Scotiabank Inverlat

Informe Trimestral T2 2024

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros	T2 2023	T3 2023	T4 2023	T1 2024	T2 2024
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	13.2%	14.8%	14.2%	13.1%	11.5%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.3%	1.5%	1.4%	1.3%	1.1%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.4%	3.3%	3.1%	3.0%	2.9%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.2%	2.1%	2.2%	2.0%	2.1%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	4.0%	4.0%	3.3%	3.4%	3.6%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	82.2%	79.8%	77.4%	76.9%	76.8%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	21.94%	22.60%	21.47%	22.01%	22.44%[1)]
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.59%	17.07%	15.99%	16.64%	17.08%[1)]
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	50.6%	49.0%	47.2%	44.4%	46.9%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

La utilidad neta al cierre del segundo trimestre alcanza $2,360 millones, una disminución de $160 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales, así como menores impuestos. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta mostró una disminución de $250 millones o 10%, debido principalmente a mayores gastos de administración y promoción; compensados parcialmente por mayores ingresos totales.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio de 2024 se ubicó en $4,970 millones, una disminución de $545 millones o 10% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales, así como menores impuestos y gastos de administración y promoción. En el periodo el PTPP creció 11%, impulsado por mayores ingresos en el margen financiero, comisiones y tarifas (netas), así como una gestión eficiente del gasto.

Scotiabank-Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2023	30-jun 2024	A/A Δ%
Ingresos por intereses	19,618	20,840	21,043	7%	38,010	41,883	10%
Gastos por intereses	(13,118)	(14,065)	(14,079)	7%	(24,851)	(28,144)	13%
Margen Financiero	**6,500**	**6,775**	**6,964**	**7%**	**13,159**	**13,739**	**4%**
Comisiones	1,024	1,114	1,301	27%	2,223	2,415	9%
Resultado por Intermediación	560	756	467	-17%	1,123	1,223	9%
Otros ingresos/egresos de la operación	208	212	87	-58%	490	299	-39%
Ingresos no Financieros	**1,792**	**2,082**	**1,855**	**4%**	**3,836**	**3,937**	**3%**
Total Ingresos	**8,292**	**8,857**	**8,819**	**6%**	**16,995**	**17,676**	**4%**
Gastos de Administración y Promoción	(4,280)	(4,053)	(4,467)	4%	(8,714)	(8,520)	-2%
PTPP [1].	**4,012**	**4,804**	**4,352**	**8%**	**8,281**	**9,156**	**11%**
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(287)	(1,034)	(1,316)	> +100%	(432)	(2,350)	> +100%
Resultado de la Operación	**3,725**	**3,770**	**3,036**	**-18%**	**7,849**	**6,806**	**-13%**
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	89	(154)	285	> +100%	168	131	-22%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad	**3,814**	**3,616**	**3,321**	**-13%**	**8,017**	**6,937**	**-13%**
Impuestos a la Utilidad	(1,294)	(1,006)	(961)	-26%	(2,502)	(1,967)	-21%
Resultado Neto	**2,520**	**2,610**	**2,360**	**-6%**	**5,515**	**4,970**	**-10%**
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	30	(254)	(253)	> -100%	82	(507)	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	(165)	125	361	> -100%	(207)	486	> -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados	4	19	4	0%	5	23	> +100%
Participación en ORI de otras entidades	-	-	9	0%	-	9	0%
Resultado Integral	**2,389**	**2,500**	**2,481**	**4%**	**5,395**	**4,981**	**-8%**

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

MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de $6,964 millones al cierre del segundo trimestre de 2024, un incremento de $464 millones o 7% respecto al mismo trimestre del año pasado, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria y automotriz; compensados parcialmente con mayores volúmenes en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de $189 millones o 3%; principalmente por mayores volúmenes de cartera hipotecaria y una mejora en la mezcla de depósitos.

El margen financiero acumulado al cierre de junio 2024 ascendió a $13,739 millones, un incremento de $580 millones o 4% respecto al mismo periodo de 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria y un día más de operación; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de $1,855 millones en el segundo trimestre de 2024, un incremento de $63 millones o 4% respecto al mismo periodo del año pasado, debido a mayores ingresos en comisiones por operaciones de crédito, avalúos, colocación de créditos y manejo de cuenta, así como una mayor utilidad en resultados por intermediación en el mercado cambiario; compensados parcialmente por una pérdida en resultados por intermediación en instrumentos financieros derivados y mayores quebrantos.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de $227 millones u 11%, debido a menores ingresos en resultados por intermediación, mayores gastos por quebrantos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación; compensados parcialmente por mayores ingresos por comisiones en operaciones de crédito. La variación en resultados por intermediación se debió principalmente a una pérdida en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de junio 2024 ascendió a $3,937 millones, un incremento de $101 millones o 3% respecto al año anterior. La variación se debe principalmente a mayores ingresos por comisiones en operaciones de crédito; así como a mayores ingresos en resultados por intermediación provenientes del mercado cambiario; compensado parcialmente por mayores quebrantos y aportaciones al IPAB.

	3 meses				6 meses		
Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2024	30-jun 2024	A/A Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	-	1	0%	2	1	-50%
Actividades Fiduciarias	53	57	57	8%	113	114	1%
Apertura de Cuenta	5	4	5	0%	11	9	-18%
Cartas de Crédito	61	81	67	10%	136	148	9%
Cheques Certificados	-	1	-	0%	1	1	0%
Cheques de caja	1	-	-	-100%	1	-	-100%
Compraventa de instrumentos financieros	3	1	1	-67%	3	2	-33%
Manejo de Cuenta	82	106	106	29%	165	212	28%
Operaciones de Crédito	378	395	512	35%	778	907	17%
Otras Comisiones y Tarifas	369	297	373	1%	864	670	-22%
Servicios de Banca Electrónica	45	149	154	> +100%	96	303	> +100%
Transferencia de Fondos	26	23	25	-4%	53	48	-9%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	**1,024**	**1,114**	**1,301**	**27%**	**2,223**	**2,415**	**9%**

	3 meses				6 meses		
Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2023	30-jun 2024	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(23)	14	(5)	-78%	12	9	-25%
Aportaciones al IPAB	(542)	(582)	(603)	11%	(1,075)	(1,185)	10%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	9	6	6	-33%	44	12	-73%
Donativos	-	-	(1)	0%	-	(1)	0%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	30	8	(13)	>-100%	36	(5)	>-100%
Ingresos por Arrendamiento	19	12	13	-32%	22	25	14%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	51	56	59	16%	97	115	19%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	719	751	724	1%	1,481	1,475	0%
Pérdida por venta de cartera de crédito	-	-	(2)	0%	-	(2)	0%
Quebrantos	(66)	(105)	(159)	>+100%	(138)	(264)	91%
Recuperaciones	11	-	3	-73%	11	3	-73%
Utilidad por venta de cartera de crédito	-	2	2	0%	-	4	0%
Resultado por adjudicación de bienes	-	50	63	0%	-	113	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	**208**	**212**	**87**	**-58%**	**490**	**299**	**-39%**

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el segundo trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $1,316 millones, un incremento de $1,029 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a mayores requerimientos de cartera comercial; vivienda, tarjeta de crédito, automotriz y menudeo.

Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de $282 millones o 27%, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial, vivienda y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de junio 2024 ascendió a $2,350 millones, un incremento de $1,918 millones respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias en cartera de tarjeta de crédito, comercial; así como por mayores requerimientos en cartera de vivienda, automotriz y consumo.

Scotiabank – Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2023	30-jun 2024	A/A Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	**(287)**	**(1,034)**	**(1,316)**	**> +100%**	**(432)**	**(2,350)**	**> +100%**

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,467 millones en el segundo trimestre de 2024, un incremento de $187 millones o 4% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a mayores gastos por compensación variable, honorarios y gastos de promoción y publicidad.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron $414 millones o 10%, debido principalmente por una mayor compensación variable.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de junio 2024 ascendieron a $8,520 millones, una disminución anual de $194 millones o 2%, debido principalmente a una menor compensación variable; parcialmente compensada por mayores honorarios, IVA, procesadores; así como gastos de promoción y publicidad.

Scotiabank – Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2023	30-jun 2024	A/A Δ%
Gastos de Personal	(2,001)	(1,768)	(2,097)	5%	(4,368)	(3,865)	-12%
Gastos de Operación	(2,279)	(2,285)	(2,370)	4%	(4,346)	(4,655)	7%
Total de Gastos de Administración y Promoción	**(4,280)**	**(4,053)**	**(4,467)**	**4%**	**(8,714)**	**(8,520)**	**-2%**

IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el segundo trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de $961 millones, una disminución de $333 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor utilidad gravable y una mayor inflación en el trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó $45 millones o 4%, principalmente por una menor utilidad gravable en el trimestre.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2024 ascendieron a $1,967 millones, una disminución anual de $535 millones o 21%, principalmente por una menor utilidad gravable y una mayor inflación del periodo.

Scotiabank – Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				6 meses		
	30-jun 2023	31-mar 2024	30-jun 2024	A/A Δ%	30-jun 2023	30-jun 2024	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(979)	(710)	(1,654)	69%	(1,941)	(2,364)	22%
Impuesto a la Utilidad Diferido	(315)	(296)	693	>-100%	(561)	397	>-100%
Total de Impuestos a la Utilidad	**(1,294)**	**(1,006)**	**(961)**	**-26%**	**(2,502)**	**(1,967)**	**-21%**

BALANCE GENERAL

Al 30 de junio de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en $869,741 millones, un incremento de $93,748 millones o 12% respecto al cierre de junio de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y deudores por reporto.

Los activos totales incrementaron $47,615 millones o 6% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes de inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental), cartera de crédito total, mayores volúmenes en otros activos (deudores por liquidación de operaciones); así como en instrumentos financieros derivados.

El total del pasivo registró $778,074 millones al 30 de junio de 2024, un incremento de $87,906 millones o 13% respecto al cierre de junio de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (acreedores por liquidación de operaciones e instrumentos financieros derivados).

El pasivo total incrementó $45,134 millones o 6% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (acreedores por liquidación de operaciones, instrumentos financieros derivados, acreedores por reporto y valores asignados por liquidar); así como préstamos bancarios y de otros organismos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	266,608	273,601	304,283	14%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	466,023	492,728	500,968	7%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	19,262	17,583	18,562	-4%
Partidas diferidas	2,861	3,303	3,429	20%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,837)	(13,524)	(14,252)	-10%
Otros Activos	37,076	48,435	56,751	53%
Total Activo	**775,993**	**822,126**	**869,741**	**12%**
Depósitos	508,629	553,302	568,429	12%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	34,690	33,035	35,278	2%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,054	9,102	9,057	0%
Otros Pasivos	145,795	145,501	173,310	19%
Total Pasivo	**698,168**	**740,940**	**786,074**	**13%**
Capital	**77,825**	**81,186**	**83,667**	**8%**
Total Pasivo y Capital	**775,993**	**822,126**	**869,741**	**12%**

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2024 alcanzó $266,557 millones, un incremento anual de $34,928 millones o 15% y de $7,693 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2024 se ubicó en $234,411 millones, un incremento anual de $17 millones y $547 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual se debió a mayores créditos de entidades gubernamentales y financieras y el incremento trimestral se debió a mayores créditos de actividad empresarial o comercial.

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,368	39,526	41,858	25%
Créditos a la Vivienda	198,261	219,338	224,699	13%
Total Préstamos de Menudeo	**231,629**	**258,864**	**266,557**	**15%**
Actividad Empresarial o Comercial	201,226	196,171	196,584	-2%
Entidades Financieras	15,909	17,815	17,695	11%
Entidades Gubernamentales	17,259	19,878	20,132	17%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	**234,394**	**233,864**	**234,411**	**0%**
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	**466,023**	**492,728**	**500,968**	**7%**

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 30 de junio de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $18,562 millones, una disminución anual de $700 millones o 4% y un incremento trimestral de $979 millones o 6%.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 30 de junio de 2024 se ubicó en $14,252 millones, una disminución anual de $1,585 millones o 10% y un incremento trimestral de $728 millones o 5%.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 76.8% al 30 de junio de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 544pb y 14pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 30 de junio de 2024 fue de 3.6%, una disminución de 40pb respecto del año anterior y un incremento de 12pb respecto al trimestre pasado.

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	19,262	17,583	18,562	-4%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,837)	(13,524)	(14,252)	-10%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	**3,425**	**4,059**	**4,310**	**26%**
Índice de morosidad	**3.97%**	**3.45%**	**3.6%**	**-40 pb**

DEPÓSITOS

El total de depósitos registró $568,429 millones al 30 de junio de 2024, un incremento anual de $59,800 millones o 12%, y de $15,127 millones o 3% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral se debió principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro y del público en general.

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	**257,433**	**292,949**	**299,048**	**16%**
Público en General	204,187	212,753	222,127	9%
Mercado de Dinero	42,770	25,168	25,282	-41%
Total Depósitos a Plazo	**246,957**	**237,921**	**247,409**	**0%**
Títulos de Crédito Emitidos	3,007	21,120	20,588	> +100%
Cuenta global de captación sin movimientos	1,232	1,312	1,384	12%
Total de Depósitos	**508,629**	**553,302**	**568,429**	**12%**

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN

Al 30 de junio de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en $9,057 millones, sin cambios significativos respecto al cierre de junio 2023 y marzo 2024.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros (millones de pesos al 30 de junio de 2024 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	**70,758**	**1,856**	**6**	**71**	**72,691**
Sin restricción:	-	-	6	71	77
Restringidos:	70,758	1,856	-	-	72,614
En operaciones de reporto	57,886	1,856	-	-	59,742
Préstamos de valores	1,482	-	-	-	1,482
Otros	11,390	-	-	-	11,390
Instrumentos financieros para cobrar o vender	**76,618**	**25,473**	**-**	**1,446**	**103,537**
Sin restricción:	75,939	25,473	-	1,446	102,858
Restringidos:	679	-	-	-	679
En operaciones de reporto	105	-	-	-	105
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	574	-	-	-	574
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	**5,018**	**-**	**-**	**-**	**5,018**
Sin restricción	5,018	-	-	-	5,018
Total	**152,394**	**27,329**	**6**	**1,517**	**181,246**

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BMORGAN_24275	**5,000,000,000**	**11.02%**	**18**	**4,992**
I_BANSAN_24271	**14,913,534,180**	**10.90%**	**2**	**14,909**

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 30 de junio de 2024 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	5,363	5,199	-	-	1,572	1,316	266	370	34,487	34,565	-	-	41,688	41,450
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	10,443	8,240	-	-	10,443	8,240

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2024)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	6,598	6,911	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	155	165	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	71	71	750	750	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	2	2	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	77	77	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	12	12	826	826	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	187	2,444	4,159	1,870	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	27,202	27,037	558,825	533,723	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	811	811	7,458	7,620	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	8	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	66,282	580	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	605	764	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	144,816	49,975	-	194,791
Créditos a entidades financieras	17,058	637	-	17,695
Créditos a entidades gubernamentales	15,356	4,776	-	20,132
Créditos al consumo	40,753	-	-	40,753
Créditos a la vivienda	220,921	3	37	220,961
Total	**438,904**	**55,391**	**37**	**494,332**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	1,779	14	-	1,793
Créditos al consumo	1,105	-	-	1,105
Créditos a la vivienda	3,731	5	2	3,738
Total	**6,615**	**19**	**2**	**6,636**

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	5,241	1,531	-	6,772
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	1,014	-	-	1,014
Créditos a la vivienda	10,688	26	6	10,720
Total	**16,999**	**1,557**	**6**	**18,562**

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)	
Saldo al 31 de marzo de 2024	**17,583**
Reestructuras	75
Recuperaciones	(378)
Castigos y quitas	(881)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	2,017
Fluctuación Tipo Cambio	146
Saldo al 30 de junio de 2024	**18,562**

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)		
Saldo al 31 de marzo de 2024		**13,524**
Más: Creación de reservas		24
Calificación		1,413
Menos: Adjudicaciones y otros		119
Castigos y quitas		762
Comercial	3	
Hipotecario	138	
Consumo	621	
Desliz cambiario		(172)
Saldo al 30 de junio de 2024		**14,252**

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	64.2%	69.2%	70.7%
Noroeste – Centro	10.4%	8.8%	8.5%
Norte	12.9%	11.1%	10.5%
Bajío	7.1%	6.3%	5.9%
Sur	5.4%	4.6%	4.4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	53.4%	58.0%	58.8%
Noroeste – Centro	15.9%	13.8%	13.6%
Norte	5.8%	5.7%	5.5%
Bajío	12.1%	12.6%	12.6%
Sur	12.8%	9.9%	9.5%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

		Reservas Preventivas Necesarias				
			Consumo			
Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	462,245	987	134	481	333	1,935
Riesgo A2	48,981	437	46	216	17	716
Riesgo B1	11,156	129	50	68	17	264
Riesgo B2	6,659	10	85	37	48	180
Riesgo B3	4,242	39	26	39	38	142
Riesgo C1	3,929	40	71	78	52	241
Riesgo C2	3,731	1	43	112	254	410
Riesgo D	10,240	1,235	73	373	1,517	3,198
Riesgo E	9,682	3,634	708	284	2,262	6,888
Total	**560,865**	**6,512**	**1,236**	**1,688**	**4,538**	**13,974**
Exceso						**278**
Reservas Constituidas						**14,252**

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 2024.

