995		
Tasa Fija		451,594.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202311/08/202312.8999	Tasa Fija	637,311.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202311/08/202312.8999	Tasa Fija	780,902.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202319/07/202312.8999	Tasa Fija	93,576.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202317/10/202313.5505	Tasa Fija	451,478.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/04/202318/08/202311.6032		
Tasa Fija		1,003,867.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/04/202318/08/202311.6032		
Tasa Fija		1,003,867.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202313/07/202312.8999	Tasa Fija	51,041.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202314/08/202312.8999	Tasa Fija	319,779.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202316/08/202312.8999	Tasa Fija	28,428.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202314/08/202312.8999	Tasa Fija	574,078.99

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 62 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202311/07/202312.8999	Tasa Fija	117,262.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202328/07/202312.8999	Tasa Fija	103,481.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202314/08/202312.8999	Tasa Fija	3,828,618.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202317/07/202312.8999	Tasa Fija	204,907.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202314/08/202312.8999	Tasa Fija	367,245.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202318/08/202311.6032	Tasa Fija	1,003,867.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202329/09/202311.7424	Tasa Fija	4,292,922.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202311/08/202312.9049	Tasa Fija	1,010,150.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202318/08/202312.9049	Tasa Fija	183,244.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202314/08/202312.9049	Tasa Fija	184,454.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202316/08/202312.9049	Tasa Fija	241,464.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202304/08/202312.9049	Tasa Fija	857,838.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202316/08/202312.9049	Tasa Fija	134,769.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202304/08/202312.9049	Tasa Fija	398,845.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202304/08/202312.9049	Tasa Fija	417,965.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202305/07/202312.9049	Tasa Fija	108,552.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/04/202321/07/202311.6067	Tasa Fija	300,967.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/04/202321/07/202311.6067	Tasa Fija	200,644.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202316/08/202312.9049	Tasa Fija	50,429.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202304/08/202312.9049	Tasa Fija	300,850.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202321/07/202312.9049	Tasa Fija	288,204.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202304/08/202312.9049	Tasa Fija	85,450.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202305/09/202313.5399	Tasa Fija	1,568,012.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202317/10/202313.5399	Tasa Fija	75,749.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202317/10/202313.5399	Tasa Fija	9,896.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202307/08/20236.48834	Tasa Fija	54,374.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202328/07/202312.8949	Tasa Fija	56,874.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202323/08/202312.8949	Tasa Fija	371,018.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202314/08/202312.8949	Tasa Fija	66,826.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202317/10/202313.5392	Tasa Fija	10,471.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202304/08/202312.8949	Tasa Fija	11,911.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202304/08/202312.8949	Tasa Fija	373,064.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202323/08/202311.6	Tasa Fija	1,002,577.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202321/07/202312.8949	Tasa Fija	118,666.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202314/08/20236.48837	Tasa Fija	49,596.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202311/08/202312.8837	Tasa Fija	1,534,776.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202314/08/202312.8837	Tasa Fija	80,058.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202304/08/202312.8837	Tasa Fija	99,172.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202312/10/202313.5283	Tasa Fija	560,435.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202304/08/202312.8837	Tasa Fija	15,302.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202304/08/202312.8837	Tasa Fija	176,004.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202305/07/202312.8837	Tasa Fija	34,981.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202304/08/202312.8837	Tasa Fija	2,955.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202305/07/202312.8837	Tasa Fija	36,188.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202304/08/202312.8837	Tasa Fija	99,171.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202320/10/202313.5283	Tasa Fija	323,125.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202326/07/202311.608	Tasa Fija	450,725.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202325/07/202312.88	Tasa Fija	29,873.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202318/07/202312.88	Tasa Fija	225,525.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202304/08/202312.88	Tasa Fija	122,676.03

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 63 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202304/08/202312.88	Tasa Fija	604,147.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202304/08/202312.88	Tasa Fija	709,846.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202323/10/202313.4599	Tasa Fija	68,725.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202325/08/202311.608	Tasa Fija	10,016,122.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202325/08/202311.5925	Tasa Fija	1,500,483.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202311/08/202312.88	Tasa Fija	360,321.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202305/07/202312.88	Tasa Fija	42,773.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202325/08/202312.88	Tasa Fija	1,534,883.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202304/08/202312.88	Tasa Fija	120,512.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202323/10/202313.4599	Tasa Fija	78,900.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202312/10/202313.4599	Tasa Fija	2,319,355.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202319/09/202313.4599	Tasa Fija	43,212.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202319/10/202313.4599	Tasa Fija	4,892,748.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202325/08/202311.608	Tasa Fija	1,001,612.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202325/08/202311.608	Tasa Fija	1,001,612.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202318/08/202312.8712	Tasa Fija	756,870.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202317/08/202312.8712	Tasa Fija	21,196.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202314/08/202312.8712	Tasa Fija	115,973.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202320/07/202312.8712	Tasa Fija	514,429.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	93,456.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	122,359.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	465,061.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861	Tasa Fija	131,195.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202312/10/202313.4861	Tasa Fija	8,035.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202312/10/202313.4861	Tasa Fija	630,856.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202323/10/202311.7212	Tasa Fija	10,745,643.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202314/07/202312.8712	Tasa Fija	93,051.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/07/202312.8712	Tasa Fija	126,657.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202318/08/202312.8712	Tasa Fija	95,075.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/07/202312.8712	Tasa Fija	63,108.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202321/08/202312.8712	Tasa Fija	5,547,399.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202319/07/202312.8712	Tasa Fija	246,768.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	2,313,801.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/07/202312.8712	Tasa Fija	34,141.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	31,671.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	59,510.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	532,618.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202304/08/202312.8712	Tasa Fija	2,340.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861	Tasa Fija	43,151.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861	Tasa Fija	4,941.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202331/07/20236.21084	Tasa Fija	48,836.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202318/07/202312.8924	Tasa Fija	203,154.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202321/08/202312.8924	Tasa Fija	497,403.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202323/08/202312.8924	Tasa Fija	44,397.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202304/08/202312.8924	Tasa Fija	930,480.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202321/08/202312.8924	Tasa Fija	345,857.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202304/08/202312.8924	Tasa Fija	1,656,379.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202304/08/202312.8924	Tasa Fija	175,831.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202304/08/202312.8924	Tasa Fija	10,352.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202304/08/202312.8924	Tasa Fija	99,504.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202301/09/202313.4858	Tasa Fija	4,539.82

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 64 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202317/10/202313.4858	Tasa Fija	6,390.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202305/09/202313.4858	Tasa Fija	580,814.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202314/07/202312.8924	Tasa Fija	77,320.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202321/08/202312.8924	Tasa Fija	453,508.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202324/10/202313.4858	Tasa Fija	84,490.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/05/202324/10/202313.4858	Tasa Fija	9,874.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202321/07/20236.28929	Tasa Fija	20,298.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202321/08/202312.882	Tasa Fija	109,086.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202307/08/202312.882	Tasa Fija	6,478.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202329/09/202313.4846	Tasa Fija	12,756.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202305/09/202313.4846	Tasa Fija	579,487.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202305/09/202313.4846	Tasa Fija	184,218.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/05/202321/07/202312.882	Tasa Fija	173,846.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202314/07/20236.31141	Tasa Fija	793,183.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202318/08/202312.885	Tasa Fija	1,526,415.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202303/07/202312.704	Tasa Fija	8,523.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202325/08/202312.885	Tasa Fija	1,615,834.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	358,343.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202330/08/202312.885	Tasa Fija	309,814.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202321/08/202312.885	Tasa Fija	196,678.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	9,051.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	1,498,906.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	387,082.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202327/10/202313.4809	Tasa Fija	5,573,097.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202321/07/202312.885	Tasa Fija	207,946.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202325/08/202312.885	Tasa Fija	98,509.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202324/07/202312.885	Tasa Fija	96,796.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202318/07/202312.885	Tasa Fija	234,062.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	151,519.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202305/09/202313.4809	Tasa Fija	54,682.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202305/09/202313.4809	Tasa Fija	104,089.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202312/01/202411.6125		Tasa Fija	5,736,038.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202323/08/202312.885	Tasa Fija	154,976.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202305/07/202312.885	Tasa Fija	5,025,875.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/05/202304/08/202312.885	Tasa Fija	1,044,122.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202321/08/20236.42694	Tasa Fija	138,064.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202330/08/202312.9074	Tasa Fija	4,653.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202321/08/202312.9074	Tasa Fija	4,211.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202331/08/202312.9074	Tasa Fija	174,575.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202331/10/202313.4762	Tasa Fija	415,170.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074	Tasa Fija	31,333.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074	Tasa Fija	14,826.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	54,201.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	38,622.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074	Tasa Fija	28,276.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	15,311.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	42,068.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074	Tasa Fija	639.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	84,904.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	43,803.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	15,311.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	26,462.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/05/202305/07/202312.9074	Tasa Fija	64,483.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202301/09/202311.5966		Tasa Fija	1,009,663.83

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 65 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202301/09/202311.5966  
Tasa Fija 1,009,663.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202303/07/202312.7169 Tasa Fija 1,986.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202318/08/202312.9074 Tasa Fija 1,067,147.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202328/08/202312.9074 Tasa Fija 5,703,232.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202330/08/202312.9074 Tasa Fija 441,560.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074 Tasa Fija 48,857.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202331/10/202313.4762 Tasa Fija 122,399.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202305/09/202313.4762 Tasa Fija 76,681.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202305/09/202313.4762 Tasa Fija 105,410.74  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202331/10/202311.5925  
Tasa Fija 2,024,093.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202303/07/202312.7169 Tasa Fija 1,347,546.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202304/08/202312.9074 Tasa Fija 174,623.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202303/08/202311.6033  
Tasa Fija 504,190.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202303/07/20236.2727 Tasa Fija 714,310.32  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202301/11/202311.5966  
Tasa Fija 2,042,147.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202303/07/202312.7125 Tasa Fija 133,146.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202303/07/202312.7125 Tasa Fija 1,050,420.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202328/08/202312.8885 Tasa Fija 204,380.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202304/08/202312.8885 Tasa Fija 725,814.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202328/08/202312.8885 Tasa Fija 1,834,693.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202305/09/202312.8885 Tasa Fija 477,279.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202303/07/202312.7125 Tasa Fija 886,063.46  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202329/08/202312.8885 Tasa Fija 7,798,273.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202331/07/202312.8885 Tasa Fija 437,330.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202310/08/202312.8885 Tasa Fija 500,884.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202304/08/202312.8885 Tasa Fija 122,164.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202309/10/202313.454 Tasa Fija 321,356.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202326/10/202313.454 Tasa Fija 8,242,337.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202305/07/202312.7125 Tasa Fija 1,520,408.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202305/09/202312.8885 Tasa Fija 39,962.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202305/09/202312.8885 Tasa Fija 52,364.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202328/07/202312.8885 Tasa Fija 21,346.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202331/07/202312.8885 Tasa Fija 241,313.25  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202307/08/202311.598  
Tasa Fija 453,479.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202303/07/202312.712 Tasa Fija 20,882.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202328/07/202312.8825 Tasa Fija 299,361.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202305/09/202312.8825 Tasa Fija 319,845.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202331/07/202312.8825 Tasa Fija 77,395.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202318/08/202312.8825 Tasa Fija 10,011.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202323/08/202312.8825 Tasa Fija 154,800.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202317/08/202312.8825 Tasa Fija 275,773.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202305/09/202312.8825 Tasa Fija 162,168.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202305/09/202311.6033  
Tasa Fija 4,033,520.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202312/09/202313.4592 Tasa Fija 114,346.86  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202303/11/202311.6033  
Tasa Fija 1,738,218.55  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202310/05/202411.5925  
Tasa Fija 9,002,898.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202313/05/202411.5925  
Tasa Fija 9,002,898.13

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 66 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202305/07/202312.712	Tasa Fija	190,032.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202304/08/202312.8825	Tasa Fija	101,199.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202304/08/202312.8825	Tasa Fija	22,950.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	10/05/202306/09/202311.6	Tasa Fija	4,032,222.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202325/08/202312.8887	Tasa Fija	250,685.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202321/08/202312.8887	Tasa Fija	46,580.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202305/09/202312.8887	Tasa Fija	37,346.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202305/09/202312.8887	Tasa Fija	93,125.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202331/07/202312.8887	Tasa Fija	31,691.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202304/08/202312.8887	Tasa Fija	96,483.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202305/09/202312.8887	Tasa Fija	24,121.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	10/05/202307/09/202311.5925	Tasa Fija	1,500,483.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202305/07/202312.7152	Tasa Fija	150,379.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202311/08/202312.8887	Tasa Fija	523,546.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202329/08/202312.8887	Tasa Fija	128,959.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202305/09/202312.8887	Tasa Fija	25,790.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202331/10/202313.4625	Tasa Fija	9,850.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/05/202331/10/202313.4625	Tasa Fija	20,230.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	11/05/202307/09/202311.598	Tasa Fija	4,030,928.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202301/09/202312.8725	Tasa Fija	1,818,013.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202303/07/202312.7038	Tasa Fija	17,449.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202321/07/202312.8725	Tasa Fija	35,393.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202305/09/202312.8725	Tasa Fija	518,755.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202301/09/202312.8725	Tasa Fija	53,068.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202314/08/202312.8725	Tasa Fija	3,802.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202305/09/202312.8725	Tasa Fija	451,046.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202305/09/202312.8725	Tasa Fija	48,247.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202303/11/202313.4594	Tasa Fija	2,298,398.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202321/08/202312.8725	Tasa Fija	47,838.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/05/202304/08/202312.8725	Tasa Fija	920,180.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/05/202308/09/202311.6015	Tasa Fija	4,029,648.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202314/08/20236.45101	Tasa Fija	74,647.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/05/202308/09/202311.6015	Tasa Fija	1,007,412.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202306/09/202312.8568	Tasa Fija	3,299,988.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202306/09/202312.8568	Tasa Fija	276,663.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202307/11/202313.4599	Tasa Fija	271,433.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202306/09/202312.8568	Tasa Fija	207,700.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202305/09/202312.8568	Tasa Fija	92,069.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202305/09/202312.8568	Tasa Fija	9,737.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202305/09/202312.8568	Tasa Fija	14,184.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/05/202310/08/202311.6125	Tasa Fija	452,757.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/05/202308/11/202311.5925	Tasa Fija	100,187,596.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202311/07/202312.7023	Tasa Fija	35,141.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202303/07/202312.7023	Tasa Fija	55,348.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202306/07/202312.7023	Tasa Fija	55,396.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202325/08/202312.8568	Tasa Fija	407,639.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202305/09/202312.8568	Tasa Fija	875,049.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202304/09/202312.8568	Tasa Fija	3,612,483.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202323/08/202312.8568	Tasa Fija	14,962.37

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 67 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202320/07/202312.8568	Tasa Fija	889,208.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202307/08/202312.8568	Tasa Fija	158,120.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202305/09/202312.8568	Tasa Fija	1,117,641.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202322/09/202313.4599	Tasa Fija	27,503.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202319/10/202313.4599	Tasa Fija	11,514.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202326/10/202313.4599	Tasa Fija	1,118,895.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202307/11/202313.4599	Tasa Fija	5,783.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202321/07/20236.28634	Tasa Fija	267,322.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202310/07/20236.28634	Tasa Fija	793,430.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202310/07/20236.28634	Tasa Fija	266,116.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202310/07/202312.6993	Tasa Fija	44,208.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202307/07/202312.6993	Tasa Fija	1,435,719.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202310/07/202312.6993	Tasa Fija	766,733.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202301/09/202312.84	Tasa Fija	24,259.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202330/08/202312.84	Tasa Fija	219,408.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202304/09/202312.84	Tasa Fija	58,164.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	648,536.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202304/09/202312.84	Tasa Fija	462,477.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	353,414.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202319/10/202313.4607	Tasa Fija	1,368,097.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202326/10/202313.4607	Tasa Fija	1,066,098.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202304/09/202312.84	Tasa Fija	3,611,719.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	144,780.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202329/08/202312.84	Tasa Fija	31,892.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	24,432.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	54,466.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/05/202305/09/202312.84	Tasa Fija	298,310.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202307/11/202311.598		Tasa Fija	11,085,052.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202308/11/202311.6015		Tasa Fija	15,111,181.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202309/11/202311.609		Tasa Fija	15,106,415.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202314/08/202311.5975		Tasa Fija	452,464.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202325/08/202312.825		Tasa Fija	240,996.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202329/09/202313.4518		Tasa Fija	219,291.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202310/11/202311.6125		Tasa Fija	15,091,932.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202305/09/202312.825		Tasa Fija	134,449.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202302/10/202313.4518		Tasa Fija	1,098,799.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202304/10/202313.4518		Tasa Fija	144,949.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202324/08/202312.825		Tasa Fija	191,750.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202309/11/20235.2568		Tasa Fija	1,515,083.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202314/08/20236.28967		Tasa Fija	84,032.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202304/09/20236.42849		Tasa Fija	160,708.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202307/07/202312.6875		Tasa Fija	8,019.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202310/07/202312.6875		Tasa Fija	48,863.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202303/07/202312.6875		Tasa Fija	12,611.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202301/09/202312.8337		Tasa Fija	1,371,834.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202325/08/202312.8337		Tasa Fija	28,199.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202307/08/202312.8337		Tasa Fija	31,616.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337		Tasa Fija	61,347.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337		Tasa Fija	73,399.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337		Tasa Fija	10,925.46



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 68 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337	Tasa Fija	17,096.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202310/07/202312.6875	Tasa Fija	715,101.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202317/07/202312.8337	Tasa Fija	313,739.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202329/08/202312.8337	Tasa Fija	88,697.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337	Tasa Fija	11,618.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202305/09/202312.8337	Tasa Fija	247,948.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202331/10/202313.4167	Tasa Fija	221,004.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202304/10/202313.4167	Tasa Fija	43,686.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	5,029,018.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202307/07/202312.6875	Tasa Fija	780,957.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202325/08/202312.8337	Tasa Fija	172,549.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202306/09/202312.8337	Tasa Fija	41,374.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202304/09/202312.8337	Tasa Fija	198,788.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202329/09/202313.4167	Tasa Fija	40,218.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/12/202311.6075	Tasa Fija	8,046,430.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202310/11/202311.6125	Tasa Fija	8,199,949.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202310/11/202311.6125	Tasa Fija	1,861,338.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	5,029,018.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	5,023,989.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	5,029,018.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	5,029,018.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/08/202312.8213	Tasa Fija	39,067.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202307/08/202312.8213	Tasa Fija	31,973.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202305/09/202312.8213	Tasa Fija	166,383.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202305/09/202312.8213	Tasa Fija	271,420.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202305/09/202312.8213	Tasa Fija	126,962.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202310/07/202312.675	Tasa Fija	32,217.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202312/09/202312.8213	Tasa Fija	111,128.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202307/08/202312.8213	Tasa Fija	200,198.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202305/09/202312.8213	Tasa Fija	60,336.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202319/10/202313.4196	Tasa Fija	137,972.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196	Tasa Fija	89,662.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196	Tasa Fija	444,700.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202308/09/202312.8213	Tasa Fija	27,908.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202305/09/202312.8213	Tasa Fija	91,140.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202317/08/202312.8213	Tasa Fija	26,909.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202321/08/202312.8213	Tasa Fija	10,661.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202306/09/202312.8213	Tasa Fija	134,423.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196	Tasa Fija	14,497.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202315/09/202311.5925	Tasa Fija	1,250,402.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202313/11/202311.6075	Tasa Fija	8,297,880.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.5975	Tasa Fija	5,022,355.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.5975	Tasa Fija	5,027,382.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.5975	Tasa Fija	5,027,382.99