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

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	$	16
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		40
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3		3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		219
Total	**$**	**278**

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

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 30 de junio de 2024)

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,907	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	**11,209,692**	**1,907**	

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	5,106	1,201
Pagos anticipados	(557)	(130)
Comisiones cobradas por anticipado	(292)	(69)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	823	185
Plan de pensiones	1,093	255
Provisiones y otros	801	140
Otros	(433)	12
Efecto Neto en Diferido	**6,541**	**1,594**

Al 30 de junio de 2024, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	Préstamos		Financiamiento			
Vencimiento	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	Total
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	11,867	2,185	-	14,052
Largo	-	-	8,500	3,954	-	12,454
Total	**-**	**-**	**20,367**	**6,139**	**-**	**26,506**
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.65%	10.67%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	7,797	-	28	158	-	7,983
Largo	-	-	-	789	-	789
Total	**7,797**	**-**	**28**	**947**	**-**	**8,772**
Tasa Promedio	5.84%	0.00%	6.58%	5.93%	0.00%	
Total Préstamos Interbancarios	**7,797**	**-**	**20,395**	**7,086**	**-**	**35,278**

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 2024.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 jun 2023	31 mar 2024	30 jun 2024
Depósitos a la Vista	**51.2%**	**55.3%**	**54.8%**
Metropolitano	24.8%	29.3%	29.7%
Noroeste – Centro	9.1%	9.3%	7.8%
Norte	6.9%	6.8%	7.3%
Bajío	4.8%	4.6%	4.8%
Sur	5.6%	5.3%	5.2%
Depósitos Ventanilla	**40.3%**	**40.0%**	**40.6%**
Metropolitano	16.3%	15.1%	15.4%
Noroeste – Centro	4.0%	4.2%	4.6%
Norte	7.3%	8.0%	8.2%
Bajío	6.6%	7.1%	7.3%
Sur	6.1%	5.6%	5.1%
Total de Captación del Público	**91.5%**	**95.3%**	**95.4%**
Fondeo Profesional	**8.5%**	**4.7%**	**4.6%**

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional Tasa Promedio (millones de pesos al 30 de junio de 2024)	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	6.33%	3.27%
Depósitos a plazo	10.22%	0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)	30 jun 2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(1,542)
Resultado por valuación de divisas	706
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	1,120
Resultado por compraventa de divisas	951
Costos de transacción	(9)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(3)
Total	**1,223**

EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

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

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

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

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99_SCOTIAB_9-21	3,753,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	375,320,000
99_SCOTIAB_10-21	3,719,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	371,925,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_5-22	1,238,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11-22	5,528,250	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	552,825,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	75,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
99_SCOTIAB_2-23	5,542,850	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	554,285,000
99_SCOTIAB_3-23	353,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	35,360,000
83_SCOTIAB_4-23	146,267	21-nov-23	15-nov-24	360	S&P 500 Index (SPX)	14,626,700
99_SCOTIAB_5-23	2,536,050	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	253,605,000
99_SCOTIAB_6-23	1,576,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	157,660,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
83_SCOTIAB_1-24	1,661,850	27-mar-24	05-nov-24	223	Dólar - Peso (USDMXN)	166,185,000
Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2024						**3,212,361,700**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Aplicación del programa OTIS

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

a) CrediAuto

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

b) Hipotecario

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

c) Préstamo personal y préstamo de nómina

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

d) ScotiaLine

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

e) Tarjetas de crédito

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

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

A continuación, se presentan los importes que se hubieran registrado y presentado en el estado de situación financiera consolidado y en el estado consolidado de resultado integral por tipo de cartera, de no haberse aplicado el criterio contable especial, así como, el detalle de los conceptos y montos por tipo de cartera, por los cuales se haya realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 30 de junio de 2024.

		Junio 2024		
		Saldo con CCE OTIS	Efectos en Cartera y Estimación	Saldo sin CCE OTIS
Cartera comercial	$	232,618	-	232,618
Créditos de consumo		40,753	3	40,756
Créditos a la vivienda:		220,961	(13)	220,948
Etapa 1	$	494,332	(10)	494,322
Cartera comercial		1,793	-	1,793
Créditos de consumo		1,105	(8)	1,097
Créditos a la vivienda:		3,738	5	3,743
Etapa 2	$	6,636	(3)	6,633
Cartera comercial		6,828	-	6,828
Créditos de consumo		1,014	5	1,019
Créditos a la vivienda:		10,720	8	10,728
Etapa 3	$	18,562	13	18,575
Cartera de crédito	$	519,530	-	519,530
(+/-) Partidas diferidas	$	3,429	-	3,429
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios	$	(14,252)	(5)	(14,257)
Total cartera de crédito, neta	$	508,707	(5)	508,702
Total activos	**$**	**869,741**	**(5)**	**869,736**
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)	$	(2,350)	(5)	(2,355)
Resultado neto	**$**	**4,970**	**(5)**	**4,965**
Total capital contable	**$**	**83,667**	**(5)**	**83,662**
Total pasivo y capital contable	**$**	**869,741**	**(5)**	**869,736**

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 2024)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	54,989
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	15,202
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	83,659
	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,917
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)	449
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	8,080
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	7,264
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	816
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deduciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1	10,446
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	73,213
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,582
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,582
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,582
	Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios	
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,582
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	76,795
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,371

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	219
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	3,590
	Capital de nivel 2: ajustes regulatorios	
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	3,590
59	Capital total (TC = T1 + T2)	80,385
60	Activos ponderados por riesgo totales	470,684
	Razones de capital y suplementos	
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.55%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.32%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.08%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	18.65%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	8.55%
	Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)	
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
	Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)	
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica

75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
	Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2	
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	219
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,173
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
	Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de emero de 2022)	
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de 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 remediciones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones.
5	No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6	Suma de los conceptos 1 a 5.
7	No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8	Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9	Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10*	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12*	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14	No aplica.
15	Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.
16*	El monto de la inversión en cualquier acción propia que:
	la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17*	Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
19*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
	O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
	P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	Ajustes nacionales considerados:
	Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.
46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

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

78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
81	No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
82	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	46,675
BG2	Cuentas de Margen	1,273
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	181,247
BG4	Deudores por reporto	22,871
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	52,131
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(803)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	508,707
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	34,296
BG11	Bienes adjudicados (neto)	799
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,536
BG13	Inversiones permanentes	4,803
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	6,496
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,142
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,592
	Activos Intangibles (neto)	4,582
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	568,587
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	35,278
	Valores Asignados por liquidar	11,615
BG19	Acreedores por reporto	59,855
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	2,379
BG22	Instrumentos financieros derivados	49,690
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-

BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	38,801
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	956
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,190
	Pasivos por arrendamiento	1,760
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,057
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,527
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	70,198
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	388,965
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	489,226
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	80,902
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	30,507
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,379
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	1,839
BG41	Otras cuentas de registro	2,559,746

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 2024)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,917	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,917
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	449	BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) $449
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	219	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $219
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	7,264	BG 16 Activos Intangibles $4,582 más Gastos de Instalación $2,682
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	816	BG 13 Inversiones Permanentes $ 816
	PASIVO			
24	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil	8	-	
25	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles	9	-	
26	Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
27	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos	15		
28	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores	21	-	
29	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R	31	3,582	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,582
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	3,371	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,371
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	

33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
	CAPITAL CONTABLE			
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social $10,671 más Prima en Venta de Acciones $2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	54,989	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $54,989
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	1,188	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $1,188
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	14,014	BG 30 Reservas de Capital $10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($608) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($588) más Resultado Neto $4,970
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL			
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales (millones de pesos al 30 de junio de 2024)		
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	50,964	4,077
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,106	88
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	2,587	207
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	35	3
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	8,377	670
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,958	157
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	24	2
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	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%)	49	4
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%)	899	72
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%)	844	67
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,431	274
Grupo III (ponderados al 25%)	6	-
Grupo III (ponderados al 50%)	1,403	112
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	504	40
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%)	3,947	316
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	205	16

Grupo V (ponderados al 50%)	81	7
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	948	76
Grupo VI (ponderados al 20%)	5,005	400
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,383	271
Grupo VI (ponderados al 30%)	13,026	1,042
Grupo VI (ponderados al 40%)	12,747	1,020
Grupo VI (ponderados al 50%)	35,520	2,842
Grupo VI (ponderados al 70%)	38	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	29,783	2,383
Grupo VI (ponderados al 85%)	7,152	572
Grupo VI (ponderados al 100%)	43,329	3,466
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	149	12
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	16,155	1,292
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	990	79
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,547	604
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	133,911	10,713
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	695	56
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,615	129
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	8,251	660
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,553	284
Grupo IX (ponderados al 100%)	20,654	1,652
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-

Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Reburstatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,237	179
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	17	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	113	9

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	**Activos ponderados por riesgo**	**Requerimiento de capital**
Indicador de Negocio	47,444	3,796

CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 17.08% al cierre de junio 2024, 242pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.66% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).

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

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

Scotiabank-Información relativa a las características de los títulos que forman parte del Capital Neto

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

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto (millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Ref.	RUBRO	Jun-24[1)] T	Mar-24 T-1	Dic-23 T-2	Sep-23 T-3	Jun-23 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	16,769	15,792	16,280	7,799	7,585
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	470,684	464,864	471,664	461,662	456,829
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	3.25%	3.25%	3.25%	1.63%	1.63%
3a	No aplica					
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	894,365	842,238	868,289	831,882	809,032
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	1.88%	1.88%	1.88%	0.94%	0.94%
5a	No aplica					
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

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

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

Scotiabank - Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Elementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustes	Monto
1	**Capital Fundamental**	73,213
2	Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto	3,582
3	Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros	-
4	Otros ajustes	-
5	**Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto**	3,582
6	Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto	3,590
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	3,590
11	Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio	80,385
	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 on 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	80,385
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	80,385
	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	470,684

	60 de la Tabla I.1 de este anexo ajustados como es permitido bajo el régimen Suplemento al Capital Neto4	
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	894,365
	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)	17.08%
26	Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)	8.99%
27	Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto	15.55%
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)	4.16%
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	3.56%

Scotiabank- Composición del Suplemento al Capital Neto

Referencia	Descripción
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	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.
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	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.
11	Suplemento 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
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. No aplica.
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. No aplica.
17	Elementos del capital no regulatorio del Suplemento al Capital Neto antes de ajustes. Para ser calculado como: línea 12 + línea 13
	Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes
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. No aplica
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.
	Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos de Suplemento al Capital Neto
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.
	Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos
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 con el 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 especifico 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 equipos expertos por tipo de riesgo, lo anterior para garantizar una gestión adecuada tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento.

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de junio de 2024 fue de $14.15 millones y su promedio durante el segundo trimestre de 2024 fue de $15.92 millones mismo que corresponde a un 0.019% del capital neto ($82,889 millones a mayo 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Junio 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,268,483	1,219,886
Mercado de Dinero	59,032	61,578
Tipo de cambio		
Cash	9,314	5,703
Derivados	295,607	286,272
Capitales		
Derivados	7,948	9,836

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Junio 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	14.24	15.73
Tipo de cambio	0.79	2.40
Capitales	-	-
VaR Global	**14.15**	**15.92**

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 2024 muestra una pérdida máxima de $512.73 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 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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.

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

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 2024 así como el promedio del segundo trimestre de 2024 se muestra a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)[2]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US	70,772	79,257
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	149,058	137,367

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 2024 de 157.59% y 115.64% respectivamente.

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

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

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

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

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 2024 y en promedio para el segundo trimestre de 2024 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(2,791)	(2,448)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(95)	(144)

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 del cálculo de VaR.

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

1). Incluye operaciones de venta en directo y en reporto.

BAJA DE CALIFICACIÓN

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de junio 2024 y el promedio del segundo trimestre del 2024 fueron $3,599 millones y $3,715 millones, respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre corresponde a $11 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 2024, el Banco mantiene $212 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

INFORMACIÓN METODOLÓGICA

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito[1)] (Cifras al 30 de junio 2024)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.28%	2.83%
Consumo	3.88%	15.64%
Cartera Comercial	0.58%	4.04%
Total	**0.71%**	**4.44%**

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

Parámetros de Riesgo[1]. (Cifras a millones al 30 de junio 2024)	EI[2].	PI	SP
Hipotecas	224,700	1.57%	16.95%
Consumo	60,048	4.81%	72.22%
Cartera Comercial	283,639	1.71%	43.48%

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

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

TÉCNICAS DE MITIGACIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO

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

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

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

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

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS

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

Al cierre de junio 2024 y en promedio durante el segundo trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.39% y 0.39% respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS

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

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

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

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

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

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

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

RIESGO OPERACIONAL

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

METODOLOGÍA GENERAL

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

POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL

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

NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL

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

INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)

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

RIESGO LEGAL

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

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de abril - junio 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $116.1 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $45.6 millones, donde $3.7 millones corresponden al Riesgo Operacional y $41.9 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO

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

Para gestionar el Riesgo Tecnológico, el Banco cuenta con el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos 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 2024 – junio 2024 (T2 2024)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez[3]

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T2 2024		Calculo Consolidado T2 2024	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOSCOMPUTABLES					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	143,115.48	No aplica	143,115.48
SALIDAS DE EFECTIVO					
2	Financiamiento minorista no garantizado	164,832	13,301	164,832	13,301
3	Financiamiento estable	96,583	6,476	96,583	6,476
4	Financiamiento menos estable	68,249	6,825	68,249	6,825
5	Financiamiento mayorista no garantizado	286,708	101,530	286,708	101,530
6	Depósitos operacionales	158,680	38,883	158,680	38,883
7	Depósitos no operacionales	124,545	59,164	124,545	59,164
8	Deuda no garantizada	3,483	3,483	3,483	3,483
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500	No aplica	500
10	Requerimientos adicionales:	261,201	19,068	261,201	19,068
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,254	5,959	7,254	5,959
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	253,947	13,109	253,947	13,109
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	40	40	40	40
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857	2,857	2,857	2,857
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	137,296	No aplica	137,296
ENTRADAS DE EFECTIVO					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	11,480	555	11,480	555
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,354	28,581	45,354	28,581
19	Otras entradas de efectivo	16,763	16,763	16,763	16,763
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	73,598	45,899	73,598	45,899
					Importe ajustado
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	143,115	No aplica	143,115
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	91,397	No aplica	91,397
23	**COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]**	**No aplica**	**157.59**	**No aplica**	**157.59**

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

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

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

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

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $74,452 millones y depósitos a plazo tradicionales por $35,641 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,904 millones y $3,599 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $13,661 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de $25,384 millones y por operaciones de call money de $3,440 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $19,901 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de $151,687 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $106,455 millones en títulos de deuda de nivel 1, $34,310 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 $7,764 millones y $3,159 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del primer trimestre 2024: 152% – promedio del segundo trimestre 2024: 158%

El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 600 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $358 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN $5,091 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $22,527 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en $11,535 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en $8,616, millones.

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

Evolución de Activos Líquidos T2-2024	Abril	Mayo	Junio
Efectivo	6%	5%	5%
Reservas en el Banco Central	29%	32%	23%
Nivel 1	63%	60%	70%
Nivel 2ª	2%	2%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	**100%**	**100%**	**100%**

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

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Abril	Mayo	Junio
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	48%	49%	50%
Depósitos a plazo			
Del público en general	39%	38%	37%
Mercado de dinero	4%	4%	4%
Títulos de crédito emitidos	4%	3%	3%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	3%	4%	4%
De largo plazo	2%	2%	2%
Total	**100%**	**100%**	**100%**

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

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

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

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

Exposición Potencial Futura (junio 2024) (Cifras en millones de pesos)	
Con contrato de compensación	3,412
Sin contrato de compensación	9,103
Posibles llamadas de margen (junio 2024)	
Colateral en Tránsito	73
Downgrade (junio 2024)	
Baja calificación 3 niveles	3, 599

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

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,268,483
Tipo de cambio	295,607
Capitales	7,948
Total	**1,572,038**

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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 5% al cierre de junio del 2024 y en promedio durante segundo trimestre del 2024 fue de 7%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

[6] Sujeto a excepciones para algunos nombres.

Descripción [7]	Promedio T2 2024	Junio 2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	55,961	45,915
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	84,285	71,088
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	42
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	41	41
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	42
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	41	41

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 2024 y el promedio del segundo trimestre de 2024 son:

Scotiabank [8]	Posición (Cierre)[9]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	70,772	79,257
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	149,058	137,367

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

II. Información cualitativa

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

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

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

- Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y reportados independientemente.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

- En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de estás: (i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación

monetaria o depósitos en dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.

- Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el segundo trimestre de 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del segundo trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	**>1 año**	
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE										
1 Capital:	86,482.77	0.00	0.00	0.00	86,482.77	86,482.77	0.00	0.00	0.00	86,482.77
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	86,482.77	0.00	0.00	0.00	86,482.77	86,482.77	0.00	0.00	0.00	86,482.77
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	206,122.71	2,168.72	8.10	192,035.25	0.00	206,122.71	2,168.72	8.10	192,035.25
5 Depósitos estables.	0.00	90,471.58	825.58	5.72	86,738.02	0.00	90,471.58	825.58	5.72	86,738.02
6 Depósitos menos estables.	0.00	115,651.13	1,343.14	2.39	105,297.23	0.00	115,651.13	1,343.14	2.39	105,297.23
7 Financiamiento mayorista:	0.00	383,818.16	30,652.50	32,036.32	193,294.37	0.00	383,818.16	30,652.50	32,036.32	193,294.37
8 Depósitos operacionales.	0.00	40,300.18	0.00	0.00	20,150.09	0.00	40,300.18	0.00	0.00	20,150.09
9 Otro financiamiento mayorista.	0.00	343,517.98	30,652.50	32,036.32	173,144.28	0.00	343,517.98	30,652.50	32,036.32	173,144.28
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	45,866.44	2,103.76	5,673.08	6,724.96	0.00	45,866.44	2,103.76	5,673.08	6,724.96
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	45,866.44	2,103.76	5,673.08	6,724.96	0.00	45,866.44	2,103.76	5,673.08	6,724.96
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	86,482.77	635,807.32	34,924.98	37,717.51	478,537.35	86,482.77	635,807.32	34,924.98	37,717.51	478,537.35

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

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,048.82	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,048.82
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	128,796.65	39,871.54	295,807.59	354,229.29	0.00	128,796.65	39,871.54	295,807.59	354,229.29
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	8,328.47	0.00	0.00	832.85	0.00	8,328.47	0.00	0.00	832.85
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	9,340.68	4,619.80	4,691.86	8,402.86	0.00	9,340.68	4,619.80	4,691.86	8,402.86
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	91,638.78	32,103.93	129,726.08	166,313.48	0.00	91,638.78	32,103.93	129,726.08	166,313.48
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	3,934.86	4,182.54	240,868.41	168,347.19	0.00	3,934.86	4,182.54	240,868.41	168,347.19
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	1,013.10	1,101.41	81,850.63	54,260.16	0.00	1,013.10	1,101.41	81,850.63	54,260.16
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	16,566.96	66.69	2,371.87	10,332.91	0.00	16,566.96	66.69	2,371.87	10,332.91
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	61,828.06	3,781.15	8,112.07	38,769.56	0.00	61,828.06	3,781.15	8,112.07	38,769.56
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	1,228.09	0.00	0.00	1,043.88	No Aplica	1,228.09	0.00	0.00	1,043.88
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,574.55	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,574.55
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	1,119.58	No Aplica	0.00	0.00	0.00	1,119.58
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		60,599.97	3,781.15	8,112.07	33,031.55	0.00	60,599.97	3,781.15	8,112.07	33,031.55
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	255,393.97	0.00	0.00	12,769.70	No Aplica	255,393.97	0.00	0.00	12,769.70
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	413,817.37	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	413,817.37
34	**Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**115.64**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**No Aplica**	**115.64**

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

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

- Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $193,079 millones y depósitos a plazo tradicionales por $146,023 millones, Capital (fundamental y complementario) por $91,664 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $19,583 millones y $25,011 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $3,430 millones.

- Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de $351,462 millones y por operaciones mercado de dinero de $22,860 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $16,037 millones, deducciones de capital por $10,499 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $4,343 millones.

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

Promedio del primer trimestre del 2024: 112.65% – Promedio del segundo trimestre del 2024: 115.64%

El coeficiente de financiamiento neto incrementó 299pb respecto al primer trimestre del 2024, esto debido principalmente a:

a. El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 11,429 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 490 millones.
b. El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron $5,415 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Abril	Mayo	Junio
Financiamiento Estable Disponible	475,699	478,925	480,988
Financiamiento Estable Requerido	412,170	413,598	415,684
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	**115.41%**	**115.79%**	**115.71%**

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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $6.06 millones de pesos, con una plusvalía de $0.55 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	1,500	1.97	1.93	0.04
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	2,698	2.07	1.74	0.33
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	1,000	2.02	1.84	0.18
Total			**5,198.00**	**6.06**	**5.51**	**0.55**

Al cierre del segundo trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $1.35 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	177,084	0.04	(0.04)	-
Scotiabank	Pública	1_LASITE_B-1	62,776	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	329,166	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	504	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1E_FRES_*	2,988	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	4,000	-	(0.23)	(0.23)
Scotiabank	Pública	1I_PSQ_*	4,400	0.10	-	0.10
Scotiabank	Pública	1_PE&OLES_*	32,526	0.08	(0.04)	0.04
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	17,940	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	444	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	170,000	0.22	-	0.22
Scotiabank	Pública	1_LASITE_B-1	5,512	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	320,720	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	1,530	0.29	-	0.29
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	525	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	30,000	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	17,944	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_IB01_N	90	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	470	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	1,775	0.24	-	0.24
Scotiabank	Pública	1I_EWZ_*	1,300	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	2,800	0.35	-	0.35
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	11,445	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_IB01_N	550	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	45,000	0.04	(0.02)	0.02
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	90,663	0.02	-	0.02
Total			**1,333,152**	**1.72**	**(0.37)**	**1.35**

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

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

Al 30 de junio, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de $1.95 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $1.43 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $0.51 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	6.45	0.00	6.45	22.23%	1.43

Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	6.06	0.00	6.06	8.00%	0.49
Índices accionarios	0.39	0.00	0.39	4.00%	0.02
Requerimiento por riesgos específico	0.39	0.00	0.39	4.00%	0.02
Total Requerimiento de capital					**1.95**

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-24	jun-24
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	760,478	794,359
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(11,132)	(10,446)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	749,346	783,912
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	6,311	6,553
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	6,032	6,289
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)	(2,207)	(1,932)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)		
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)		
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	10,136	10,910
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	17,083	22,871
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(17,083)	(21,870)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	9	11
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)	9	1,012
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	336,181	388,965
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(253,435)	(290,435)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	82,747	98,530

Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	73,538	76,795
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	842,238	894,365
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.73%	8.59%

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

Referencia	DESCRIPCION	mar-24	jun-24
1	Activos totales	822,459	869,361
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	(797)	(816)
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	(34,762)	(41,221)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(17,074)	(21,859)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	82,747	98,530
7	Otros ajustes	(10,335)	(9,631)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	842,238	894,365

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

Referencia	DESCRIPCION	mar-24	jun-24
1	Activos totales	822,459	869,361
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(44,897)	(52,131)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(17,083)	(22,871)
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	760,478	794,359

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

CONCEPTO/PERIODO	mar-24	jun-24	Variación
Capital Básico [1)]	73,538	76,795	3,257
Activos Ajustados[2)]	842,238	894,365	52,127
Razón de Apalancamiento [3)]	8.73%	8.59%	-14pb

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 2024.

El indicador se ubicó en 8.59%, 14pb menor respecto el trimestre anterior, debido al incremento en los activos ajustados por $52,127 millones o -53pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance y partidas fuera del balance; compensado parcialmente por la mejora del capital nivel 1 de $3,257 millones o +39 pb debido principalmente al resultado neto del periodo.

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

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

	que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)
13	Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes: **a)** Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación. **b)** Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento. **c)** Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar. **d)** Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo. El monto se debe registrar con signo negativo.
14	Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
15	Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado. Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
16	Suma de las líneas 12 a 15
17	Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18	Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%. El monto se debe registrar con signo negativo.
19	Suma de las líneas 17 y 18
20	Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
21	Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22	Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

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

AGENCIAS CALIFICADORAS

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

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

DIVIDENDOS

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ

Al 30 de junio de 2024, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN$128,387 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$46,675 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 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital

Instrumentos Financieros Derivados

Informe Trimestral T2 2024

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

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

Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)	Posición (Cierre)[11]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	70,772	79,257
Liquidity Buffer	149,058	137,367

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

[11]Cifras previas a junio 2024.

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

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

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

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

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

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

SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

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

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

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS

SWAPS DE TASA DE INTERÉS

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

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

FUTUROS DE TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

FUTUROS DE BONO M

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

FUTUROS DE CETE

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

EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos). Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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

Significancia de la regresión: F > 5.

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

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

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

COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:

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

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

COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:

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

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

En adición, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia o 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 2024 y promedio del segundo trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank– (millones de pesos)	Posición (Cierre)[12]	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	149,058	137,367

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

En donde:

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

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

[12]Cifras previas a junio 2024.

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario Estrés
Gap 30d Gap Acum	70,772	67,148	67,098	67,048
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,624)	(3,674)	(3,724)

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

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

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

DELTA

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

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

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

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

GAMMA

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

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

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

VEGA

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

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

RHO

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

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

THETA

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

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

DIVIDEND RISK

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

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

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

Cifras expresadas en pesos

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Junio 28, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(29,848.00)	(75,696.00)	267,578.00	270,359.00	71,752.00	(13,169.00)	490,976.00
CCS	1,884.00	30.00	(94.00)	346.00	593.00	(17.00)	2,742.00
Caps&Floors	320.00	(75.00)	(2,489.00)	1,396.00	(14.00)	(1.00)	(863.00)
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	**(27,644.00)**	**(75,741.00)**	**264,995.00**	**272,101.00**	**72,331.00**	**(13,187.00)**	**492,855.00**

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

SUPUESTOS DE CÁLCULO.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

a) Bajo el escenario probable una pérdida de (30.49) Millones de pesos.
b) Con escenario poco probable un P&L de (61.01) Millones de pesos.
c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (127.88) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock (+/-)	P&L	Stress 1 Shock (+/-)	P&L	Stress 2 Shock (+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.49	578.43	50.00	(24.64)	100.00	(49.29)	200.00	(98.57)
Volatilidad al 1%	Caps &Floors	(0.12)	3.58	0.10	(0.01)	0.40	(0.05)	1.00	(0.12)
a FX %	Forwards	3.19	58.38	0.10	(5.84)	0.20	(11.67)	0.50	(29.19)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					**(30.49)**		**(61.01)**		**(127.88)**

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

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	89,149.00	2,632.00	21,224.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**89,149.00**	**2,632.00**	**21,224.00**

Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	(8,914.90)	(26,744.70)	(44,574.50)
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**(8,914.90)**	**(26,744.70)**	**(44,574.50)**

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

Escenarios al alza	0.05	0.15	0.2
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	4,457.45	13,372.35	17,829.80
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SLB.N	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
Total	**4,457.45**	**13,372.35**	**17,829.80**

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Escenario	Monto
Probable	(8,914.90)
Poco Probable	(26,744.70)
Muy poco Probable	(44,574.50)

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

Respecto a las llamadas de margen, al 28 de junio de 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Colateral Recibido MXN	Colateral Enviado MXN	Colateral Recibido USD	Colateral Enviado USD
CLIENTE 1	-	-	11,595,000	(6,240,000)
CLIENTE 2	672,000,000	(355,000,000)	-	-
CLIENTE 3	-	-	-	(1,895,000)
CLIENTE 4	-	-	6,220,000	(605,000)
CLIENTE 5	4,500,000	(16,400,000)	-	-
CLIENTE 6	3,116,600,545	(218,900,000)	69,150,000	(55,825,000)
CLIENTE 7	-	-	34,640,000	(19,030,000)
CLIENTE 8	-	-	40,900,000	(91,210,000)
CLIENTE 9	-	-	207,300,000	(175,200,000)
CLIENTE 10	-	-	260,000	-
SUBTOTAL	**3,793,100,545**	**(590,300,000)**	**370,065,000**	**(350,005,000)**

Contraparte	Colateral Recibido MXN	Colateral Enviado MXN	Colateral Recibido USD	Colateral Enviado USD
CLIENTE 11	-	-	15,460,000	(3,320,000)
CLIENTE 12	-	-	-	(100,000)
CLIENTE 13	-	-	12,530,000	(31,030,000)
CLIENTE 14	-	-	-	(560,000)
CLIENTE 15	41,500,000	(68,300,000)	-	-
CLIENTE 16	709,600,000	(432,500,000)	-	-
CLIENTE 17	155,200,000	(260,900,000)	71,190,000	(123,460,000)
CLIENTE 18	658,308,922	(276,525,535)	-	-
CLIENTE 19	1,200,000	-	-	-
CLIENTE 20	5,100,000	(43,300,000)	-	-
CLIENTE 21	-	-	2,440,000	(3,320,000)
CLIENTE 22	-	-	580,000	(1,710,000)
CLIENTE 23	-	-	500,000	(1,270,000)
CLIENTE 24	-	-	15,570,000	(30,280,000)
TOTAL	**5,364,009,467**	**(1,671,825,535)**	**488,335,000**	**(545,055,000)**