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 69 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 5,027,382.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.5975  
Tasa Fija 5,027,382.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/09/202311.5925  
Tasa Fija 1,250,402.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202314/07/202312.676 Tasa Fija 264,978.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202301/09/202312.8275 Tasa Fija 1,368,617.79  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202310/07/202312.676 Tasa Fija 51,779.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202307/07/202312.676 Tasa Fija 1,178,612.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202317/07/202312.676 Tasa Fija 184,401.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202317/07/202312.676 Tasa Fija 234,142.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202314/09/202312.8275 Tasa Fija 406,052.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202311/09/202312.8275 Tasa Fija 6,005,550.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202313/09/202312.8275 Tasa Fija 7,096,106.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202327/07/202312.8275 Tasa Fija 823,373.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202305/09/202312.8275 Tasa Fija 36,766.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202305/09/202312.8275 Tasa Fija 392,271.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202314/11/202313.4158 Tasa Fija 90,337.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 3,217,760.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 1,650,395.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202304/10/202313.4158 Tasa Fija 57,997.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202304/10/202313.4158 Tasa Fija 42,481.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202325/08/202312.8275 Tasa Fija 154,510.47  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202317/08/202311.6032  
Tasa Fija 451,740.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202311/09/202312.8275 Tasa Fija 173,809.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 726,033.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202314/11/202311.5975  
Tasa Fija 7,038,336.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.5995  
Tasa Fija 5,025,776.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.5995  
Tasa Fija 5,025,776.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.5995  
Tasa Fija 5,020,750.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.5995  
Tasa Fija 5,025,776.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202309/11/20235.32117  
Tasa Fija 34,737,452.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202322/08/202311.6045  
Tasa Fija 5,515,956.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202317/08/202311.6032  
Tasa Fija 5,019,338.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202318/10/202311.6032  
Tasa Fija 5,019,338.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/08/20236.32936 Tasa Fija 35,180.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202317/07/20236.32936 Tasa Fija 66,943.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202317/07/20236.32936 Tasa Fija 613,389.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202319/09/202311.5925  
Tasa Fija 1,500,483.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202310/07/202312.6713 Tasa Fija 63,696.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202305/07/202312.6713 Tasa Fija 93,016.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202303/07/202312.6713 Tasa Fija 144,149.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202317/07/202312.6713 Tasa Fija 1,383,949.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202311/09/202312.8325 Tasa Fija 196,335.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202305/09/202312.8325 Tasa Fija 687,463.54

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 70 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202311/09/202312.8325	Tasa Fija	2,167,941.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202305/09/202312.8325	Tasa Fija	3,671,150.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057	Tasa Fija	3,982.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057	Tasa Fija	81,343.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057	Tasa Fija	61,945.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202314/11/202311.5975	Tasa Fija	15,082,148.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202318/08/202312.8325	Tasa Fija	236.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202311/09/202312.8325	Tasa Fija	116,536.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202305/09/202312.8325	Tasa Fija	84,487.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202313/10/202313.4057	Tasa Fija	40,537.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202303/07/202312.6713	Tasa Fija	17,880.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202321/08/202312.8325	Tasa Fija	95,375.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202315/11/202313.4057	Tasa Fija	19,367,194.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.6032	Tasa Fija	5,019,338.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.6032	Tasa Fija	5,019,338.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.6032	Tasa Fija	5,014,319.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.6032	Tasa Fija	5,019,338.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202321/08/202311.6067	Tasa Fija	451,450.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/07/202312.665	Tasa Fija	4,452.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202317/07/202312.665	Tasa Fija	1,175,116.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202317/07/202312.665	Tasa Fija	16,352.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202325/07/202312.8125	Tasa Fija	35,241.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202311/09/202312.8125	Tasa Fija	149,372.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202304/08/202312.8125	Tasa Fija	30,443.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202305/09/202312.8125	Tasa Fija	41,633.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202318/07/202312.665	Tasa Fija	1,790,249.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202305/09/202312.8125	Tasa Fija	531,463.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/11/202313.4138	Tasa Fija	1,031,372.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202315/11/202311.5995	Tasa Fija	15,077,330.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202316/11/202311.598	Tasa Fija	9,043,492.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/07/202312.665	Tasa Fija	40,603.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202307/07/202312.665	Tasa Fija	101,371.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202325/08/202312.8125	Tasa Fija	3,494.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202305/09/202312.8125	Tasa Fija	85,698.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202305/09/202312.8125	Tasa Fija	53,410.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202305/09/202312.8125	Tasa Fija	221,611.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/11/202313.4138	Tasa Fija	1,289,254.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202314/11/202313.4138	Tasa Fija	33,640.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202320/09/202311.5925	Tasa Fija	2,000,644.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202302/10/202313.4138	Tasa Fija	759,355.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.6032	Tasa Fija	4,593,698.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202320/10/202311.5995	Tasa Fija	3,512,405.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202317/07/20236.35085	Tasa Fija	51,362.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202315/09/202312.795	Tasa Fija	763,854.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202314/08/202312.795	Tasa Fija	50,463.84

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 71 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202302/10/202313.4423	Tasa Fija	324,516.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202320/12/202311.5995	Tasa Fija	3,010,632.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202307/07/202312.6635	Tasa Fija	3,062.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202319/09/202312.795	Tasa Fija	16,192.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202305/09/202312.795	Tasa Fija	72,868.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202305/09/202312.795	Tasa Fija	62,949.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202317/11/202313.4423	Tasa Fija	1,805,493.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202320/10/20235.27059	Tasa Fija	8,571,581.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202316/11/202311.5925	Tasa Fija	37,712,608.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202321/09/202311.5925	Tasa Fija	2,000,644.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202314/07/202312.6635	Tasa Fija	618,617.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202314/08/202312.795	Tasa Fija	384,336.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202305/09/202312.795	Tasa Fija	14,106.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202305/09/202312.795	Tasa Fija	13,694.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202304/10/202313.4423	Tasa Fija	7,250.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202318/07/202312.6635	Tasa Fija	10,250.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202320/10/20235.27059	Tasa Fija	8,571,581.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202320/10/202311.5995	Tasa Fija	3,512,405.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202324/07/202312.66	Tasa Fija	63,588.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202307/08/202312.776	Tasa Fija	32,275.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202305/09/202312.776	Tasa Fija	500,252.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202319/09/202312.776	Tasa Fija	110,909.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202305/09/202312.776	Tasa Fija	36,612.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202320/10/20235.27059	Tasa Fija	8,571,581.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202321/12/202311.6067	Tasa Fija	2,508,060.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202304/07/202312.66	Tasa Fija	7,862.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202305/07/202312.66	Tasa Fija	221,125.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202315/09/202312.776	Tasa Fija	320,794.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202305/09/202312.776	Tasa Fija	87,000.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202305/09/202312.776	Tasa Fija	36,200.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202315/09/202312.776	Tasa Fija	117,868.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202317/10/202313.4254	Tasa Fija	112,741.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202321/12/202311.6067	Tasa Fija	3,009,672.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202321/11/202311.6067	Tasa Fija	1,805,803.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202323/10/202311.6	Tasa Fija	5,012,888.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202311/09/20236.60017	Tasa Fija	55,732.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202325/07/202312.6635	Tasa Fija	95,470.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202305/07/202312.6635	Tasa Fija	112,321.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202307/08/202312.7665	Tasa Fija	1,039,409.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202320/09/202312.7665	Tasa Fija	1,166,370.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202320/09/202312.7665	Tasa Fija	988,115.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202321/11/202313.4151	Tasa Fija	274,234.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202311/07/202312.6635	Tasa Fija	1,376,127.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202301/09/202312.7665	Tasa Fija	138,612.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202320/09/202312.7665	Tasa Fija	133,449.36

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 72 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202305/09/202312.7665	Tasa Fija	1,753,418.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202303/10/202313.4151	Tasa Fija	193,115.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202304/10/202313.4151	Tasa Fija	114,809.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202324/07/202312.6635	Tasa Fija	78,431.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202305/07/202312.6635	Tasa Fija	20,103.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202315/09/202312.7665	Tasa Fija	474,357.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202318/09/202312.7665	Tasa Fija	921,953.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202320/09/202312.7665	Tasa Fija	16,881.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202303/08/202312.7665	Tasa Fija	508,314.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202304/08/202312.7665	Tasa Fija	99,334.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202316/11/202313.4151	Tasa Fija	3,510,451.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202324/07/202312.6635	Tasa Fija	130,400.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202318/09/202312.7665	Tasa Fija	108,825.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202321/08/202312.7665	Tasa Fija	3,064.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202305/09/202312.7665	Tasa Fija	209,610.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202309/11/202313.4151	Tasa Fija	1,627,574.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202321/11/202311.6067		Tasa Fija	3,089,930.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202321/11/202311.6067		Tasa Fija	3,852,380.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202324/07/202312.6517	Tasa Fija	1,632,227.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	53,185.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202324/07/202312.6517	Tasa Fija	854,710.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	32,413.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	11,830.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202318/09/202312.7637	Tasa Fija	3,940,858.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202313/09/202312.7637	Tasa Fija	4,999.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	488,102.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202318/09/202312.7637	Tasa Fija	294,927.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	224,404.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	509,137.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	599,660.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	1,693.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202304/08/202312.7637	Tasa Fija	5,922.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	8,381.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/05/202314/05/202711.7495		Tasa Fija	1,181,135.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202321/07/202312.6517	Tasa Fija	25,848.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	3,267.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	354,051.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/07/202312.6517	Tasa Fija	25,557.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202312/09/202312.7637	Tasa Fija	74,966.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202318/09/202312.7637	Tasa Fija	164,856.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202320/09/202312.7637	Tasa Fija	83,043.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202314/09/202312.7637	Tasa Fija	292,438.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	473,172.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	905,146.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202305/09/202312.7637	Tasa Fija	163,173.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202314/07/202312.6517	Tasa Fija	411,004.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202314/07/202312.6517	Tasa Fija	240,122.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202307/07/202312.6517	Tasa Fija	241,374.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202314/07/202312.6517	Tasa Fija	133,486.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202314/07/202312.6517	Tasa Fija	165,731.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202321/07/202312.6517	Tasa Fija	213,887.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202321/07/202312.6517	Tasa Fija	267,561.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/05/202321/07/202312.6517	Tasa Fija	312,239.25