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

Producto	Fecha	Cliente	Divisa	Monto	Motivo del incumplimiento
Interest Rate Swap	01/04/2024	Cliente 1	MXN	(1,269,343)	En espera de Instrucción
Interest Rate Swap	01/04/2024	Cliente 2	MXN	(853,895)	En espera de Instrucción
Forward	01/04/2024	Cliente 3	MXN	129,182	En espera de Instrucción
Forward	01/04/2024	Cliente 4	MXN	135,607	En espera de Instrucción
Forward	03/04/2024	Cliente 5	MXN	3,937,537	No fondeo su cuenta
Opcion EQ	15/04/2024	Cliente 6	MXN	254,100	No reconoce la operación
Opcion EQ	16/04/2024	Cliente 7	MXN	241,088	No reconoce la operación
Forward	19/04/2024	Cliente 8	MXN	3,392,080	No fondeo su cuenta
Forward	19/04/2024	Cliente 9	MXN	6,161,930	No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap	29/04/2024	Cliente 10	MXN	(1,026,414)	En espera de Instrucción
Forward	17/05/2024	Cliente 11	USD	31,200	Banco Corresponsal no envío los fondos
Forward	17/05/2024	Cliente 12	USD	31,200	Banco Corresponsal no envío los fondos
CAP	17/05/2024	Cliente 13	MXN	11,322	No envio los fondos
Interest Rate Swap	27/05/2024	Cliente 14	MXN	439,519	No envio los fondos
Interest Rate Swap	29/05/2024	Cliente 15	MXN	(1,089,826)	En espera de Instrucción
Interest Rate Swap	12/06/2024	Cliente 16	MXN	406,000	No envio los fondos
Opcion FX	13/06/2024	Cliente 17	USD	(50,000)	Pago fuera de horario
Opcion FX	13/06/2024	Cliente 18	USD	(250,000)	Pago fuera de horario
Forward	18/06/2024	Cliente 19	MXN	52,691,300	No recibimos los fondos
Opcion FX	21/06/2024	Cliente 20	EUR	873	No envio los fondos
Interest Rate Swap	26/06/2024	Cliente 21	MXN	273,583	No envio los fondos

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

Cifras expresadas en pesos

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
P18019	01/04/2024	Active		mxn			27,000,000
P18153	01/04/2024	Active		mxn			27,000,000
SDV964	01/04/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV999	01/04/2024	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	
SDW136	01/04/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW176	01/04/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SII157	01/04/2024	Active	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	
SJJ743	01/04/2024	Active	1,270,000,000	mxn	1,270,000,000	1,270,000,000	
SJJ774	01/04/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SKK855	01/04/2024	Active	2,220,000,000	mxn	2,220,000,000	2,220,000,000	
SDU905	02/04/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SJJ820	02/04/2024	Active	1,270,000,000	mxn	1,270,000,000	1,270,000,000	
SDT955	03/04/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV395	03/04/2024	Active	125,364,000	mxn	125,364,000	125,364,000	
SDV397	03/04/2024	Active	24,339,181	mxn	24,339,181	24,339,181	
SJK106	03/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDT011	05/04/2024	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SGJ935	05/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SGJ936	05/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJK447	05/04/2024	Active	755,000,000	mxn	755,000,000	755,000,000	
SDT381	08/04/2024	Active	6,995,531	mxn	6,995,531	6,995,531	
SDT390	08/04/2024	Active	6,995,531	mxn	6,995,531	6,995,531	
SDT600	08/04/2024	Active	1,698,279	mxn	1,698,279	1,698,279	
SDT605	08/04/2024	Active	1,698,279	mxn	1,698,279	1,698,279	
SDT672	08/04/2024	Active	10,022,988	mxn	10,022,988	10,022,988	
SDT714	08/04/2024	Active	10,022,988	mxn	10,022,988	10,022,988	
SGK278	08/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJK630	08/04/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT468	09/04/2024	Active	6,983,202	mxn	6,983,202	6,983,202	
SDT577	09/04/2024	Active	6,983,202	mxn	6,983,202	6,983,202	
SGK567	09/04/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SGK593	09/04/2024	Active	1,305,000,000	mxn	1,305,000,000	1,305,000,000	
SGK597	09/04/2024	Active	435,000,000	mxn	435,000,000	435,000,000	
SGK599	09/04/2024	Active	435,000,000	mxn	435,000,000	435,000,000	
SGK603	09/04/2024	Active	543,750,000	mxn	543,750,000	543,750,000	
SGK604	09/04/2024	Active	543,750,000	mxn	543,750,000	543,750,000	
SGK627	09/04/2024	Active	326,250,000	mxn	326,250,000	326,250,000	
SGL141	09/04/2024	Active	326,250,000	mxn	326,250,000	326,250,000	
SDT019	10/04/2024	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SDV008	10/04/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGK760	10/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIJ507	10/04/2024	Active	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SIJ509	10/04/2024	Active	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	
SDT664	11/04/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDT671	11/04/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDV104	15/04/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV137	15/04/2024	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SJL898	15/04/2024	Active	780,000,000	mxn	780,000,000	780,000,000	
P17061	16/04/2024	Active		mxn			48,180,000
P17062	16/04/2024	Active		mxn			48,180,000
SDT020	16/04/2024	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000	
SDT021	16/04/2024	Active	12,000,000	mxn	12,000,000	12,000,000	
SJM203	17/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJM204	17/04/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SKN855	17/04/2024	Active	3,800,000,000	mxn	3,800,000,000	3,800,000,000	
SDU076	18/04/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDV182	19/04/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SGL809	19/04/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SGL810	19/04/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SKJ975	19/04/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SDV197	22/04/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV243	22/04/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGL924	22/04/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SJN078	23/04/2024	Active	40,609,359	mxn	40,609,359	40,609,359	
E87124	24/04/2024	Active	485,400,000	mxn			485,400,000
E89981	24/04/2024	Active	477,210,000	mxn			477,210,000
E89982	24/04/2024	Active	477,210,000	mxn			477,210,000
E89983	24/04/2024	Active	477,210,000	mxn			477,210,000
SDS965	24/04/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SJN205	24/04/2024	Active	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	1,300,000,000	
SKB848	24/04/2024	Active	3,900,000,000	mxn	3,900,000,000	3,900,000,000	
SKB857	24/04/2024	Active	1,950,000,000	mxn	1,950,000,000	1,950,000,000	
SDT013	25/04/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SJV019	25/04/2024	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
SJV596	25/04/2024	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
MTS780	29/04/2024	Active		mxn		220,000,000	
SDV451	29/04/2024	Active	3,055,000,000	mxn	3,055,000,000	3,055,000,000	
SGN206	29/04/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGN207	29/04/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGN259	29/04/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SJN744	29/04/2024	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	
C88184	30/04/2024	Active		mxn/usd	313,507,933	18,301,689	
C88185	30/04/2024	Active		usd/mxn	18,301,689	313,507,933	
P17906	30/04/2024	Active		mxn			20,000,000
P17907	30/04/2024	Active		mxn			20,000,000
P18628	30/04/2024	Active		usd			10,725,000
P18631	30/04/2024	Active		usd			10,725,000
SDT129	30/04/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDT136	30/04/2024	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SJF814	30/04/2024	Active	52,724,755	mxn	52,724,755	52,724,755	
SJF938	30/04/2024	Active	52,724,755	mxn	52,724,755	52,724,755	
SKS650	30/04/2024	Active	25,470,070	mxn	25,470,070	25,470,070	
SKS675	30/04/2024	Active	25,470,070	mxn	25,470,070	25,470,070	
P16945	02/05/2024	Active		mxn			55,000,000
P16946	02/05/2024	Active		mxn			55,000,000
P16947	02/05/2024	Active		mxn			55,000,000
P16948	02/05/2024	Active		mxn			55,000,000
SDT094	02/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT145	02/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU015	02/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU350	02/05/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDU508	02/05/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDU512	02/05/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SDV649	02/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW563	02/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGO261	02/05/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGO269	02/05/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SIN616	02/05/2024	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SJO848	02/05/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
MNF300	03/05/2024	Active		usd		40,000,000	
SDS425	03/05/2024	Active	40,000,000	usd	40,000,000	40,000,000	
SDS435	03/05/2024	Active	40,000,000	usd	40,000,000	40,000,000	
SDS454	03/05/2024	Active	40,000,000	usd	40,000,000	40,000,000	
SDT183	03/05/2024	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SGO444	03/05/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SIO317	03/05/2024	Active	500,000	usd	500,000	500,000	
SIO330	03/05/2024	Active	500,000	usd	500,000	500,000	
SJP242	03/05/2024	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	
SGN890	05/05/2024	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	
SDT244	06/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SGO235	06/05/2024	Active	25,300,000	usd	25,300,000	25,300,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJP737	08/05/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
M00143691	09/05/2024	Active		usd		4,000,000	
SDS362	09/05/2024	Active	104,000,000	mxn	104,000,000	104,000,000	
SJN920	09/05/2024	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SJN921	09/05/2024	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SKE044	09/05/2024	Active	950,000,000	mxn	950,000,000	950,000,000	
SKG304	09/05/2024	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SDT621	10/05/2024	Active	4,579,799	mxn	4,579,799	4,579,799	
SDT678	10/05/2024	Active	4,579,799	mxn	4,579,799	4,579,799	
SDT910	10/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT918	10/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU880	10/05/2024	Active	15,566,030	mxn	15,566,030	15,566,030	
SDU894	10/05/2024	Active	15,566,030	mxn	15,566,030	15,566,030	
SDV550	10/05/2024	Active	12,411,000	mxn	12,411,000	12,411,000	
SDV592	10/05/2024	Active	10,108,000	mxn	10,108,000	10,108,000	
SDV696	10/05/2024	Active	13,894,000	mxn	13,894,000	13,894,000	
SDV703	10/05/2024	Active	13,894,000	mxn	13,894,000	13,894,000	
SDV827	10/05/2024	Active	12,411,000	mxn	12,411,000	12,411,000	
SDV962	10/05/2024	Active	10,108,000	mxn	10,108,000	10,108,000	
SDW229	10/05/2024	Active	13,587,000	mxn	13,587,000	13,587,000	
SDW238	10/05/2024	Active	13,587,000	mxn	13,587,000	13,587,000	
SGP437	10/05/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SGP567	10/05/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGP569	10/05/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SGP584	10/05/2024	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	
SIP013	13/05/2024	Active	740,000,000	mxn	740,000,000	740,000,000	
SGP997	14/05/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SIP279	14/05/2024	Active	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	
SKE513	14/05/2024	Active	950,000,000	mxn	950,000,000	950,000,000	
SKE564	14/05/2024	Active	950,000,000	mxn	950,000,000	950,000,000	
SKE590	14/05/2024	Active	191,000,000	mxn	191,000,000	191,000,000	
SKE591	14/05/2024	Active	191,000,000	mxn	191,000,000	191,000,000	
SDT326	15/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SGQ333	15/05/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJQ517	15/05/2024	Active	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	1,300,000,000	
SKT877	15/05/2024	Active	63,500,000	mxn	63,500,000	63,500,000	
SKT878	15/05/2024	Active	63,500,000	mxn	63,500,000	63,500,000	
SDU940	16/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU978	16/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
MNO562	17/05/2024	Active		usd		5,000,000	
MNO563	17/05/2024	Active		usd		5,000,000	
SDY348	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
SDY350	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
SDY370	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
SDY371	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
SDY407	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
SDY410	17/05/2024	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	
MUD424	20/05/2024	Active		mxn		220,000,000	
SDT481	20/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT517	20/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT601	20/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT764	20/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGQ762	20/05/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGQ763	20/05/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGQ792	20/05/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SGQ941	20/05/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
C92726	21/05/2024	Active		mxn/usd	3,000,000,000	175,459,118	
C92728	21/05/2024	Active		usd/mxn	175,459,118	3,000,000,000	
SDT815	21/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT885	21/05/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU091	21/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGR071	21/05/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SGR092	21/05/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGR097	21/05/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJB065	21/05/2024	Active	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	
SDS524	22/05/2024	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SDS534	22/05/2024	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SDT237	22/05/2024	Active	2,532,761	mxn	2,532,761	2,532,761	
SDT251	22/05/2024	Active	2,532,761	mxn	2,532,761	2,532,761	
SDU021	22/05/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDU097	22/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGR328	22/05/2024	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SJB204	22/05/2024	Active	380,000,000	mxn	380,000,000	380,000,000	
SDU195	23/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU279	23/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU360	23/05/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SGR523	23/05/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDT254	24/05/2024	Active	13,363,560	mxn	13,363,560	13,363,560	
SDT274	24/05/2024	Active	13,363,560	mxn	13,363,560	13,363,560	
SDU536	24/05/2024	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	
SDV919	24/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
MUF303	25/05/2024	Active		mxn		100,000,000	
SGR290	25/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGR291	25/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGR332	25/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
C92552	27/05/2024	Active		mxn/usd	115,700,000	6,786,959	
C92553	27/05/2024	Active		usd/mxn	6,786,959	115,700,000	
SDU594	27/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SJS468	27/05/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SKV790	27/05/2024	Active	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000	
SKV791	27/05/2024	Active	2,650,000,000	mxn	2,650,000,000	2,650,000,000	
SDT280	28/05/2024	Active	46,666,865	mxn	46,666,865	46,666,865	
SDT300	28/05/2024	Active	46,666,865	mxn	46,666,865	46,666,865	
E81346	29/05/2024	Active	57,230,000	mxn			57,230,000
E81389	29/05/2024	Active	57,230,000	mxn			57,230,000
E81390	29/05/2024	Active	57,230,000	mxn			57,230,000
E81391	29/05/2024	Active	57,230,000	mxn			57,230,000
SDS429	29/05/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS431	29/05/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS451	29/05/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDU641	29/05/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDU728	29/05/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDU769	29/05/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SKH255	29/05/2024	Active	1,950,000,000	mxn	1,950,000,000	1,950,000,000	
SDS764	30/05/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SDT051	31/05/2024	Active	1,048,942	mxn	1,048,942	1,048,942	
SDT054	31/05/2024	Active	859,809	mxn	859,809	859,809	
SDT070	31/05/2024	Active	1,228,227	mxn	1,228,227	1,228,227	
SDT073	31/05/2024	Active	1,048,942	mxn	1,048,942	1,048,942	
SDT077	31/05/2024	Active	1,228,227	mxn	1,228,227	1,228,227	
SDT084	31/05/2024	Active	859,809	mxn	859,809	859,809	
SDT584	31/05/2024	Active	7,214,000	mxn	7,214,000	7,214,000	
SDT587	31/05/2024	Active	7,214,000	mxn	7,214,000	7,214,000	
SDU896	31/05/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU966	31/05/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV014	31/05/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDY501	31/05/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDY503	31/05/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHP478	01/06/2024	Active	27,000,000	usd	27,000,000	27,000,000	
SIP234	01/06/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SFW698	02/06/2024	Active	83,333,333	mxn	83,333,333	83,333,333	
SFW710	02/06/2024	Active	83,333,333	mxn	83,333,333	83,333,333	
SDS453	03/06/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDS469	03/06/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJU048	03/06/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SDS442	04/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS446	04/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDS466	04/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDT388	04/06/2024	Active	19,090,265	mxn	19,090,265	19,090,265	
SDT392	04/06/2024	Active	30,909,735	mxn	30,909,735	30,909,735	
SDT402	04/06/2024	Active	19,090,265	mxn	19,090,265	19,090,265	
SDT406	04/06/2024	Active	30,909,735	mxn	30,909,735	30,909,735	
SDV127	04/06/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJR615	04/06/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJR618	04/06/2024	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJU408	04/06/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJU410	04/06/2024	Active	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SJU411	04/06/2024	Active	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SDS917	05/06/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SGU359	05/06/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SJD128	05/06/2024	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	
SJU615	05/06/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
C67386	06/06/2024	Active		usd/mxn	8,700,000	154,364,100	
C67389	06/06/2024	Active		mxn/usd	154,364,100	8,700,000	
P18953	06/06/2024	Active		mxn			500,000,000
P18954	06/06/2024	Active		mxn			500,000,000
P18955	06/06/2024	Active		mxn			500,000,000
P18957	06/06/2024	Active		mxn			500,000,000
SDV172	06/06/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV347	06/06/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGU080	06/06/2024	Active	2,142,840	mxn	2,142,840	2,142,840	
SGU092	06/06/2024	Active	2,142,840	mxn	2,142,840	2,142,840	
SGU669	06/06/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJD342	06/06/2024	Active	670,000,000	mxn	670,000,000	670,000,000	
SJD344	06/06/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJD346	06/06/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDV446	07/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV497	07/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV569	07/06/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGU946	07/06/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJV312	07/06/2024	Active	660,000,000	mxn	660,000,000	660,000,000	
SJV314	07/06/2024	Active	1,350,000,000	mxn	1,350,000,000	1,350,000,000	
SJV495	07/06/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
P18494	10/06/2024	Active		mxn			148,750,000
P18495	10/06/2024	Active		mxn			148,750,000
P18496	10/06/2024	Active		mxn			148,750,000
P18497	10/06/2024	Active		mxn			148,750,000
SEB269	10/06/2024	Active	3,140,299	mxn	3,140,299	3,140,299	
SEB279	10/06/2024	Active	3,140,299	mxn	3,140,299	3,140,299	
SEE943	10/06/2024	Active	15,294,325	mxn	15,294,325	15,294,325	
SEE953	10/06/2024	Active	15,294,325	mxn	15,294,325	15,294,325	
SGV167	10/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGV365	11/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV610	12/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGV521	12/06/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SJX089	12/06/2024	Active	1,350,000,000	mxn	1,350,000,000	1,350,000,000	
SDT505	13/06/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDT513	13/06/2024	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SJX216	13/06/2024	Active	129,000,000	mxn	129,000,000	129,000,000	
SJX217	13/06/2024	Active	129,000,000	mxn	129,000,000	129,000,000	
SKG179	13/06/2024	Active	25,761,872	usd	25,761,872	25,761,872	
SKG189	13/06/2024	Active	25,761,872	usd	25,761,872	25,761,872	
MNF460	14/06/2024	Active		usd		11,000,000	
SDT124	14/06/2024	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SDT146	14/06/2024	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SDT358	14/06/2024	Active	11,000,000	usd	11,000,000	11,000,000	
SDT403	14/06/2024	Active	11,000,000	usd	11,000,000	11,000,000	
SDT666	14/06/2024	Active	11,000,000	usd	11,000,000	11,000,000	
SGV963	14/06/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SGV994	14/06/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SKZ744	17/06/2024	Active	11,000,000,000	mxn	11,000,000,000	11,000,000,000	
SKZ758	17/06/2024	Active	18,500,000,000	mxn	18,500,000,000	18,500,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SKK129	18/06/2024	Active	1,510,000,000	mxn	1,510,000,000	1,510,000,000	
SKZ949	18/06/2024	Active	3,700,000,000	mxn	3,700,000,000	3,700,000,000	
SLA028	18/06/2024	Active	3,700,000,000	mxn	3,700,000,000	3,700,000,000	
SDT214	20/06/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJF508	20/06/2024	Active	790,000,000	mxn	790,000,000	790,000,000	
SJF509	20/06/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJF514	20/06/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJF515	20/06/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJF516	20/06/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJF517	20/06/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SGX020	21/06/2024	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SJF713	21/06/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SJF717	21/06/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SEB004	23/06/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SEB015	23/06/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
P17417	24/06/2024	Active		mxn			950,000,000
P17418	24/06/2024	Active		mxn			950,000,000
P18082	24/06/2024	Active		mxn			950,000,000
P18088	24/06/2024	Active		mxn			950,000,000
SEB363	24/06/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SJF871	24/06/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SJF881	24/06/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SJG071	25/06/2024	Active	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	
SGX448	26/06/2024	Active	490,000,000	mxn	490,000,000	490,000,000	
SDU836	27/06/2024	Active	887,500,000	mxn	887,500,000	887,500,000	
SDU842	27/06/2024	Active	887,500,000	mxn	887,500,000	887,500,000	
SDW054	27/06/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJZ089	27/06/2024	Active	68,980,000	mxn	68,980,000	68,980,000	
SJZ091	27/06/2024	Active	68,980,000	mxn	68,980,000	68,980,000	
MNF394	28/06/2024	Active		mxn		62,948,402	
MWF971	28/06/2024	Active		mxn		225,000,000	
SDT968	28/06/2024	Active	62,948,402	mxn	62,948,402	62,948,402	
SDT996	28/06/2024	Active	62,948,402	mxn	62,948,402	62,948,402	
SDV004	28/06/2024	Active	6,699,721	mxn	6,699,721	6,699,721	
SDV021	28/06/2024	Active	6,699,721	mxn	6,699,721	6,699,721	
SET127	28/06/2024	Active	5,915,302	mxn	5,915,302	5,915,302	
SET272	28/06/2024	Active	5,915,302	mxn	5,915,302	5,915,302	
SHE808	28/06/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHE821	28/06/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHE825	28/06/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SID397	28/06/2024	Active	46,902,731	mxn	46,902,731	46,902,731	
SJG891	28/06/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SJG895	28/06/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104101	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104102	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104103	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104104	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,712
2104105	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104106	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104107	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104108	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,712
2106850	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106851	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106852	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106859	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2106860	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2106861	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107875	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107876	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2107877	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107887	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2107888	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2107889	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2108614	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108615	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108616	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108617	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108618	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108619	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108638	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108639	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108640	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108641	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108642	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108643	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108726	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108727	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108728	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108729	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108730	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108731	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108732	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108733	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108734	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108735	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108736	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108737	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108738	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108739	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108740	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108741	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108742	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108743	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108744	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108745	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108746	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108747	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108748	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2108749	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2108957	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108958	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108959	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108960	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108961	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108962	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108963	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108964	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108965	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108966	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108967	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108968	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109005	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109006	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109007	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109008	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109009	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109010	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109011	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109012	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109013	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109014	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109015	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109016	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109049	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109050	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109051	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109052	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109053	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109054	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109055	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109056	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109057	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109070	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109071	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109072	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109073	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109074	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109075	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109076	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109077	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109078	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109114	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109115	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109116	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109117	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109118	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109119	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109132	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109133	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109134	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109135	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109136	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109137	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109138	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109139	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109140	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109156	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109157	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109158	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109318	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109319	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109320	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109321	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109322	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109323	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109324	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109325	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109326	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109327	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109328	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109329	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109366	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109367	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109368	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109369	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109370	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109371	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109372	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109373	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109374	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2109375	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109376	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2109377	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,361
2109433	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109434	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109435	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109445	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109446	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109447	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2110030	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110031	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110032	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110033	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110034	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110035	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110036	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110037	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110038	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110039	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110040	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110041	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110042	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110043	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110044	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110045	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110046	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110047	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110048	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110049	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110050	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110051	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110052	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110053	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110054	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110055	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110056	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110057	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110058	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110059	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110060	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110061	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110062	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110063	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110064	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110065	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110066	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110067	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110068	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110069	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,111
2110070	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110071	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110072	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110073	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,111
2110074	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110075	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110076	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110077	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110222	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110223	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110224	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110225	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110226	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110227	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110228	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110229	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110230	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110231	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110232	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110233	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110234	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110235	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110236	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110237	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110238	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110239	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110240	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110241	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110242	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110243	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110244	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110245	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110246	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110247	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110248	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110249	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110250	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110251	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110252	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110253	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110254	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110255	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110256	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110257	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110258	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110259	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110260	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110261	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,111
2110262	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110263	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110264	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110265	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,111
2110266	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110267	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110268	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110269	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,111
2110402	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110403	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110404	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110405	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110406	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110407	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110408	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110409	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110410	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110411	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110412	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110413	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110414	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110415	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110416	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110417	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110418	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110419	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110420	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110421	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110422	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110423	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110424	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110425	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110426	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110427	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110428	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110429	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110430	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110431	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110432	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110433	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110434	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110435	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110436	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110437	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110474	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110475	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110476	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110477	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110478	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110479	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110480	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110481	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110482	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110483	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110484	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110485	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110486	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110487	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110488	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110489	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110490	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110491	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110492	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110493	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110494	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110495	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110496	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110497	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110498	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110499	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110500	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110501	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110502	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110503	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110504	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110505	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110506	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110507	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110508	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110509	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110561	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110562	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110563	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110564	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110565	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110566	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110567	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110568	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110569	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110570	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110571	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110572	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110573	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110574	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110575	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110576	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110577	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110578	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110579	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110580	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110581	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110582	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110583	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110584	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110585	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110586	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110587	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110588	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110589	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110590	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110591	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110592	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110593	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110594	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110595	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110596	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110597	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110598	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110599	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110600	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110601	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110602	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110603	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110604	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,722
2110605	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110606	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110607	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110608	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,722
2110609	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110610	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110611	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110612	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110613	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110614	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110615	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110616	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110617	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110618	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110619	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110620	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110621	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110622	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110623	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110624	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110625	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110626	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110627	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110628	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110629	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110630	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110631	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110632	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110633	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110634	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110635	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110636	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110637	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110638	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110639	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110640	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110641	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110642	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110643	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110644	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110645	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110646	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2110647	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2110648	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,578
2110649	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110650	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110651	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110652	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110653	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110654	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110655	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110656	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,722
2110657	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110658	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110659	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110660	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,722
2110661	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110662	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110663	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110664	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,722
2110994	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110995	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110996	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110997	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110998	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110999	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111000	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111001	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111002	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111003	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111004	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111005	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111006	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111007	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111008	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111009	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111010	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111011	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111012	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111013	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111014	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111015	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111016	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111017	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111018	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111019	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111020	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111021	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111022	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111023	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111024	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111025	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111026	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111027	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111028	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111029	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111030	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111031	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111032	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111033	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111034	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111035	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2111036	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111037	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111038	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111039	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111040	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111041	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111042	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111043	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111044	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111045	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111046	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111047	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111227	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111228	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111229	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111365	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111366	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2111367	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2111408	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111409	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111410	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111411	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111412	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111413	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111414	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111415	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111416	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111417	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111418	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111419	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111420	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111421	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111422	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111423	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111424	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111425	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111426	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111427	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111428	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111429	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111430	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111431	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111484	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111485	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111486	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111487	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111488	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111489	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111490	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111491	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111492	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111493	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111494	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111495	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111496	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111497	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111498	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111499	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111500	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111501	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111502	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111503	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111504	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111505	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111506	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111507	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111508	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111509	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111510	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111511	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111512	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111513	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111514	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111515	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111516	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111517	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111518	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111519	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111520	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111521	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111522	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111523	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111524	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111525	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111526	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111527	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111528	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111529	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111530	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111531	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111532	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111533	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111534	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111535	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111588	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111589	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111590	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111591	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111592	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111593	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111594	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111595	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111596	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111597	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111598	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111599	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111600	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111601	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111602	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111603	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111604	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111605	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111606	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111607	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111608	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111609	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111610	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111611	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111612	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111613	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111614	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111615	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111616	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111617	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111618	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111619	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111620	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111621	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111622	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111623	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111624	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111625	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111626	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111627	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111628	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111629	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111630	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111631	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111632	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111633	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111634	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111635	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111636	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111637	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111638	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111639	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2111673	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111674	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111675	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111676	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111677	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111678	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111679	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111680	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111681	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111703	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111704	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111705	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111706	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111707	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111708	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111709	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111710	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2111711	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2111869	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111870	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111871	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111872	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111873	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111874	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111902	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111903	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111904	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111905	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111906	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2111907	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2111920	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111921	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111922	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111923	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2111924	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111925	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111926	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111927	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111928	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111929	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111930	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111931	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111932	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111933	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111934	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111935	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111936	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111937	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111938	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111939	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111940	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111941	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111942	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111943	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111944	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111945	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111946	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111947	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111948	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111949	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111950	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111951	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111952	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111953	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111954	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111955	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111956	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111957	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111958	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111959	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111960	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111961	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111962	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111963	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111964	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111965	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111966	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111967	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111968	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111969	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111970	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111971	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2111972	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2111973	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112026	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112027	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112028	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112029	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,296
2112030	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112031	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112032	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112033	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,831
2112034	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112035	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112036	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112037	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,831
2112058	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112059	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2112060	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112061	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,296
2112062	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112063	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112064	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112065	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,831
2112066	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112067	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2112068	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2112069	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,831
2112110	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112111	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112112	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112113	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,632
2112117	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112118	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2112119	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2112123	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112124	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112125	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112133	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112134	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112135	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112140	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112141	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112142	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112143	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,632
2112147	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112148	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112149	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112153	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112154	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112155	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112203	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112204	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112205	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112206	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112207	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112208	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112209	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112210	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112211	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112212	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112213	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112214	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112257	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112258	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112259	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112260	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112261	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112262	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112263	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112264	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112265	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112266	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112267	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2112268	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2112269	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112270	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112271	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112272	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112273	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112274	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112275	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2112276	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112277	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112278	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112279	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112280	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112281	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112282	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112283	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112284	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112285	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112286	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112287	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112288	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112289	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112290	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2112291	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2112292	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113342	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113343	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113344	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113345	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113346	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113347	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113348	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113349	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113350	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113351	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113352	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113353	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113354	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113355	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113356	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113357	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113358	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113359	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113360	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113361	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113362	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113363	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113364	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113365	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113366	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113367	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113368	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113369	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113370	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113371	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113372	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113373	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113374	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113375	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113376	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113377	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113378	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113379	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113380	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113381	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113382	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113383	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113384	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113385	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113386	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113387	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113388	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113389	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113390	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113391	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113392	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113393	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113394	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113395	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113396	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113397	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113398	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113399	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113400	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113401	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113402	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113403	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113404	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113405	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113406	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113587	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113588	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113589	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113590	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113591	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113592	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113593	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113594	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113595	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113596	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113597	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113598	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113599	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113600	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113601	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113602	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113603	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113604	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113605	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113606	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113607	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113608	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113609	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113610	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113611	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113612	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113613	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113614	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113615	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113616	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113617	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113618	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113619	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113620	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113621	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113622	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,102
2113623	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113624	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113625	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113626	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113627	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113628	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113629	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113630	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113631	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113632	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113633	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113634	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113635	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113636	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113637	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113638	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113639	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113640	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113641	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113642	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113643	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113644	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113645	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113646	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113647	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113648	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113649	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113650	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113651	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113767	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113768	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113769	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113770	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113771	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113772	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113773	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113774	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113775	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113776	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113777	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113778	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113779	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113780	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113781	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113782	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113783	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113784	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113785	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113786	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113787	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113788	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2113789	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2113790	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115058	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115059	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115060	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115061	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115062	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115063	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115064	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115065	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115066	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115067	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115068	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115069	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115070	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115071	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115072	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115073	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115074	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115075	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115076	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115077	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115078	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115079	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115080	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115081	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115082	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115083	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115084	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115085	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115086	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115087	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115088	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115089	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115090	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115091	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115092	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115093	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115094	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115095	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115096	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115097	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115098	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115099	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115100	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115101	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115102	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115103	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115104	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115105	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115106	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115107	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115108	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115109	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115110	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115111	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115112	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115113	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115114	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115115	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115116	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115117	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115118	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115119	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115120	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115121	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115122	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115303	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115304	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115305	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115306	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115307	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115308	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115309	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115310	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115311	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115312	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115313	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115314	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115315	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115316	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115317	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115318	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115319	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115320	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115321	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115322	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115323	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115324	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115325	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115326	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115327	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115328	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115329	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115330	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115331	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115332	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115333	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115334	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115335	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115336	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115337	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115338	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,408
2115339	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115340	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115341	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115342	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115343	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115344	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115345	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115346	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115347	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115348	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115349	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115350	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115351	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115352	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115353	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115354	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115355	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115356	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115357	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115358	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115359	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115360	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115361	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115362	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115363	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115364	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115365	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115366	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115367	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115498	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115499	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115500	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115501	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115502	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115503	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,912
2115504	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115505	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115506	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115507	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115508	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115509	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115510	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115511	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115512	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115553	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115554	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115555	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115556	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115557	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115558	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,912
2115559	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115560	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115561	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115562	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115563	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115564	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115565	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115566	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115567	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115653	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115654	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115655	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115656	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115657	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115658	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115659	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115660	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115661	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115662	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115663	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115664	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115665	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115666	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115667	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115668	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115669	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115670	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115671	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115672	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115673	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115674	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115675	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115676	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115677	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115678	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115679	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115680	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115681	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115682	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115683	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115684	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115685	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115686	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115687	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115688	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115689	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115690	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115691	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115692	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115753	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115754	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115755	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115756	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115757	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115758	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115759	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115760	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115761	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115762	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115763	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115764	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115765	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115766	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115767	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115768	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,941
2115769	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115770	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115771	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115772	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115773	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115774	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115775	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115776	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115777	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115778	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115779	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115780	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115781	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115782	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115783	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115784	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115785	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115786	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115787	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115788	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,941
2115789	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115790	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2115791	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2115792	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,181
2115810	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115811	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115812	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115813	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115814	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115815	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115816	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115817	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115818	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115819	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115820	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115821	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115822	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115823	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115824	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115930	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115931	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115932	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115933	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115934	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115935	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115936	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115937	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115938	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115939	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115940	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,333
2115941	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115942	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115943	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115944	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115990	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115991	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115992	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115993	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115994	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115995	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115996	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115997	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2115998	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2115999	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116000	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116001	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116017	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116018	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116019	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116020	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116021	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116022	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116023	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116024	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116025	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116026	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116027	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116028	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116047	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,014
2116048	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116049	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116050	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116051	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,421
2116052	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,014
2116053	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116054	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2116055	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116056	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,421
2116096	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116097	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116098	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116099	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116100	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116101	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116102	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116103	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116104	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116105	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116106	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116107	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116108	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116109	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116110	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116111	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116112	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116113	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116114	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116115	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116116	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116117	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116118	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116119	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116120	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116121	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116122	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116123	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116124	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116125	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116126	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116127	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116128	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116129	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116130	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116131	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116132	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116133	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116134	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116243	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116244	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116245	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116246	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116247	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116248	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116249	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116250	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116251	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116252	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116253	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116254	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116255	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116256	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116257	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116258	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116259	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116260	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116261	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116262	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116263	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116264	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116265	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116266	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116267	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116268	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116269	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116270	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116271	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116272	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116273	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116274	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116275	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116276	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116277	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116278	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116279	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116280	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116281	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116388	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,874
2116389	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116390	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116391	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116392	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116393	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116394	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116395	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116396	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116397	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116398	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116399	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116400	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116401	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116402	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116403	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,874
2116404	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116405	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116406	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116407	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116408	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116409	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116410	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116411	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116412	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116413	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116414	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116415	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116416	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116417	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,556
2116448	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,874
2116449	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116450	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116451	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116452	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116453	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116454	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116455	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116456	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116457	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116458	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116459	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116460	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116461	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116462	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116463	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,874
2116464	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116465	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116466	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116467	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116468	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116469	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116470	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116471	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116472	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,556
2116473	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116474	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116475	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116476	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116477	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,556
2116493	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,902
2116494	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116495	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116496	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116497	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	22,105
2116498	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,902
2116499	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116500	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116501	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2116502	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	22,105
2116523	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116524	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116525	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116526	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,912
2116527	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116528	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116529	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2116530	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,912
2116567	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116568	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116569	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116570	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116571	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116572	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116573	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116574	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116575	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116576	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116577	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116578	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116579	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116580	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116581	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116582	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116583	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116584	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116585	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116586	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116587	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116588	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116589	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116590	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116591	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116592	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116593	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116594	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116595	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116596	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116597	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116598	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116599	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116600	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116601	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116602	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116603	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116604	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116605	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116654	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116655	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116656	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116657	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116658	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116659	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116660	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116661	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116662	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116663	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116664	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116665	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116666	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116667	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116668	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116669	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116670	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116671	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116672	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116673	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116674	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116675	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116676	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116677	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116678	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116679	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116680	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116681	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116682	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116683	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116684	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116685	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116686	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116687	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116688	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116689	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116690	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116691	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116692	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116897	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116898	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116899	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116900	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116901	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116902	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116903	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116904	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116905	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116906	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116927	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116928	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116929	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116930	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116931	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116932	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	297
2116933	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2116934	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116935	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2116936	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,319
2116937	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2116938	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2116939	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2116940	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,602
2116941	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2116942	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2116943	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2116944	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,602
2116970	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116971	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116972	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116973	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116974	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2116975	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116976	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116977	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116978	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116979	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2116980	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116981	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116982	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116983	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116984	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117030	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117031	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117032	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117033	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117034	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117035	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117036	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117037	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117038	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117039	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117040	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117041	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117042	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2117043	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117044	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,410
2117089	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,834