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 73 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202328/07/202312.6517	Tasa Fija	451,021.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202328/07/202312.6517	Tasa Fija	343,400.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202328/07/202312.6517	Tasa Fija	232,124.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202315/09/202312.7637	Tasa Fija	1,178,332.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202328/08/202311.5855	Tasa Fija	500,482.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202325/07/202312.659	Tasa Fija	80,409.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202317/07/202312.659	Tasa Fija	222,879.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202315/09/202312.7638	Tasa Fija	884,254.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202318/09/202312.7638	Tasa Fija	365,694.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202313/09/202312.7638	Tasa Fija	68,732.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202305/09/202312.7638	Tasa Fija	93,057.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202305/09/202312.7638	Tasa Fija	42,671.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202305/09/202312.7638	Tasa Fija	333,522.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202325/07/202312.659	Tasa Fija	272,092.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202324/07/202312.659	Tasa Fija	31,888.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202321/08/202312.7638	Tasa Fija	116,826.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202305/09/202312.7638	Tasa Fija	96,883.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202305/09/202312.7638	Tasa Fija	61,473.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202324/11/202313.4057	Tasa Fija	1,020,565.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202306/11/202313.4057	Tasa Fija	1,150,059.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202326/12/202311.608	Tasa Fija	5,008,061.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202327/09/202311.6005	Tasa Fija	4,005,155.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/05/202314/12/202311.5975	Tasa Fija	7,038,336.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202323/10/202311.6	Tasa Fija	5,012,888.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202324/07/20236.46374	Tasa Fija	32,777.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202324/07/20236.46374	Tasa Fija	8,124.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202314/07/202312.6557	Tasa Fija	578.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202328/07/202312.6557	Tasa Fija	716,613.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202305/07/202312.6557	Tasa Fija	67,813.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202322/09/202312.77	Tasa Fija	980,707.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202305/09/202312.77	Tasa Fija	25,898.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202320/07/202312.6557	Tasa Fija	100,639.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202304/08/202312.77	Tasa Fija	553,652.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202305/09/202312.77	Tasa Fija	47,415.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202317/10/202313.4057	Tasa Fija	225,595.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202328/07/202312.6557	Tasa Fija	49,477.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202318/08/202312.77	Tasa Fija	155,153.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202327/11/202311.6005	Tasa Fija	12,516,111.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202325/07/202312.6466	Tasa Fija	92,419.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202331/07/202312.6466	Tasa Fija	35,593.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202321/08/202312.76	Tasa Fija	107,805.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202313/09/202312.76	Tasa Fija	85,033.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	318,871.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	386,191.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	3,161.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202324/07/202312.6466	Tasa Fija	9,429.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202319/07/202312.6466	Tasa Fija	201,051.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202314/09/202312.76	Tasa Fija	39,078.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202318/09/202312.76	Tasa Fija	266,109.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	194,550.16

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 74 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	638,870.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202321/11/202313.3878	Tasa Fija	118,963.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202304/10/202313.3878	Tasa Fija	18,748.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202315/08/202312.76	Tasa Fija	313,887.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202328/07/202312.6466	Tasa Fija	22,386.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202307/07/202312.6466	Tasa Fija	31,789.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202320/07/202312.6466	Tasa Fija	36,538.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202324/07/202312.6466	Tasa Fija	41,265.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202311/08/202312.76	Tasa Fija	15,784.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	206,490.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	77,199.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202329/09/202311.5962		Tasa Fija	2,001,288.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202331/05/20285.62249		Tasa Fija	15,424,591.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202311/08/20236.49282	Tasa Fija	1,531,098.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202325/07/202312.654	Tasa Fija	709,787.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202308/09/202312.7625	Tasa Fija	257,881.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202321/08/202312.7625	Tasa Fija	143,780.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202327/09/202312.7625	Tasa Fija	63,594.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202310/08/202312.7625	Tasa Fija	965,471.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202305/09/202312.7625	Tasa Fija	102,179.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202305/09/202312.7625	Tasa Fija	203,822.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	327,457.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202316/11/202313.3822	Tasa Fija	1,862,970.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202323/11/202313.3822	Tasa Fija	1,381,821.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	12,746.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202324/07/202312.654	Tasa Fija	100,737.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202305/07/202312.654	Tasa Fija	40,217.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202301/09/202312.7625	Tasa Fija	35,422.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202314/08/202312.7625	Tasa Fija	71,726.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202320/09/202312.7625	Tasa Fija	230,387.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202305/09/202312.7625	Tasa Fija	435,419.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	1,618.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	22,878.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202310/07/202312.654	Tasa Fija	36,038.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202331/07/202312.654	Tasa Fija	577,496.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202304/07/202312.654	Tasa Fija	579,844.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202315/08/202312.7625	Tasa Fija	67,183.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202325/09/202312.7625	Tasa Fija	1,059,212.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202305/09/202312.7625	Tasa Fija	374,328.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202324/10/202313.3822	Tasa Fija	56,734.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202309/11/202313.3822	Tasa Fija	216,791.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	304,876.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	27,454.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/06/202325/05/20275.59923		Tasa Fija	63,415,468.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202311/09/20236.68528	Tasa Fija	191,707.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202328/07/202312.6533	Tasa Fija	32,728.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202331/07/202312.6533	Tasa Fija	3,482,918.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202315/09/202312.765	Tasa Fija	1,711,201.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202305/09/202312.765	Tasa Fija	486,753.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202325/09/202312.765	Tasa Fija	765,726.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202328/11/202313.4059	Tasa Fija	85,215.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202304/10/202313.4059	Tasa Fija	45,179.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202331/07/202312.6533	Tasa Fija	1,267,515.59

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 75 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202304/07/202312.6533	Tasa Fija	283,391.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202330/08/202312.765	Tasa Fija	179,042.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202325/09/202312.765	Tasa Fija	4,098,523.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202325/09/202312.765	Tasa Fija	1,325,452.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202317/07/202312.6533	Tasa Fija	126,288.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202303/07/202312.6533	Tasa Fija	9,485.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202304/07/202312.6533	Tasa Fija	47,962.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202321/08/202312.765	Tasa Fija	437.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202305/09/202312.765	Tasa Fija	30,443.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202305/09/202312.765	Tasa Fija	3,207.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202304/10/202313.4059	Tasa Fija	373,592.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202325/09/202312.765	Tasa Fija	142,045.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202305/09/202312.765	Tasa Fija	103,619.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202307/07/202312.6533	Tasa Fija	41,038.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202305/09/202312.765	Tasa Fija	156,927.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202307/07/202312.6533	Tasa Fija	29,738.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202314/09/202312.765	Tasa Fija	199,246.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/06/202328/08/202312.765	Tasa Fija	350,073.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/06/202304/09/202311.6		Tasa Fija	453,625.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202311/08/20236.43034	Tasa Fija	20,906.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202331/07/20236.43034	Tasa Fija	240,448.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202325/09/20236.64547	Tasa Fija	477,545.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202314/07/202312.65	Tasa Fija	518.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/07/202312.65	Tasa Fija	24,930.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202329/09/202312.7555	Tasa Fija	756,606.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	1,305,448.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/08/202312.65	Tasa Fija	32,265.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202324/07/202312.65	Tasa Fija	162,322.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202331/07/202312.65	Tasa Fija	45,937.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202318/08/202312.7555	Tasa Fija	34,825.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	100,102.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	145,109.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202304/08/202312.65	Tasa Fija	1,092,435.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202318/09/202312.7555	Tasa Fija	10,547.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202305/09/202312.7555	Tasa Fija	88,365.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202325/07/202312.648	Tasa Fija	22,100.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202303/10/202312.76	Tasa Fija	443,942.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202328/08/202312.76	Tasa Fija	25,109.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202304/08/202312.648	Tasa Fija	2,880,215.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202304/08/202312.648	Tasa Fija	955,006.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	100,181.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	223,061.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202304/08/202312.648	Tasa Fija	1,044,948.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202305/07/202312.648	Tasa Fija	260,119.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202328/09/202312.76	Tasa Fija	53,824.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202307/08/202312.76	Tasa Fija	690,577.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202328/08/202312.76	Tasa Fija	29,221.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202327/09/202312.76	Tasa Fija	38,427.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	151,199.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	189,543.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	85,300.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/06/202303/01/202411.598		Tasa Fija	4,030,928.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202307/08/202312.6515	Tasa Fija	51,331.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202324/07/202312.6515	Tasa Fija	248,279.83



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 76 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202322/09/202312.76	Tasa Fija	817,280.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202311/08/202312.76	Tasa Fija	243,367.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	32,639.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	31,195.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	314,590.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202325/07/202312.6515	Tasa Fija	33,395.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202306/10/202312.76	Tasa Fija	101,067.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202329/09/202312.76	Tasa Fija	195,872.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	133,762.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	296,756.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202314/07/202312.6515	Tasa Fija	506,363.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202311/09/202312.76	Tasa Fija	7,531.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	26,571.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	18,551.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	338.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202314/07/202312.6515	Tasa Fija	8,343.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202327/12/202311.6005		Tasa Fija	3,003,866.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202301/11/202311.6015		Tasa Fija	10,074,120.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202304/01/202411.6015		Tasa Fija	3,022,236.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/06/202331/05/202411.5925		Tasa Fija	45,848,092.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/06/202307/09/202311.609		Tasa Fija	352,483.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202325/08/20236.43808	Tasa Fija	501,225.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202328/08/20236.43808	Tasa Fija	80,657.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202325/09/20236.67788	Tasa Fija	31,624.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/06/202306/12/202311.609		Tasa Fija	40,283,775.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202314/07/202312.659	Tasa Fija	274,216.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202307/08/202312.659	Tasa Fija	545,680.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202314/07/202312.659	Tasa Fija	458,120.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202306/10/202312.758	Tasa Fija	482,400.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202314/08/202312.758	Tasa Fija	69,215.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	68,284.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	3,907.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	823,359.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202306/11/202313.3926	Tasa Fija	70,836.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202307/07/202312.659	Tasa Fija	359,649.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202325/07/202312.659	Tasa Fija	36,617.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202310/08/202312.758	Tasa Fija	56,377.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202307/07/202312.659	Tasa Fija	47,864.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/06/202330/03/20285.82187		Tasa Fija	111,269,391.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/07/202312.659	Tasa Fija	58,681.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202302/10/202312.758	Tasa Fija	229,028.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	7,949,773.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202317/08/202312.758	Tasa Fija	516,471.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	79,130.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202305/09/202312.758	Tasa Fija	1,397,476.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	380,095.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202307/08/202312.659	Tasa Fija	4,769,111.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202307/08/202312.659	Tasa Fija	4,061,053.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/09/202312.758	Tasa Fija	6,346.42