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117090	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2117091	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2117092	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2117093	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2117094	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2117095	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2117099	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2117100	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2117101	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2117102	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,834
2117103	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2117104	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2117105	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2117191	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117192	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117193	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117194	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117195	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117196	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117197	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117198	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117199	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117200	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117201	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117202	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117203	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117204	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117205	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117206	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117207	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117208	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117209	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117210	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117211	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117212	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117213	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117214	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117215	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117216	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117217	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117218	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117219	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117220	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117221	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117222	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117223	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117224	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117225	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117226	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117227	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117228	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117229	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117230	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117231	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117232	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117233	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117234	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117235	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117236	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117237	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117238	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117239	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117240	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117241	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117242	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117243	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117244	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117245	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117246	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117247	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117248	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117249	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117250	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117251	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117252	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117253	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117254	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117255	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117441	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117442	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117443	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117444	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117445	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117446	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117447	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117448	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117449	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117450	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117451	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117452	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117453	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117454	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117455	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117456	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117457	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117458	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117459	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117460	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117461	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117462	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117463	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117464	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117465	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117466	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117467	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117468	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117469	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117470	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117471	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117472	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117473	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117474	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117475	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117476	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117477	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117478	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117479	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117480	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117481	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,097
2117482	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117483	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117484	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117485	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117486	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117487	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117488	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117489	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117490	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117491	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117492	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117493	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117494	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117495	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117496	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117497	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117498	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117499	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117500	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117501	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117502	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117503	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117504	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117505	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117680	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117681	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117682	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117683	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117684	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117685	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117686	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117687	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117688	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117689	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117690	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117691	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117692	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117693	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117694	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117695	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117696	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117697	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117698	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117699	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117700	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117701	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117702	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117703	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117704	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117705	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117706	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117707	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117708	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117709	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117710	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117711	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117712	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117713	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117714	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117715	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117716	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117717	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117718	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117719	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117720	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117721	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117722	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117723	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117724	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117725	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117726	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117727	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117728	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117729	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117730	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117731	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117880	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117881	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117882	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117883	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117884	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117885	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117886	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117887	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117888	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117889	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117890	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117891	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117892	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117893	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117894	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117895	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117896	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117897	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117898	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117899	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117900	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117901	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117902	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117903	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117904	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117905	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117906	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117907	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117908	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117909	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117910	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117911	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117912	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117913	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117914	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117915	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117916	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117917	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117918	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117919	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117920	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117921	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117922	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117923	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117924	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117925	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117926	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117927	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117928	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117929	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117930	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117931	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2118086	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118087	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118088	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118089	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118090	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118091	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118092	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118093	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118094	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118095	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118096	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118097	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118098	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118099	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118100	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118101	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118102	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118103	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118104	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118105	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118138	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118139	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118140	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118141	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118142	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118143	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118144	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118145	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118146	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118147	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118148	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118149	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118150	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118151	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118152	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118153	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118154	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,988
2118155	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118156	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118157	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118183	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118184	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118185	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118186	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118191	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118192	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118193	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118194	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2118237	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118238	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118239	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118240	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118241	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118242	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118243	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118244	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118245	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118246	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118247	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118248	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118249	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118250	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118251	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118252	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118253	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118254	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118255	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118256	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118257	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118258	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118259	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118260	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118261	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118262	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118263	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118264	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118265	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118266	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118267	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118268	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118269	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118270	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118271	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118272	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118273	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118274	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118275	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118276	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118277	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118278	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118279	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118280	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118281	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118282	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118283	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118284	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118285	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118286	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118287	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118288	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118433	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118434	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118435	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118436	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118437	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118438	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118439	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118440	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118441	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118442	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118443	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118444	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118445	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118446	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118447	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118448	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118449	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118450	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118451	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118452	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118453	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118454	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118455	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118456	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118457	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118458	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118459	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118460	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118461	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118462	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118463	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118464	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118465	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118466	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118467	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118468	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118469	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118470	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118471	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118472	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118473	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118474	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118475	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118476	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118477	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118478	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118479	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118480	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118481	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118482	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118483	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118484	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118621	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118622	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118623	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118624	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,667
2118625	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118626	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118627	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118628	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,667
2118629	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118630	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118631	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118632	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,648
2118633	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118634	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118635	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118636	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,648
2118642	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118643	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118644	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118645	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118646	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118647	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118664	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118665	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118666	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118667	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118668	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118669	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118692	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118693	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118694	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118695	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118696	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118697	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,709
2118698	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118699	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118700	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118701	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118702	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118703	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118704	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118705	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118706	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118747	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118748	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118749	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118750	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118751	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118752	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,709