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 77 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202302/10/202312.758	Tasa Fija	2,899,960.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	117,276.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202301/12/202313.3926	Tasa Fija	1,559,584.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	53,278.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/06/202323/11/202313.3926	Tasa Fija	2,816,180.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202323/10/202311.6		Tasa Fija	14,036,088.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202303/11/202311.609		Tasa Fija	10,070,943.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202307/08/20236.45059	Tasa Fija	585,059.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/08/202312.6625	Tasa Fija	28,500.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202331/07/202312.6625	Tasa Fija	354,285.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202310/07/202312.6625	Tasa Fija	797,545.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202301/09/202312.7652	Tasa Fija	547,607.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202306/10/202312.7652	Tasa Fija	1,057,365.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202316/08/202312.7652	Tasa Fija	119,510.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202311/09/202312.7652	Tasa Fija	463,061.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202302/10/202312.7652	Tasa Fija	1,405,568.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202320/09/202312.7652	Tasa Fija	57,780.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202305/09/202312.7652	Tasa Fija	591,777.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202324/11/202313.3717	Tasa Fija	49,640.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202323/11/202313.3717	Tasa Fija	18,085.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202314/07/202312.6625	Tasa Fija	230,485.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202328/08/202312.7652	Tasa Fija	46,101.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202307/09/202312.7652	Tasa Fija	842,801.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	155,205.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	71,103.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202314/07/202312.6625	Tasa Fija	35,485.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	42,906.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202301/12/202313.3717	Tasa Fija	1,077,776.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202306/11/202313.3717	Tasa Fija	41,153.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202306/11/202311.6125		Tasa Fija	10,061,288.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202307/11/202311.6125		Tasa Fija	10,061,288.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202308/11/202311.6125		Tasa Fija	10,061,288.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202306/12/202311.6125		Tasa Fija	3,219,612.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202302/10/20236.66715	Tasa Fija	86,073.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202321/07/202312.6575	Tasa Fija	2,725.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202331/07/202312.6575	Tasa Fija	79,083.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202322/08/202312.7726	Tasa Fija	259,748.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202302/10/202312.7726	Tasa Fija	14,201.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202321/09/202312.7726	Tasa Fija	408,516.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202305/09/202312.7726	Tasa Fija	355,010.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	177,124.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202330/10/202313.3731	Tasa Fija	2,505,799.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/11/202313.3731	Tasa Fija	531,292.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202331/07/202312.6575	Tasa Fija	2,880.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202314/07/202312.6575	Tasa Fija	4,258.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/10/202312.7726	Tasa Fija	432,269.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202311/09/202312.7726	Tasa Fija	7,158.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	62,441.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/11/202313.3731	Tasa Fija	5,507.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202331/07/202312.6575	Tasa Fija	161,170.52

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 78 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202314/07/202312.6575	Tasa Fija	6,695,670.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202303/10/202312.7726	Tasa Fija	411,548.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202305/09/202312.7726	Tasa Fija	57,260.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202315/06/202711.7575		Tasa Fija	7,258,421.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202331/07/202312.6575	Tasa Fija	51,514.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202314/07/202312.6575	Tasa Fija	25,442.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202325/08/202312.7726	Tasa Fija	56,854.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202326/09/202312.7726	Tasa Fija	78,980.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	1,284.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202325/07/202312.6475	Tasa Fija	14,389.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202314/07/202312.6475	Tasa Fija	25,846.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202304/09/202312.7663	Tasa Fija	58,861.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202304/10/202312.7663	Tasa Fija	37,765.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202315/09/202312.7663	Tasa Fija	106,560.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202311/10/202312.7663	Tasa Fija	1,509,042.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202304/10/202312.7663	Tasa Fija	143,538.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	595,561.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202324/07/202312.6475	Tasa Fija	104,612.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202301/09/202312.7663	Tasa Fija	1,181,621.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	4,801.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	5,728.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202308/08/202312.6475	Tasa Fija	29,406.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202314/07/202312.6475	Tasa Fija	48,579.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202328/08/202312.7663	Tasa Fija	270,347.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/09/202312.7663	Tasa Fija	215,964.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202310/08/202312.6495	Tasa Fija	63,408.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202331/07/202312.6495	Tasa Fija	79,243.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202314/07/202312.6495	Tasa Fija	103,104.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202325/08/202312.7606	Tasa Fija	208,511.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202317/08/202312.7606	Tasa Fija	55,015.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	2,281,407.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	107,392.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/08/202312.6495	Tasa Fija	357,951.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202311/10/202312.7606	Tasa Fija	194,653.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	309,632.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	411,058.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202308/12/202313.384	Tasa Fija	351,492.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202306/11/202313.384	Tasa Fija	24,235.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202306/11/202313.384	Tasa Fija	4,957.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202314/08/202312.6495	Tasa Fija	10,312.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/07/202312.6495	Tasa Fija	31,820.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202311/09/202312.7606	Tasa Fija	57,674.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	245,691.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202305/09/202312.7606	Tasa Fija	168,492.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202305/09/202312.7606	Tasa Fija	135,718.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202331/07/202312.6495	Tasa Fija	806,807.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202329/08/202312.7606	Tasa Fija	78,174.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	895,076.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202309/11/202311.5995		Tasa Fija	10,051,553.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202315/06/202811.7695		Tasa Fija	35,714,951.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202313/10/202311.598		Tasa Fija	1,004,832.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202314/09/202311.598			

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 79 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 452,174.63		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202314/07/202312.648	Tasa Fija 69,013.28	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/08/202312.648	Tasa Fija 9,039.84	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202314/08/202312.648	Tasa Fija 1,253,123.53	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/08/202312.648	Tasa Fija 2,523.23	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202306/10/202312.7553	Tasa Fija 638,702.68	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202310/10/202312.7553	Tasa Fija 87,258.56	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija 3,648,661.29	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija 368,734.81	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202305/09/202312.7553	Tasa Fija 25,918.58	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202321/07/202312.648	Tasa Fija 393,105.58	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202322/09/202312.7553	Tasa Fija 300,327.88	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija 323,424.03	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija 49,135.80	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija 4,186.47	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202306/10/202312.7553	Tasa Fija 756,763.23	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202330/08/202312.7553	Tasa Fija 82,636.93	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202311/09/202312.7553	Tasa Fija 221,892.21	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija 37,125.36	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202302/10/202312.7553	Tasa Fija 195,585.32	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija 82,850.85	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202311/12/202313.3781	Tasa Fija 119,967.37	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202330/11/202313.3781	Tasa Fija 2,570,342.73	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija 17,715.35	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202317/07/202312.648	Tasa Fija 101,379.25	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202310/07/202312.648	Tasa Fija 40,130.50	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija 1,040,857.57	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija 41,408.47	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija 55,917.93	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202311/12/202313.3781	Tasa Fija 97,212.14	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/06/202319/10/202313.3781	Tasa Fija 374,287.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202310/11/202311.598		
Tasa Fija 10,048,325.00		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202314/07/202312.6532	Tasa Fija 51,469.38	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202321/07/202312.6532	Tasa Fija 21,882.45	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202310/07/202312.6532	Tasa Fija 64,723.57	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202314/08/202312.6532	Tasa Fija 1,109,697.53	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202314/07/202312.6532	Tasa Fija 90,077.64	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202313/10/202312.7646	Tasa Fija 181,654.97	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202305/09/202312.7646	Tasa Fija 104,844.24	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202302/10/202312.7646	Tasa Fija 79,331.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija 610,802.96	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/09/202312.7646	Tasa Fija 165,708.22	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202309/10/202312.7646	Tasa Fija 165,510.04	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija 154,276.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202315/01/202411.6032		
Tasa Fija 2,042,870.84		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202311/08/202312.6532	Tasa Fija 405,565.50	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202305/07/202312.6532	Tasa Fija 127,027.75	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202310/07/202312.6532	Tasa Fija 48,441.35	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/07/202312.6532	Tasa Fija 123,277.21	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija 73,611.70	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija 13,849.93	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija 822,917.42	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202313/11/202313.36	Tasa Fija 480,731.82	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202311/08/202312.6532	Tasa Fija 247,616.61	

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 80 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202311/08/202312.6532	Tasa Fija	317,464.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202311/08/202312.6532	Tasa Fija	318,335.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/08/202312.6532	Tasa Fija	117,182.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202328/09/202312.7646	Tasa Fija	49,593.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202311/10/202312.7646	Tasa Fija	50,653.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202305/09/202312.7646	Tasa Fija	345,621.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202306/11/202313.36	Tasa Fija	23,861.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202318/09/202311.5995		Tasa Fija	351,240.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202328/07/202312.6495	Tasa Fija	394,579.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	1,690,911.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202306/09/202312.76	Tasa Fija	131,768.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202328/07/202312.6495	Tasa Fija	326,683.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202310/08/202312.6495	Tasa Fija	261,664.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202308/09/202312.76	Tasa Fija	28,642.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202328/07/202312.6495	Tasa Fija	181,532.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202307/08/202312.6495	Tasa Fija	2,344,274.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202321/07/202312.6495	Tasa Fija	6,103,122.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	397,014.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	540,472.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202305/09/202312.76	Tasa Fija	1,711,132.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	95,388.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	98,802.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202331/07/202312.6495	Tasa Fija	53,048.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202314/07/202312.6495	Tasa Fija	28,033.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202308/09/202312.76	Tasa Fija	75,694.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202309/10/202312.76	Tasa Fija	100,538.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202311/12/202313.3618	Tasa Fija	73,326.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	52,893.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202307/08/202312.6495	Tasa Fija	79,033.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202319/07/202312.6495	Tasa Fija	25,350.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202321/07/202312.6495	Tasa Fija	899,987.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	8,610.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202318/09/202311.5995		Tasa Fija	420,487.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202318/09/202311.5995		Tasa Fija	420,487.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202314/09/202311.5995		Tasa Fija	479,503.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202314/08/20236.40684	Tasa Fija	100,904.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202309/10/20236.68937	Tasa Fija	198,703.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202319/10/202311.6067		Tasa Fija	5,016,120.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202318/08/202312.6567	Tasa Fija	25,738.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/08/202312.6567	Tasa Fija	115,716.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202310/08/202312.6567	Tasa Fija	10,795.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202310/07/202312.6567	Tasa Fija	15,846.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202321/07/202312.6567	Tasa Fija	19,786.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202301/09/202312.7612	Tasa Fija	85,321.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612	Tasa Fija	420,640.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612	Tasa Fija	446,806.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	150,972.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202325/07/202312.6567	Tasa Fija	191,853.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202317/07/202312.6567	Tasa Fija	515,200.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202311/09/202312.7612	Tasa Fija	75,667.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	29,452.92

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 81 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202320/06/202511.7067  
Tasa Fija 20,065,037.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202321/07/202312.6567 Tasa Fija 25,084.96

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612 Tasa Fija 161,692.76

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618 Tasa Fija 21,488.86

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202319/10/20235.32249  
Tasa Fija 51,354,391.45

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202312/10/20235.32249  
Tasa Fija 51,354,391.45

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202305/10/20235.30249  
Tasa Fija 51,354,362.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202328/09/20235.30249  
Tasa Fija 51,354,362.87

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202313/09/202311.6067  
Tasa Fija 304,756.12

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202319/09/202311.6067  
Tasa Fija 403,152.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202315/09/202311.6067  
Tasa Fija 368,730.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202317/07/20236.27713 Tasa Fija 246,231.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202331/07/20236.42025 Tasa Fija 2,571,929.38

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202320/10/202311.6045  
Tasa Fija 5,014,505.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202314/07/202312.6545 Tasa Fija 3,824,019.62

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202317/10/202312.7606 Tasa Fija 163,685.24

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202325/09/202312.7606 Tasa Fija 150,239.15

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202305/09/202312.7606 Tasa Fija 31,303.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202306/11/202313.3618 Tasa Fija 178,529.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202317/10/202312.7606 Tasa Fija 28,879.77

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202319/10/202312.7606 Tasa Fija 111,719.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202304/10/202312.7606 Tasa Fija 94,610.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202323/11/202313.3618 Tasa Fija 243,512.10

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202319/12/202311.6045  
Tasa Fija 5,014,505.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202318/12/202311.6045  
Tasa Fija 5,014,505.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202315/12/202311.6045  
Tasa Fija 5,014,505.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202314/12/202311.6045  
Tasa Fija 3,510,153.94

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202313/12/202311.6045  
Tasa Fija 2,507,252.81

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202311/12/202311.6045  
Tasa Fija 2,005,802.25

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202308/12/202311.6045  
Tasa Fija 3,510,153.94

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202305/12/202311.6045  
Tasa Fija 3,510,153.94

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202304/12/202311.6045  
Tasa Fija 2,808,123.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202328/11/202311.5855  
Tasa Fija 2,502,413.65

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202327/11/202311.6005  
Tasa Fija 4,005,155.78

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202324/11/202311.608  
Tasa Fija 4,677,529.08

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 82 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202306/10/202312.7606	Tasa Fija	244,478.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202312/09/202312.7606	Tasa Fija	73,834.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	149,778.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	25,627.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202323/11/202313.3618	Tasa Fija	5,208.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	38,020.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202311/12/202311.6045	Tasa Fija	5,014,505.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/06/202315/12/202313.3618	Tasa Fija	1,404,676.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202318/09/202311.6045	Tasa Fija	372,527.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202320/09/202311.6045	Tasa Fija	314,290.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202314/09/202311.6045	Tasa Fija	329,401.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/08/202312.65	Tasa Fija	216,536.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202314/08/202312.65	Tasa Fija	704,918.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202310/07/202312.65	Tasa Fija	106,367.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202328/07/202312.65	Tasa Fija	105,068.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202315/09/202312.7537	Tasa Fija	777,980.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/10/202312.7537	Tasa Fija	593,135.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202325/08/202312.7537	Tasa Fija	45,142.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344	Tasa Fija	386,774.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202323/11/202313.3344	Tasa Fija	2,941,246.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202317/08/202312.65	Tasa Fija	46,454.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202328/07/202312.65	Tasa Fija	24,716.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202329/09/202312.7537	Tasa Fija	15,223.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202324/08/202312.7537	Tasa Fija	234,645.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202305/09/202312.7537	Tasa Fija	313,508.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/10/202312.7537	Tasa Fija	1,371,662.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202313/11/202313.3344	Tasa Fija	200,592.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344	Tasa Fija	55,689.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344	Tasa Fija	19,524.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202320/10/202311.6	Tasa Fija	5,012,888.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202321/09/202311.6	Tasa Fija	257,945.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202314/12/202311.6	Tasa Fija	5,012,888.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202315/09/202311.6	Tasa Fija	349,099.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202319/09/202311.6	Tasa Fija	365,063.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202317/08/202312.65	Tasa Fija	215,885.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202310/08/202312.65	Tasa Fija	29,527.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202307/08/202312.65	Tasa Fija	2,998.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202321/08/202312.65	Tasa Fija	1,239,226.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202328/07/202312.65	Tasa Fija	87,548.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/10/202312.7537	Tasa Fija	193,267.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537	Tasa Fija	413,776.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/10/202312.7537	Tasa Fija	219,217.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/10/202312.7537	Tasa Fija	1,526,344.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537	Tasa Fija	435,541.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202313/10/202312.7537	Tasa Fija	1,342,081.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537	Tasa Fija	697,101.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202315/12/202313.3344	Tasa Fija	476,159.57

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 83 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202324/10/202311.608  
Tasa Fija 5,008,061.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/08/202312.658 Tasa Fija 414,604.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202325/07/202312.658 Tasa Fija 6,031.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202320/10/202312.755 Tasa Fija 407,551.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202318/09/202312.755 Tasa Fija 224,933.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 437,081.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/08/202312.658 Tasa Fija 138,658.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202321/08/202312.658 Tasa Fija 166,123.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/08/202312.658 Tasa Fija 413,735.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202321/08/202312.658 Tasa Fija 515,326.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 448,849.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 28,793.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 511,535.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202313/11/202313.3222 Tasa Fija 271,501.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202306/11/202313.3222 Tasa Fija 67,306.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202321/08/202312.658 Tasa Fija 27,693.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 4,218,338.20  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202318/12/202311.608  
Tasa Fija 5,008,061.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202328/07/202312.658 Tasa Fija 62,090.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202319/09/202312.755 Tasa Fija 73,630.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 44,033.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202318/10/202312.755 Tasa Fija 140,160.32  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202320/12/202311.608  
Tasa Fija 12,520,152.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202322/09/202311.608  
Tasa Fija 368,138.52  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202318/09/202311.608  
Tasa Fija 242,971.41  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202320/09/202311.608  
Tasa Fija 350,608.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202325/10/202311.6005  
Tasa Fija 5,006,444.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202317/07/20236.28367 Tasa Fija 7,729.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202321/08/20236.4387 Tasa Fija 440,727.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202319/12/202311.6005  
Tasa Fija 5,006,444.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202325/09/202311.6005  
Tasa Fija 400,515.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202321/08/202312.6505 Tasa Fija 148,535.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202301/09/202312.7525 Tasa Fija 65,126.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202318/09/202312.7525 Tasa Fija 145,907.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525 Tasa Fija 105,978.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202324/11/202313.3005 Tasa Fija 1,199,562.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202322/12/202313.3005 Tasa Fija 610,901.48  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202321/12/202311.6005  
Tasa Fija 12,516,111.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202328/07/202312.6505 Tasa Fija 8,156,030.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202318/10/202312.7525 Tasa Fija 644,829.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525 Tasa Fija 124,565.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202311/10/202312.7525 Tasa Fija 133,198.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525 Tasa Fija 307,604.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202306/11/202313.3005 Tasa Fija 269,997.55  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202325/09/202311.6005  
Tasa Fija 244,733.09

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 84 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202321/09/202311.6005  
Tasa Fija 367,467.66

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202319/09/202311.6005  
Tasa Fija 348,650.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202328/07/202312.6505 Tasa Fija 579,666.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202320/09/202312.7525 Tasa Fija 73,604.16

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202326/09/202311.5855  
Tasa Fija 279,604.61

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202322/09/202311.5855  
Tasa Fija 350,381.88

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202320/09/202311.5855  
Tasa Fija 326,039.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202324/07/20236.28731 Tasa Fija 146,475.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202310/07/20236.28731 Tasa Fija 328,368.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202316/10/20236.72042 Tasa Fija 318,507.11

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202326/10/202311.5855  
Tasa Fija 5,004,827.29

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202314/08/202312.6355 Tasa Fija 39,775.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202314/07/202312.6355 Tasa Fija 38,052.06