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118753	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118754	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118755	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118756	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118757	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118758	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118759	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118760	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118761	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118802	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,952
2118803	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118804	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118805	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118806	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2118807	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118808	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118809	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118810	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118811	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118812	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118813	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118814	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2118815	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118816	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118857	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,952
2118858	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118859	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118860	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118861	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,401
2118862	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118863	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118864	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118865	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118866	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118867	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118868	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118869	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2118870	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118871	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118926	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2118927	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118928	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118929	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118930	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2118931	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118932	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118933	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118934	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118935	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118936	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118937	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118938	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118939	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118940	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118941	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118942	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118943	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118944	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118945	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118946	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118947	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118948	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118949	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118950	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118951	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118952	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118953	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118954	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2118955	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118956	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118957	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118958	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2118959	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118960	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118961	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118962	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118963	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118964	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118965	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118966	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118967	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118968	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118969	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118970	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118971	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118972	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118973	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118974	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118975	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118976	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118977	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119094	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2119095	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119096	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119097	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119098	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2119099	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119100	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119101	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119102	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119103	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119104	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119105	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119106	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119107	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119108	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119109	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119110	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119111	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119112	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119113	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119114	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119115	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119116	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119117	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119118	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119119	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119120	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119121	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119122	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2119123	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119124	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119125	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119126	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,986
2119127	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119128	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119129	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119130	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119131	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119132	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119133	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119134	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119135	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119136	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119137	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119138	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119139	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119140	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119141	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119142	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119143	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119144	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119145	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119258	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119259	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119260	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119261	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119262	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119263	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119264	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119265	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119266	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119267	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119268	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119269	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119270	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119271	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119272	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119273	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119274	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119275	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119276	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119277	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119278	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119279	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119280	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119281	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119282	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119283	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119284	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119285	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119286	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119287	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119288	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119289	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119290	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119291	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119292	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119293	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119294	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119295	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119296	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119309	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119310	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119311	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119312	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119313	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119314	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119315	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119316	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119317	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119318	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119319	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119320	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119321	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119322	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119323	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119324	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119325	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119326	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119327	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119328	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119329	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119330	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119331	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119332	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119333	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119334	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119335	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119336	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119337	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119338	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119339	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119340	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119341	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119342	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119343	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119344	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119345	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119346	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119347	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119364	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119365	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119366	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119367	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119368	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119369	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119408	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119409	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119410	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119411	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119412	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119413	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119446	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119447	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119448	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119455	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119456	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119457	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119460	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119461	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119462	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119463	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119464	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119465	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119466	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119467	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119468	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119469	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119470	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119471	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119503	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119504	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119505	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119506	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119507	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119508	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119509	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119510	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119511	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119512	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119513	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119514	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119515	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119516	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119517	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119518	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119519	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119520	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119521	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119522	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119523	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119524	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119525	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119526	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119527	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119528	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119529	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119530	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119531	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119532	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119533	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119534	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119535	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119536	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119537	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119538	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119539	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119540	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119541	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119542	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119543	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119544	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119545	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119546	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119547	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119548	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119549	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119550	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119551	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119552	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119553	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119554	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119555	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119556	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119557	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119558	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119559	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119560	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119561	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119562	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119563	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119564	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119565	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119566	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119567	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119763	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119764	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119765	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119766	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119767	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119768	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119769	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119770	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119771	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119772	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119773	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119774	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119775	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119776	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119777	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119778	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119779	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119780	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119781	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119782	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119783	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119784	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119785	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119786	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119787	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119788	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119789	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119790	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119791	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119792	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119793	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119794	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119795	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119796	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119797	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119798	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119799	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119800	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119801	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119802	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119803	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,007
2119804	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119805	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119806	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119807	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119808	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119809	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119810	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119811	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119812	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119813	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119814	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119815	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119816	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119817	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119818	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119819	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119820	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119821	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119822	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119823	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119824	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119825	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119826	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119827	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2120023	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120024	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120025	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120026	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120027	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120028	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120029	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120030	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120031	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120032	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120033	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120034	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120035	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120036	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120037	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120038	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120039	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120040	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120041	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120042	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120043	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120044	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120045	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120046	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120047	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120048	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120049	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120050	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120051	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120052	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120053	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120054	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120055	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120056	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120057	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120058	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120059	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120060	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120061	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120062	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120063	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120064	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120065	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120066	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120067	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120068	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120069	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120070	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120071	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120072	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120073	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120074	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120075	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120076	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120077	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120078	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120079	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120080	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120081	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120082	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120083	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120084	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120085	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120086	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120087	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120243	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120244	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120245	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120246	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120247	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120248	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120249	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120250	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120251	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120252	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120253	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120254	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120255	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120256	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120257	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120258	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120259	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120260	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120261	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120262	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120263	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,505
2120264	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120265	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120266	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120267	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120268	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120269	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120270	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120271	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120272	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120273	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120274	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120275	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120276	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120277	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120278	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120279	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120280	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120281	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120282	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120283	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,505
2120284	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120285	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120286	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120287	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,223
2120288	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120289	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120290	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120291	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120292	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120293	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120294	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120295	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120296	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120297	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120298	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120299	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120300	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120301	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120302	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120303	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120304	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120305	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120306	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120307	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120493	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120494	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120495	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120496	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120497	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2120498	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,724
2120499	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120500	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120501	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120502	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2120503	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120504	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120505	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120506	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120507	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120543	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120544	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120545	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120546	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120547	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2120548	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,724
2120549	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120550	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120551	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120552	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,611
2120553	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120554	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120555	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120556	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120557	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120588	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120589	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120590	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120591	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120592	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120593	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120594	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120595	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120596	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120597	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120598	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120599	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120600	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120601	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120602	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120603	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120604	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120605	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120606	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120607	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120608	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120609	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120610	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120611	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120616	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120617	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120618	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120619	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120620	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120621	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120622	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120623	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120624	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120625	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120626	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120627	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120628	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120629	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120630	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120631	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120632	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120633	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120634	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120635	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120636	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120637	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120638	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120639	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120640	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120641	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120642	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120643	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120644	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120645	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120646	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120647	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120648	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120649	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120650	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120651	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120652	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120653	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120654	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120655	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120656	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120657	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120658	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120659	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120660	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120661	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120662	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120663	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120664	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120665	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120666	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2120667	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2120668	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120669	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120670	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120671	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120672	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120673	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120674	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120675	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120676	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120677	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120678	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120679	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120680	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120681	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120682	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120683	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120684	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120685	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120686	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120687	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120688	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120689	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120690	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120691	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120692	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120693	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120694	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120695	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120696	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120697	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120698	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120699	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120700	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120701	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120702	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120703	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120860	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120861	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120862	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120863	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120864	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120865	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120866	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120867	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120868	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120869	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120870	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120871	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120872	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120873	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120874	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120875	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120876	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120877	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120878	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120879	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120880	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120881	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120882	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120883	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120884	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120885	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120886	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120887	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120888	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120889	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120890	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120891	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120892	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120893	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120894	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120895	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120956	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120957	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120958	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120959	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120960	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120961	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120962	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120963	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120964	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120965	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120966	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120967	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120968	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120969	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120970	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120971	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120972	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120973	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120974	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120975	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120976	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120977	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120978	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2120979	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2120995	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120996	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120997	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120998	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120999	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121000	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121001	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121002	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121003	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121004	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121005	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121006	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121007	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121008	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121009	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121010	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121011	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121012	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121013	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121014	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121015	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121016	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121017	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121018	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121019	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121020	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121021	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121025	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121026	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121027	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121028	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121029	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121030	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121031	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121032	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121033	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121034	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121035	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121036	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121037	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121038	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121039	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121040	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121041	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121042	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121043	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121044	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121045	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121046	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121047	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121048	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121049	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121050	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121051	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121109	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121110	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121111	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121112	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121113	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121114	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121115	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121116	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121121	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121122	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121123	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121124	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121125	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121126	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121127	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121128	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121133	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121134	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121135	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121136	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121137	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121138	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121139	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121140	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121141	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121142	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121143	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121144	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121145	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121146	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121147	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121148	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121149	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121150	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121151	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121152	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121153	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121154	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121155	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121156	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121157	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121158	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121159	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121160	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121161	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121162	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121163	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121164	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121165	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121166	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121167	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121168	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121169	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121170	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121171	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121172	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121173	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121174	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121175	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121176	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121177	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121308	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121309	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121310	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121311	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121312	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121313	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121314	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121315	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121316	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121317	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121318	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121319	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121320	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121321	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121322	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121323	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121324	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121325	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121326	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121327	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121328	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121329	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121330	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121331	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121332	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121333	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121334	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121335	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121336	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121337	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121338	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121339	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121340	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121341	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121342	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121343	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121344	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121345	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121346	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121347	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121348	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121349	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121350	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121351	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121352	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121500	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2121504	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2121518	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121519	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121524	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121525	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121530	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121531	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121532	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121533	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121534	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121535	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121536	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121537	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121538	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121539	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121540	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121541	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121542	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121543	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121544	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121545	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121546	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121547	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121548	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121549	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121550	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121551	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121552	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121553	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121554	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121555	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121556	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121557	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121558	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121559	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121560	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121561	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121562	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121563	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121564	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121565	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121566	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121567	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121568	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121569	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121570	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121571	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121572	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121573	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121574	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121575	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121576	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121577	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121578	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121579	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121580	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121581	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121582	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121583	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121584	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121585	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121586	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121587	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121588	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121589	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121590	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121591	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121592	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121593	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121594	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121595	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121596	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121597	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121598	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121599	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121600	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121601	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121605	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121606	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121607	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121608	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121609	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121610	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121611	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121612	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121613	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121614	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121615	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121616	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121617	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121618	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121619	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121620	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121621	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121622	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121623	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121624	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121625	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121626	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121627	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121628	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121629	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121630	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121631	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121632	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121633	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121634	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121635	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121636	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121637	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121638	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121639	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121640	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121641	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121642	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121643	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121644	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121645	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121646	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121647	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121648	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121649	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121650	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121651	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121652	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121653	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121654	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121655	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121659	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121660	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121661	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121662	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121663	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121664	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121665	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121666	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121667	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121668	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121669	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121670	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121671	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121672	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121673	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121674	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121675	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121676	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121677	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121678	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121679	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121680	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121681	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121682	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121683	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121684	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121685	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121686	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121687	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121688	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121689	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121690	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121691	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121692	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121693	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121694	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121695	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121696	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121697	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121698	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121699	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121700	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121701	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121702	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121703	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121704	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121705	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121706	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121707	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121708	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121709	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121766	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121767	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121768	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121769	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,343
2121770	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121771	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121772	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121773	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,773
2121794	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121795	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121796	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121797	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,343
2121798	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121799	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121800	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121801	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,773
2121828	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000,000
2121829	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000,000
2121900	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121901	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121902	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121903	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121904	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121905	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121906	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121907	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121908	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121909	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121910	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121911	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121939	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121940	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121941	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121942	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121943	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121944	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121945	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121946	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121947	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121948	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121949	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121950	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121978	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121979	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121980	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	TRIGGERED	300,000
2121981	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121982	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121983	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2121984	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121985	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2121988	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121989	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121990	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	TRIGGERED	300,000
2121991	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121992	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121993	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2121994	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121995	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2122015	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122016	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122017	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122018	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122019	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122060	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122061	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122062	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122063	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122064	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122365	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122366	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122367	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122368	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122369	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122370	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122371	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122372	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122373	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122374	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122375	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122376	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122377	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122378	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122385	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122386	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122387	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122388	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122389	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122390	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122391	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122392	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122393	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122394	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122395	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122396	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122397	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122398	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122405	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122406	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122407	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122408	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122409	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122410	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122411	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122412	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122413	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122414	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122415	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122416	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122417	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122418	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122419	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122420	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122421	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122422	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122423	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122424	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122425	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122426	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122427	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122428	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122429	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122430	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122431	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122432	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122433	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122434	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122435	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122436	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	122,012
2122437	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122438	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122439	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122440	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	122,012
2122441	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122442	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122443	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122444	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	122,012
2122445	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122446	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122447	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122448	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	122,012
2122449	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122451	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,747,500
2122452	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	122,012
2122479	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122480	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122481	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122482	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122483	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122484	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122485	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122486	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122487	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122488	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122489	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122490	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122491	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122492	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122493	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122494	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122495	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122496	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122497	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122498	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122499	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122500	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122501	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122502	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122503	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122504	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122505	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122506	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122507	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122508	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122509	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122510	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	101,744
2122511	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122512	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122513	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122514	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	101,744
2122515	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122516	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122517	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122518	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	101,744
2122519	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122520	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122521	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122522	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	101,744
2122523	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122524	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,125,000
2122525	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,125,000
2122526	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	101,744
2122527	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122528	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122529	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122530	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122531	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122532	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122533	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122534	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122535	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122536	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122537	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122538	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122539	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122540	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122541	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122542	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122543	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122544	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122545	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122546	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122547	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122548	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122549	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122550	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122551	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122552	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122553	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122554	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122555	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122556	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122557	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122558	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,581
2122559	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122560	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122561	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122562	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,581

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122563	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122564	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122565	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122566	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,581
2122567	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122568	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122569	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122570	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,581
2122571	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122572	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	325,000
2122573	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	325,000
2122574	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	10,581
2122575	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122576	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122577	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122578	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122579	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122580	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122581	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122582	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122583	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122584	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122585	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122586	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122587	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122588	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122589	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122590	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122591	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122592	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122593	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122594	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122595	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122596	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122597	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122598	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122599	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122600	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122601	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122602	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122603	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122604	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122605	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122606	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,547
2122607	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122608	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122609	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122610	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,547
2122611	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122612	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122613	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122614	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,547
2122615	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122616	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122617	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122618	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,547
2122619	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122620	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,500
2122621	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,500
2122622	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,547
2122671	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122672	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122673	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122674	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122675	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122676	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122677	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122678	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122679	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122680	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122681	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122682	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122683	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122684	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122685	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122686	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122687	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122688	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122689	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122690	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122691	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122692	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122693	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122694	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122695	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122696	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122697	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122698	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122699	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122700	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122701	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122702	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,140
2122703	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122704	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122705	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122706	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,140
2122707	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122708	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122709	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122710	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,140
2122711	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122712	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122713	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122714	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,140
2122715	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122716	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2122717	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2122718	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,140
2122719	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,747,500
2122888	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2122889	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2122920	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,098,080
2122921	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,098,080
2122922	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122923	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122924	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2122925	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122926	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2122927	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2122928	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2122929	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2122934	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,098,080
2122935	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,098,080
2122936	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122937	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122938	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2122939	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2122940	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2122941	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2122942	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2122943	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2123116	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123117	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	899,177
2123118	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123119	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123120	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123121	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123122	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	331,650
2123123	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123124	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123125	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123126	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123127	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123128	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123129	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123130	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123137	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123138	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	899,177
2123139	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123140	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123141	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123142	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123143	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	331,650
2123144	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123145	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123146	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123147	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123148	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123149	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123150	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123151	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123186	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123187	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	899,177
2123188	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123189	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123190	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123191	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123192	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	331,650
2123193	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123194	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123195	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123196	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123197	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123198	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123199	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123200	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123207	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123208	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	899,177
2123209	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	899,177
2123210	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123211	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123212	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123213	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	331,650
2123214	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123215	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	331,650
2123216	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123217	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123218	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123219	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123220	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	322,118
2123221	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	322,118
2123228	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	850,534

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123229	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	850,534
2123230	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123231	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123232	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	134,325
2123233	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123234	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123235	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123236	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123237	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123242	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	850,534
2123243	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	850,534
2123244	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123245	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123246	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	134,325
2123247	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123248	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123249	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123250	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123251	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123256	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123257	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123258	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123259	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123260	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123261	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123262	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	57,568
2123263	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123264	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123265	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123266	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123267	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123268	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123269	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123270	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123277	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123278	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123279	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123280	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123281	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123282	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123283	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	57,568
2123284	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123285	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123286	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123287	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123288	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123289	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123290	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123291	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123298	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	850,534
2123299	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	850,534
2123300	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123301	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123302	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	134,325
2123303	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123304	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123305	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123306	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123307	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123312	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	850,534
2123313	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	850,534
2123314	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123315	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123316	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	134,325

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123317	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	134,325
2123318	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123319	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123320	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	355,154
2123321	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	355,154
2123326	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123327	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	364,515
2123328	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123329	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123330	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123331	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123332	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	57,568
2123333	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123334	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123335	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123336	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123337	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123338	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123339	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123340	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123347	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123348	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	364,515
2123349	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	364,515
2123350	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123351	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123352	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123353	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	57,568
2123354	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123355	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	57,568
2123356	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123357	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123358	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123359	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123360	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	152,209
2123361	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	152,209
2123396	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,098,080
2123397	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,098,080
2123398	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2123399	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2123400	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2123401	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2123402	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2123403	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2123404	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2123405	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2123410	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,098,080
2123411	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,098,080
2123412	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2123413	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2123414	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	773,850
2123415	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	773,850
2123416	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2123417	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2123418	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	751,609
2123419	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	751,609
2123426	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123427	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123428	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123429	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123430	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123431	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123432	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123433	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123434	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123435	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123436	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123437	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123438	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123439	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123440	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123441	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123456	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123457	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123458	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123459	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123460	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123461	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123462	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123463	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123464	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123465	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123466	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123467	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123468	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123469	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123470	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123471	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123486	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,204,267
2123487	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,204,267
2123488	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	724,597
2123489	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	724,597
2123490	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	724,597
2123491	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	724,597
2123492	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,491,231
2123493	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,491,231
2123494	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,491,231
2123495	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,491,231
2123500	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,204,267
2123501	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,204,267
2123502	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	724,597
2123503	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	724,597
2123504	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	724,597
2123505	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	724,597
2123506	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,491,231
2123507	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,491,231
2123508	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,491,231
2123509	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,491,231
2123514	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	516,114
2123515	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	516,114
2123516	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	516,114
2123517	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123518	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541
2123519	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541
2123520	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123521	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541
2123522	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123523	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123524	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,067,670
2123525	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123526	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123527	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123528	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123535	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	516,114
2123536	FX	abr-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	516,114
2123537	FX	abr-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	516,114
2123538	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123539	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541
2123540	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123541	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123542	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	310,541
2123543	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	310,541
2123544	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123545	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,067,670
2123546	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123547	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123548	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123549	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,067,670
2123564	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123565	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123566	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123567	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123568	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123569	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123570	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123571	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123580	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123581	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123582	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123583	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123584	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123585	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123586	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123587	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123606	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	505,955
2123607	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	505,955
2123608	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,206,318
2123609	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,206,318
2123610	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,206,318
2123611	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,206,318
2123635	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	505,955
2123636	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	505,955
2123637	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,206,318
2123638	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,206,318
2123639	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,206,318
2123640	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,206,318
2123645	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123646	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123647	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123648	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123649	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123650	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123651	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123652	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123653	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123654	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123655	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123656	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123657	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123658	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123659	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123720	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123721	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123722	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123723	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123724	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123725	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123726	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123727	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123728	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123729	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123730	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123731	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123732	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123733	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123734	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123795	FX	may-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	200,000
2123798	FX	may-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	200,000
2123803	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123804	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123805	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123806	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	956
2123807	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123808	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123809	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123810	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	956
2123835	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123836	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123837	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123838	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	956
2123839	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123840	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123841	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123842	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	956
2123869	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123870	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123871	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123872	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123873	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123874	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123875	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123876	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123877	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123878	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123879	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123880	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123881	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123882	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123883	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123884	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123885	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123886	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123887	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123888	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123889	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123890	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123891	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123892	FX	may-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123893	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123894	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123895	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123896	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123897	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123898	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123899	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,330,000
2123900	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,330,000
2123925	FX	may-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXERCISED	150,000
2123926	FX	may-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXERCISED	150,000
2124066	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124067	FX	may-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124285	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124286	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124287	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124339	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124340	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124341	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2124419	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	760,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124420	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	AMER	NEGO	EXPIRED	760,000
2124433	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124434	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124435	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124436	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124481	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,283
2124482	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2124483	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124484	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2124725	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124726	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124727	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124731	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124732	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124733	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2124737	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124738	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124739	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125087	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125088	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125089	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125090	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125091	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125092	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125093	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125094	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125095	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125096	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125097	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125098	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125099	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125100	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125101	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125102	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2125103	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125104	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125127	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125128	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125153	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125154	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125155	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125156	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	777
2125201	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125202	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125203	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125204	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	777
2125253	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000,000
2125254	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,000,000
2125255	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,000,000
2125259	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000,000
2125260	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,000,000
2125261	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,000,000
2125290	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125291	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125292	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125293	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	765
2125318	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125319	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125320	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125321	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	765
2125362	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125363	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125364	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125365	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY	P/C	CCY	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125366	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125367	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125368	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125369	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125370	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125392	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125393	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125394	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125395	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125396	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125397	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125398	FX	jun-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125399	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125400	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125422	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXERCISED	135,000
2125423	FX	jun-24	USD	CALL	MXN	AMER	NEGO	EXERCISED	135,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024010303244	SO	USDMXN	04/01/2024	(321,959)	17.31094	5,573,411
2024022803108	B	USDMXN	04/01/2024	30,000,000	17.175	(515,250,000)
2024022803112	B	USDMXN	04/01/2024	30,000,000	17.175	(515,250,000)
2024022803624	B	USDMXN	04/01/2024	30,000,000	17.1828	(515,484,000)
2024030603163	S	USDMXN	04/01/2024	(40,000,000)	16.928	677,120,000
2024030803695	SO	USDMXN	04/01/2024	(414,000)	16.86531	6,982,236
2024031903582	SO	USDMXN	04/01/2024	(442,000)	16.91282	7,475,466
2024031903779	S	USDMXN	04/01/2024	(50,000,000)	16.8597	842,985,000
2024032603020	B	USDMXN	04/01/2024	1,000,000	16.67724	(16,677,240)
2024022803791	B	USDMXN	04/01/2024	30,000,000	17.1937	(515,811,000)
2024032603001	B	USDMXN	04/01/2024	50,000,000	16.70295	(835,147,500)
2024032603073	B	USDMXN	04/01/2024	108,944,930	16.68793	(1,818,064,820)
2024032603117	B	USDMXN	04/01/2024	108,944,930	16.675	(1,816,656,707)
2024032603121	S	USDMXN	04/01/2024	(156,613)	16.6766	2,611,769
2024032703207	B	USDMXN	04/01/2024	75,323,893	16.60725	(1,250,922,718)
2024032703329	B	USDMXN	04/01/2024	75,268,332	16.60725	(1,250,000,000)
2024032703220	S	USDMXN	04/01/2024	(323,893)	16.52677	5,352,900
2024032703286	S	USDMXN	04/01/2024	(99,470,868)	16.59	1,650,221,707
2024032703418	S	USDMXN	04/01/2024	(8,696,356)	16.53201	143,768,259
2024040103085	S	USDMXN	04/01/2024	(75,000,000)	16.623	1,246,725,000
2023111503576	BO	EURMXN	04/02/2024	200,000	19.34274	(3,868,548)
2023071203631	BO	USDMXN	04/02/2024	38,462	17.72245	(681,632)
2023092703615	S	USDMXN	04/02/2024	(98,501)	18.22985	1,795,651
2023100503452	SO	USDMXN	04/02/2024	(100,000)	18.82051	1,882,051
2023101803217	SO	USDMXN	04/02/2024	(95,862)	18.79317	1,801,551
2023110703545	SO	USDMXN	04/02/2024	(100,178)	17.88215	1,791,398
2023111403364	S	USDMXN	04/02/2024	(100,908)	17.83214	1,799,405
2023112103767	BO	USDMXN	04/02/2024	2,890	17.59393	(50,850)
2023112103395	S	USDMXN	04/02/2024	(102,506)	17.61644	1,805,791
2024013103092	S	USDMXN	04/02/2024	(20,000,000)	17.2915	345,830,000
2024020803385	SO	USDMXN	04/02/2024	(115,821)	17.27088	2,000,331
2024022803289	SO	USDMXN	04/02/2024	(116,411)	17.19025	2,001,134
2024031303519	BO	USDMXN	04/02/2024	60,000	16.73308	(1,003,985)
2024031403645	S	USDMXN	04/02/2024	(293,000)	16.75805	4,910,109
2024032603831	B	USDMXN	04/02/2024	126,650	16.6685	(2,111,066)
2024032703865	B	USDMXN	04/02/2024	5,000,000	16.56425	(82,821,250)
2024032704044	B	USDMXN	04/02/2024	2,250,000	16.54351	(37,222,898)
2024032703446	S	USDMXN	04/02/2024	(20,000,000)	16.523	330,460,000
2024032703551	S	USDMXN	04/02/2024	(2,143,748)	16.54769	35,474,077