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202316/10/202312.7487 Tasa Fija 136,872.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487 Tasa Fija 245,240.45

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202321/08/202312.6355 Tasa Fija 72,623.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202325/08/202312.6355 Tasa Fija 36,648.67

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202315/08/202312.6355 Tasa Fija 567,708.35

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202328/07/202312.6355 Tasa Fija 2,639,369.46

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202306/09/202312.7487 Tasa Fija 199,044.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202322/12/202311.5855  
Tasa Fija 15,014,481.88

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/08/202312.6355 Tasa Fija 18,033.31

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487 Tasa Fija 714,006.29

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487 Tasa Fija 96,174.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487 Tasa Fija 336,515.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487 Tasa Fija 1,015,792.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202305/09/202312.7487 Tasa Fija 2,927.90

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202321/12/202311.5962  
Tasa Fija 5,003,221.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202321/08/20236.43932 Tasa Fija 3,751.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202327/10/202311.5962  
Tasa Fija 5,003,221.17

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202321/09/202311.5962  
Tasa Fija 339,761.54

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202325/09/202311.5962  
Tasa Fija 353,205.24

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202327/09/202311.5962  
Tasa Fija 257,447.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202326/12/202311.5962  
Tasa Fija 12,508,052.92

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202311/08/202312.6462 Tasa Fija 31,295.54

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202318/08/202312.6462 Tasa Fija 325,710.28

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202310/08/202312.6462 Tasa Fija 63,847.37

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202317/07/202312.6462 Tasa Fija 53,219.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202328/07/202312.6462 Tasa Fija 21,792.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202313/10/202312.7506 Tasa Fija 880,356.30

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202324/10/202312.7506 Tasa Fija 711,075.15

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962 Tasa Fija 21,500.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962 Tasa Fija 11,599.39

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 85 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija	33,660.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202331/07/202312.6462	Tasa Fija	603,914.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202324/07/202312.6462	Tasa Fija	20,082.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/08/202312.6462	Tasa Fija	4,218,782.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija	46,766.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija	47,253.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202322/12/202313.2962	Tasa Fija	1,698,739.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202328/06/202411.5925	Tasa Fija	60,019,320.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202314/08/202312.6462	Tasa Fija	4,211,385.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/08/202312.6462	Tasa Fija	43,171.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija	341,816.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija	321,731.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202322/09/202312.7506	Tasa Fija	143,217.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202327/09/202311.5925	Tasa Fija	25,008,050.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202326/09/202311.5925	Tasa Fija	330,897.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202328/09/202311.5925	Tasa Fija	470,610.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202315/09/20236.44187	Tasa Fija	5,725.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202322/12/202311.5925	Tasa Fija	5,001,610.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202328/09/202311.5925	Tasa Fija	25,008,050.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202327/10/202311.5925	Tasa Fija	1,000,322.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202325/08/202312.6425	Tasa Fija	22,275.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202328/08/202312.6425	Tasa Fija	142,540.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202310/07/202312.6425	Tasa Fija	5,203.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/08/202312.6425	Tasa Fija	9,051.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202322/09/202313.2477	Tasa Fija	24,704.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202323/11/202313.2925	Tasa Fija	17,406.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202310/11/202313.2925	Tasa Fija	166,177.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202306/11/202313.2925	Tasa Fija	54,581.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202328/09/202311.5925	Tasa Fija	400,128.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202325/08/202312.6425	Tasa Fija	1,170,536.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202328/08/202312.6425	Tasa Fija	5,145.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202323/10/202312.7477	Tasa Fija	3,104,428.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202327/10/202312.7477	Tasa Fija	83,640.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija	1,783,759.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija	30,643.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija	472,278.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202326/12/202313.2925	Tasa Fija	354,793.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202306/11/202313.2925	Tasa Fija	3,859.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202321/09/202312.7477	Tasa Fija	115,813.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/201620/12/20237.54	Tasa Fija	12,288,049.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/201820/05/20258.26	Tasa Fija	11,056,632.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/201820/05/20258.26	Tasa Fija	3,654,991.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/201831/07/20238.39	Tasa Fija	160,037.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/08/201817/08/202311.6837		

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 86 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 405,841.85	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201831/08/202311.5925
Tasa Fija 23,727.59	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/201831/08/202338.54 Tasa
Tasa Fija 37,048.82	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201829/12/202311.5925
Tasa Fija 5,501,771.07	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/201829/09/202311.5925
Tasa Fija 8,656,632.87	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201830/11/202311.5925
Tasa Fija 12,654,073.45	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201829/09/202311.5925
Tasa Fija 3,462,653.02	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.5975
Tasa Fija 247,749.47	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.5975
Tasa Fija 898,186.95	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201817/10/202311.5925
Tasa Fija 9,774,182.97	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/201828/12/202311.5855
Tasa Fija 3,203,089.47	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/01/201929/09/202311.5925
Tasa Fija 1,731,326.82	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20245.95367
Tasa Fija 6,859,922.72	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/201829/12/202311.5925
Tasa Fija 30,147,204.66	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/201930/09/202311.5925
Tasa Fija 5,828,099.95	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/202411.5962
Tasa Fija 114,374,969.12	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202411.5925
Tasa Fija 1,328,994.74	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/201931/05/202411.5925
Tasa Fija 27,187,918.87	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201914/12/202311.5975
Tasa Fija 1,364,965.04	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202411.5925
Tasa Fija 44,448,474.77	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5925
Tasa Fija 3,303,683.73	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5925
Tasa Fija 2,780,552.71	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5925
Tasa Fija 606,862.52	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.5925
Tasa Fija 10,714,504.02	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202411.5925
Tasa Fija 4,176,852.22	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202411.5925
Tasa Fija 4,730,737.66	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/202411.5925
Tasa Fija 433,472.86	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/201929/08/202311.5925
Tasa Fija 45,098,577.78	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/201915/09/202311.5995

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 87 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 228,421.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 226,159.92	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 5,225,074.61	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 5,459,033.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 1,559,723.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 1,559,723.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.5995	
Tasa Fija 1,559,723.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/201931/05/202411.5925	
Tasa Fija 13,869,047.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/202411.5925	
Tasa Fija 3,000,966.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 2,366,357.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.6032	
Tasa Fija 3,536,432.23	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/202311.5995	
Tasa Fija 114,168.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 24,713,838.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/201931/05/202411.5925	
Tasa Fija 4,791,125.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/202311.5995	
Tasa Fija 2,613,396.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/202411.5925	
Tasa Fija 1,600,515.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.608	
Tasa Fija 4,256,851.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 14,122,193.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 14,122,193.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201915/12/202311.5995	
Tasa Fija 228,421.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 5,616,529.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.6032	
Tasa Fija 2,442,841.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202411.5925	
Tasa Fija 3,883,603.02	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/202411.5925	
Tasa Fija 4,251,368.58	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202012/01/202411.6075	
Tasa Fija 7,153,446.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.598	
Tasa Fija 22,627,339.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/202411.608	
Tasa Fija 1,022,479.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.6032	
Tasa Fija 2,210,573.85	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.608	

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 88 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 4,839,368.38	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.6 Tasa Fija 361,022.22	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.83909 Tasa Fija 6,551,506.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202411.5925 Tasa Fija 7,930,405.41	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa Fija 2,415,902.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/202511.5925 Tasa Fija 60,331,742.69	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.6 Tasa Fija 5,544,305.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/202311.5975 Tasa Fija 5,593,382.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.598 Tasa Fija 5,927,808.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.598 Tasa Fija 5,233,264.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.6005 Tasa Fija 3,003,866.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 1,034,648.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 3,004,653.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 2,429,159.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.598 Tasa Fija 2,897,229.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/202411.6015 Tasa Fija 3,166,958.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.608 Tasa Fija 1,176,439.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa Fija 3,247,376.96	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/202411.5925 Tasa Fija 169,936.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/12/202311.5977 Tasa Fija 104,761.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.62 Tasa Fija 217,103.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.62 Tasa Fija 310,128.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/09/202311.5977 Tasa Fija 727,507.02	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202411.6137 Tasa Fija 264,857.99	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.6 Tasa Fija 179,007.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07 Tasa Fija 4,857,473.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.6045 Tasa Fija 4,011,604.38	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.48249 Tasa Fija 5,661,872.66	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.48249	

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 89 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 1,085,425.65	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.48249	
Tasa Fija 527,768.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20255.67249	
Tasa Fija 515,599.75	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20256.00249	
Tasa Fija 467,381.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.608	
Tasa Fija 8,012,897.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202015/11/202311.5995	
Tasa Fija 382,126.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 2,334,217.26	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 10,984,494.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 1,427,648.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 836,344.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 306,020.02	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 2,943,660.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 8,458,256.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202029/09/202311.5925	
Tasa Fija 18,111,846.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.6005	
Tasa Fija 20,676,616.68	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5925	
Tasa Fija 21,006,762.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.6005	
Tasa Fija 21,027,067.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.6005	
Tasa Fija 21,027,067.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa	
Fija 143,316.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa	
Fija 1,109,420.15	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.6 Tasa	
Fija 294,947.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa	
Fija 17,361,114.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202021/08/20235.69 Tasa	
Fija 502,449.84	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.608	
Tasa Fija 5,961,977.46	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/202511.5925	
Tasa Fija 14,431,612.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa	
Fija 1,894,017.79	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202029/09/20235.78 Tasa	
Fija 6,991,957.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202029/09/20235.59 Tasa	
Fija 8,243,084.70	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51 Tasa	

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 90 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Fija 3,275,652.77	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 1,558,813.04	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 2,005,896.04	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.6067
Tasa Fija 4,514,508.45	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 815,351.86	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.6067
Tasa Fija 4,514,508.45	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/202511.608
Tasa Fija 16,486,707.87	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/20256.11923
Tasa Fija 14,706,857.60	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.6 Tasa
Fija 8,568,472.11	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.6 Tasa
Fija 283,113.48	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.608
Tasa Fija 1,079,337.65	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.5925
Tasa Fija 61,924,696.13	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.6033
Tasa Fija 51,668,454.05	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/202311.5966
Tasa Fija 673,109.26	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/202311.5925
Tasa Fija 2,352,901.02	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/202311.5925
Tasa Fija 2,352,901.02	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/202511.5925
Tasa Fija 9,996,232.61	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.608
Tasa Fija 2,620,800.31	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.6067
Tasa Fija 60,193,444.94	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/202411.598
Tasa Fija 980,726.34	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202411.5855
Tasa Fija 2,922,688.99	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.604
Tasa Fija 10,766,375.21	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.608
Tasa Fija 1,959,882.25	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.6 Tasa
Fija 435,974.31	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.6015
Tasa Fija 140,123,173.44	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.6015
Tasa Fija 53,561,629.28	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.6125
Tasa Fija 19,208,060.74	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.5925
Tasa Fija 5,776,859.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.6033

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 91 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Tasa Fija 79,998,159.52	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202107/04/202511.598
Tasa Fija 10,283,217.22	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 1,328,995.29	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 10,887,366.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.5995
Tasa Fija 1,036,566.41	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa
Fija 4,025,942.79	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.6 Tasa
Fija 10,010,404.85	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.5855
Tasa Fija 1,524,369.71	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202107/05/202611.598
Fija 29,392,183.42	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.5995
Tasa Fija 2,533,829.11	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202115/05/202511.5995
Fija 459,000.02	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.5995
Tasa Fija 175,620,251.14	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa
Fija 113,409,434.59	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 7,113,145.37	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.76 Tasa
Fija 2,081,278.55	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 6,698,787.44	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 132,196,464.86	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 145,123,158.96	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 163,472,620.29	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.5995
Tasa Fija 963,273.85	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.6125
Tasa Fija 3,642,528.08	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202117/06/20266.29 Tasa
Fija 13,512,973.65	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa
Fija 3,020,494.52	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.5925
Tasa Fija 81,626,276.33	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/202611.5925
Tasa Fija 55,402,450.06	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/202115/07/202511.5995
Tasa Fija 2,094,073.73	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5925
Tasa Fija 296,754,778.40	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/202311.5925
Tasa Fija 40,584,814.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.5925







BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 94 / 95

CONSOLIDADO

Impresión Final

3,360,000,000.00 40,000,000.00 - - - - -  
Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL - - - - -  
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas 21,253,776,166.00  
24,146,245,336.00 2,093,000,000.00 - - 3,360,000,000.00 40,000,000.00 - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL - - - - -  
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Proveedores [sinopsis]  
Proveedores

TOTAL - - - - -  
Total proveedores - - - - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - -  
Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - -

Total de créditos 25,902,481,377.18 37,365,143,534.92 4,236,946,626.87 1,575,909,758.89  
1,877,712,808.95 3,690,320,875.59 6,680,296,444.00 3,877,863,803.73 29,516,412.05  
71,175,292.09 81,994,742.68 193,942,308.59

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 95 / 95

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Comentarios:

El tipo de cambio tomado al cierre de junio es de 17.1156

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---

## I. Información cualitativa

### a. Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.

Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.

Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión

---

del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

**Negociación:** La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

**Cobertura:** Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

**Arbitraje:** Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

Núm.Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

1. Flujos de Efectivo Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 3 / 23

CONSOLIDADO

Impresión Final

- 
2. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente. Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
  3. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante Activa Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
  4. Valor Razonable Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera Activa Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
  5. Flujos de Efectivo Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
  6. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
  7. Flujos de Efectivo Reportos Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
  8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)
  9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Subyacente\*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se

precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS

(CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de

---

---

medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)

El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.

Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.

---



Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.  
Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.  
Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear,  
medir y controlar los requerimientos de liquidez.

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.  
Diversificar fuentes de fondeo.  
Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes  
activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.  
Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de  
junio 2023 y en promedio para el segundo trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 95,96575,104

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,452113,922

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 Opciones Europea Caps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones  
call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$$\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de  
opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales  
que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$$\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos.

La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo  
subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de  
tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos  
fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma  
moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 6 / 23

CONSOLIDADO

Impresión Final

la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEL intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRSI intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{(t<T)}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

Forward Forward OTC Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Clase de

activo Derivado Tipo Breve descripción

Índices, capitales y metales Opciones

Europea Opción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

Binaria Tipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listados Mexder

Futures IRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

---

Clase de

activoDerivadoTipoBreve descripción

FI SecurityBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ CashAccionesLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas Líneas de Crédito

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

Metales

Sujetos de Crédito

Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:

Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

---

---

## Reglas Particulares

### Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure". La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar. Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

### Idoneidad del Cliente

La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

### Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

#### Métodos y técnicas de Valuación:

---

---

### Cálculo de Sensibilidades

La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L). Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

#### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).

Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.

#### Bonos de Tasa Flotante

En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.

Con metodología se asume que la 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.

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios semanales históricos, es decir una ventana de observación mayor a un año con base en un análisis de regresión.

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados:  $R^2 \geq 80\%$ .

Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de

---

---

cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de junio 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el segundo trimestre de 2023 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 actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

Cobertura de Valor Razonable:

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto, debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

Scotiabank Inverlat asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 12 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.

Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Al cierre de junio de 2023 y promedio del segundo trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,452113,922

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.

Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la

---



pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

Scotiabank

(millones de pesos) Normal Escenario Posible Escenario Probable Escenario de Estrés

Gap 30d Gap Acum 95,96593,28993,28993,289

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (2,676) (2,676) (2,676)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.

Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos

---

de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas  $\gamma_1$  y  $\gamma_5$ .

$\gamma_1$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que  $\gamma_5$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

#### Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente.

Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta 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

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 15 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2023:

Scotiabank

0-3 Meses 3 - 12 Meses 1 - 3 Años 3 - 5 Años 5 - 10 Años 10 - 30 Años Total

Swaps (67,208.03) (87,150.30) (205,016.86) 157,077.72 82,346.02 806,302.11 686,350.66

CCS 18,906.30 (3,522.27) 25.90 388.49 233.09 (12.95) 16,018.56

Caps&Floors (258.99) 3,276.23 2,175.52 77.70 --5,270.46

Binary Caps&Floors-----

TIIE Futures-----

Mbonds Futures-----

Total DERIVADOS (48,560.72) (87,396.34) (202,815.44) 157,543.91 82,579.11 806,289.16  
707,639.68

Cifras expresadas en pesos

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

Bajo el escenario probable una pérdida de (190.87) Millones de pesos.

Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (381.74) Millones de pesos.

Y finalmente con el escenario muy poco probable (918.98) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de -10%, -30% y -50% para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock (+/-) P&L Stress 1

Shock (+/-) P&L Stress 2

Shock (+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIE

y Bono M --50.00-100.000.00 200.00-

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps 0.71 188.91 50.00 (35.38) 100.00 (70.76) 200.00  
(141.53)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.04) (0.74) 0.10-0.40 (0.02) 1.00 (0.04)

a FX %Forwards 90.84 1,554.82 0.10 (155.48) 0.20 (310.96) 0.50 (777.41)

a FX %Opciones Divisa --0.10-0.20-0.50-

Total (190.86) (381.74) (918.98)

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 16 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P216,886.005,012.0077,247.00  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options MCHI.OQ335,934.004,076.0088,017.00  
Options MSFDV1.INDX---  
Options NVDA.OQ---  
Options QQQ.OQ---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPXSR5.INDX---  
TOTAL552,820.009,088.00165,264.00  
Cifras expresadas en pesos

## Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable -10%, poco probable -30% y muy poco probable -50% son los siguientes:

Escenarios a la baja(0.1) (0.3) (0.5)  
Options BNPUI5.INDX---  
Options EEM.P(21,688.60) (65,065.80) (108,443.00)  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options EZU.P---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX---  
Options MEXIBX.INDX(33,593.4) (100,780.2) (167,967)  
Options MXSXA.E.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

TOTAL (55,282.00) (165,846.00) (276,410.00)

Cifras expresadas en pesos

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)

Options BNPUI5.INDX---

Options EEM.P10,844.3032,532.9043,377.20

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options EZU.P---

Options FXI.P---

Options GLD.P---

Options ICLN.OQ---

Options IDBTV1.INDX---

Options MEXIBX.INDX16,796.750,390.167,186.8

Options MXSXAE.INDX---

Options HSCE.INDX---

Options MEXXLK.USM---

Options IBM.USM---

Options SBUX.USM---

Options IBM.USM---

Options SBUX.USM---

TOTAL27,641.0082,923.00110,564.00

Cifras expresadas en pesos

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

ScotiabankMonto

Probable(55,282.00)

Poco Probable(165,846.00)

Muy poco Probable(276,410.00)

Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN333,000,000(393,000,000)

CLIENTE 2MXN305,800,000(107,200,000)

CLIENTE 3MXN31,200,000(16,600,000)

CLIENTE 4MXN258,700,000(361,300,000)

CLIENTE 5USD60,040,000(53,710,000)

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

CLIENTE 6USD	34,460,000	(26,000,000)
CLIENTE 7USD	113,900,000	(328,200,000)
CLIENTE 8USD	520,000	(270,000)
CLIENTE 9USD	14,940,000	(3,380,000)
CLIENTE 10USD	-	(400,000)
CLIENTE 11USD	15,380,000	(19,420,000)
CLIENTE 12MXN	74,900,000	(239,100,000)
CLIENTE 13MXN	251,100,000	(256,900,000)
CLIENTE 14MXN	550,700,000	(1,822,400,000)
CLIENTE 15MXN	276,929,370	(353,789,203)
CLIENTE 16MXN	4,000,000	-
CLIENTE 17USD	5,720,000	(7,140,000)
CLIENTE 18USD	860,000	(400,000)
CLIENTE 19MXN	12,000,000	-
CLIENTE 20USD	12,110,000	(10,040,000)
TOTAL	2,356,259,370	(3,999,249,203)

Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 19 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 20 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 21 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 22 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 23 / 23

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---