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024032704137	S	USDMXN	04/02/2024	(3,000,000)	16.56516	49,695,480
2024032703292	B	USDMXN	04/02/2024	101,671,967	16.59245	(1,686,987,036)
2024032703419	B	USDMXN	04/02/2024	8,696,356	16.5345	(143,789,892)
2024032703708	B	USDMXN	04/02/2024	2,000,000	16.55555	(33,111,100)
2024040103086	B	USDMXN	04/02/2024	75,000,000	16.62535	(1,246,901,250)
2024040103087	S	USDMXN	04/02/2024	(365,601)	16.61097	6,072,989
2024040103767	S	USDMXN	04/02/2024	(81,000,000)	16.64	1,347,840,000
2024030103312	B	EURUSD	05/02/2024	100,000,000	1.08562	(108,562,310)
2024042903488	B	EURUSD	05/02/2024	2,000,000	1.0723	(2,144,600)
2024042903329	S	EURUSD	05/02/2024	(2,000,000)	1.07229	2,144,580
2024043003291	S	EURUSD	05/02/2024	(50,000,000)	1.06762	53,380,934
2024043003294	S	EURUSD	05/02/2024	(50,000,000)	1.06771	53,385,400
2024010303416	BO	USDMXN	05/02/2024	30,528	17.38571	(530,751)
2024010303529	BO	USDMXN	05/02/2024	56,532	17.38908	(983,039)
2024013003111	B	USDMXN	05/02/2024	88,880,000	17.49	(1,554,511,200)
2024021403418	BO	USDMXN	05/02/2024	95,930	17.32047	(1,661,553)
2024022603575	BO	USDMXN	05/02/2024	59,200	17.27992	(1,022,971)
2024032503811	BO	USDMXN	05/02/2024	49,200	16.78002	(825,577)
2024040103861	BO	USDMXN	05/02/2024	74,400	16.72236	(1,244,144)
2024040203526	BO	USDMXN	05/02/2024	148,800	16.64141	(2,476,243)
2024040203706	BO	USDMXN	05/02/2024	83,200	16.64055	(1,384,494)
2024040903726	BO	USDMXN	05/02/2024	48,171	16.44889	(792,359)
2024041203397	SO	USDMXN	05/02/2024	(496,000)	16.52307	8,195,443
2024041603303	S	USDMXN	05/02/2024	(50,000,000)	17.075	853,750,000
2024042303375	BO	USDMXN	05/02/2024	20,400	16.99758	(346,751)
2024042403607	BO	USDMXN	05/02/2024	77,328	17.06548	(1,319,639)
2024042403631	BO	USDMXN	05/02/2024	13,562	17.0903	(231,779)
2024042903160	B	USDMXN	05/02/2024	1,000,000	17.03149	(17,031,490)
2024042903215	B	USDMXN	05/02/2024	1,000,000	17.02737	(17,027,370)
2024042903232	B	USDMXN	05/02/2024	200,000	17.0435	(3,408,700)
2024042903328	B	USDMXN	05/02/2024	1,000,000	17.00351	(17,003,510)
2024042903392	S	USDMXN	05/02/2024	(30,000,000)	17.02	510,600,000
2024042903597	S	USDMXN	05/02/2024	(40,000,000)	17.0288	681,152,000
2024042903646	S	USDMXN	05/02/2024	(3,500,000)	17.03	59,605,000
2024042903650	S	USDMXN	05/02/2024	(44,853)	17.03694	764,152
2024042903793	S	USDMXN	05/02/2024	(607,674)	17.01511	10,339,640
2024042903803	S	USDMXN	05/02/2024	(64,942)	17.01229	1,104,809
2024043003209	B	USDMXN	05/02/2024	41,417,000	17.07525	(707,205,629)
2024043003213	S	USDMXN	05/02/2024	(41,417,000)	17.07525	707,205,629
2024040903433	B	USDMXN	05/02/2024	50,000,000	16.4579	(822,895,000)
2024042903062	B	USDMXN	05/02/2024	100,000,000	17.081	(1,708,100,000)
2024042903153	B	USDMXN	05/02/2024	50,000,000	17.04	(852,000,000)
2024042903073	S	USDMXN	05/02/2024	(447,817)	17.0779	7,647,771
2024042903098	S	USDMXN	05/02/2024	(70,250,000)	17.08545	1,200,252,863
2024042903138	S	USDMXN	05/02/2024	(58,580,000)	17.07545	1,000,279,861
2024042903140	S	USDMXN	05/02/2024	(38,170,000)	17.07545	651,769,927
2024042903711	S	USDMXN	05/02/2024	(25,000,000)	17.028	425,700,000
2024043003026	B	USDMXN	05/02/2024	54,429,838	17.0607	(928,611,139)
2024050203419	B	USDMXN	05/02/2024	118,000,000	16.94	(1,998,920,000)
2024050203422	S	USDMXN	05/02/2024	(118,000,000)	16.94	1,998,920,000
2024040103079	B	EURUSD	04/03/2024	1,000,000	1.07473	(1,074,730)
2024040103114	B	EURUSD	04/03/2024	1,000,000	1.07424	(1,074,240)
2024040103212	B	EURUSD	04/03/2024	1,000,000	1.07329	(1,073,290)
2024040103244	B	EURUSD	04/03/2024	1,000,000	1.07349	(1,073,490)
2024040103083	S	EURUSD	04/03/2024	(1,000,000)	1.07454	1,074,540
2024040103126	S	EURUSD	04/03/2024	(1,000,000)	1.07381	1,073,810
2023100903444	BO	USDMXN	04/03/2024	56,496	18.73991	(1,058,730)
2023121803833	BO	USDMXN	04/03/2024	12,800	17.46906	(223,604)
2024021403206	BO	USDMXN	04/03/2024	60,000	17.23347	(1,034,008)
2024021603678	BO	USDMXN	04/03/2024	25,600	17.15792	(439,243)
2024022103683	BO	USDMXN	04/03/2024	50,000	17.16994	(858,497)
2024022803690	BO	USDMXN	04/03/2024	40,000	17.1961	(687,844)
2024022803828	BO	USDMXN	04/03/2024	124,100	17.18886	(2,133,138)
2024022903259	BO	USDMXN	04/03/2024	40,000	17.14106	(685,642)
2024030403935	BO	USDMXN	04/03/2024	141,250	17.04156	(2,407,120)
2024030803705	B	USDMXN	04/03/2024	233,000	16.86513	(3,929,575)
2024031103677	BO	USDMXN	04/03/2024	17,550	16.861	(295,911)
2024031303645	BO	USDMXN	04/03/2024	75,000	16.73525	(1,255,144)
2024032003414	BO	USDMXN	04/03/2024	72,660	16.71798	(1,214,728)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024032503809	BO	USDMXN	04/03/2024	34,300	16.70217	(572,884)
2024040103082	B	USDMXN	04/03/2024	2,000,000	16.62672	(33,253,440)
2024040103227	B	USDMXN	04/03/2024	1,000,000	16.65455	(16,654,550)
2024040103830	B	USDMXN	04/03/2024	85,000	16.65044	(1,415,287)
2024040103078	S	USDMXN	04/03/2024	(1,000,000)	16.61246	16,612,460
2024040103100	S	USDMXN	04/03/2024	(1,000,000)	16.64866	16,648,660
2024040103390	S	USDMXN	04/03/2024	(1,000,000)	16.6669	16,666,900
2024040103485	S	USDMXN	04/03/2024	(1,000,000)	16.66084	16,660,840
2024040103493	S	USDMXN	04/03/2024	(1,000,000)	16.6612	16,661,200
2024040103496	S	USDMXN	04/03/2024	(40,000,000)	16.635	665,400,000
2024040103709	S	USDMXN	04/03/2024	(50,000,000)	16.641	832,050,000
2024040103969	S	USDMXN	04/03/2024	(3,000,000)	16.6238	49,871,400
2024040103970	S	USDMXN	04/03/2024	(70,870)	16.62457	1,178,183
2024040203109	B	USDMXN	04/03/2024	40,000,000	16.587	(663,480,000)
2024040203116	B	USDMXN	04/03/2024	4,828,699	16.57968	(80,058,277)
2023092903140	S	USDMXN	04/03/2024	(10,000,000)	17.917	179,170,000
2024040103088	B	USDMXN	04/03/2024	365,601	16.6134	(6,073,878)
2024040103768	B	USDMXN	04/03/2024	81,000,000	16.6424	(1,348,034,400)
2024040103712	S	USDMXN	04/03/2024	(50,000,000)	16.642	832,100,000
2023031003682	SO	USDMXN	05/03/2024	(31,200)	19.90369	620,995
2023090703392	SO	USDMXN	05/03/2024	(31,200)	18.27868	570,295
2024010803452	BO	USDMXN	05/03/2024	50,000	17.12121	(856,061)
2024011103438	BO	USDMXN	05/03/2024	63,017	17.27968	(1,088,914)
2024011703453	BO	USDMXN	05/03/2024	141,000	17.58915	(2,480,070)
2024040103710	B	USDMXN	05/03/2024	50,000,000	16.7192	(835,960,000)
2024040403732	BO	USDMXN	05/03/2024	50,000	16.66311	(833,156)
2024040503632	BO	USDMXN	05/03/2024	100,000	16.52795	(1,652,795)
2024041503558	SO	USDMXN	05/03/2024	(301,000)	16.76499	5,046,261
2024042503436	SO	USDMXN	05/03/2024	(179,000)	17.16362	3,072,287
2024043003054	B	USDMXN	05/03/2024	7,000,000	17.0601	(119,420,700)
2024043003059	B	USDMXN	05/03/2024	1,000,000	17.045	(17,045,000)
2024043003072	B	USDMXN	05/03/2024	30,000,000	17.05	(511,500,000)
2024043003076	B	USDMXN	05/03/2024	7,000,000	17.0412	(119,288,400)
2024043003707	B	USDMXN	05/03/2024	3,000,000	17.1186	(51,355,800)
2024043003716	B	USDMXN	05/03/2024	2,000,000	17.1234	(34,246,800)
2024043003815	B	USDMXN	05/03/2024	100,000	17.1242	(1,712,420)
2024043003822	B	USDMXN	05/03/2024	300,000	17.12923	(5,138,769)
2024043003927	B	USDMXN	05/03/2024	34,000	17.14009	(582,763)
2024043003928	B	USDMXN	05/03/2024	20,000	17.1399	(342,798)
2024043003502	S	USDMXN	05/03/2024	(1,431,057)	17.10465	24,477,727
2024043003589	S	USDMXN	05/03/2024	(6,000,000)	17.1038	102,622,800
2024043003772	S	USDMXN	05/03/2024	(30,000,000)	17.11	513,300,000
2024043003820	S	USDMXN	05/03/2024	(400,000)	17.12414	6,849,656
2024043003984	S	USDMXN	05/03/2024	(4,712)	17.15202	80,812
2024050203803	BO	USDMXN	05/03/2024	5,000,000	16.98556	(84,927,810)
2024040103713	B	USDMXN	05/03/2024	50,000,000	16.7202	(836,010,000)
2024043003375	B	USDMXN	05/03/2024	50,000,000	17.09	(854,500,000)
2024043003381	B	USDMXN	05/03/2024	50,000,000	17.113	(855,650,000)
2024043003778	B	USDMXN	05/03/2024	100,000,000	17.11	(1,711,000,000)
2024043003101	S	USDMXN	05/03/2024	(419,000)	17.05938	7,147,880
2024043003414	S	USDMXN	05/03/2024	(150,000,000)	17.1	2,565,000,000
2024043003842	S	USDMXN	05/03/2024	(100,000,000)	17.118	1,711,800,000
2024050203423	B	USDMXN	05/03/2024	118,000,000	16.9426	(1,999,226,800)
2024050203040	S	USDMXN	05/03/2024	(631,862)	16.91559	10,688,322
2024050203043	S	USDMXN	05/03/2024	(123,000,000)	16.925	2,081,775,000
2024050203420	S	USDMXN	05/03/2024	(118,000,000)	16.9426	1,999,226,800
2024013003758	B	USDMXN	06/03/2024	30,000,000	17.5145	(525,435,000)
2024013003112	S	USDMXN	06/03/2024	(88,880,000)	17.584	1,562,865,920
2024022803630	B	USDMXN	06/03/2024	30,000,000	17.3515	(520,545,000)
2024030803605	BO	USDMXN	06/03/2024	313,200	17.03402	(5,335,055)
2024052903797	B	USDMXN	06/03/2024	2,000,000	16.9881	(33,976,200)
2024052903798	B	USDMXN	06/03/2024	244,254	16.99609	(4,151,363)
2024052903883	B	USDMXN	06/03/2024	1,000,000	16.99311	(16,993,110)
2024060303323	S	USDMXN	06/03/2024	(7,500,000)	17.57	131,775,000
2023112903575	S	USDMXN	06/03/2024	(10,000,000)	17.747	177,470,000
2024022803793	S	USDMXN	06/03/2024	(35,000,000)	17.3605	607,617,500
2024042903063	S	USDMXN	06/03/2024	(100,000,000)	17.1677	1,716,770,000
2024043003415	B	USDMXN	06/03/2024	150,000,000	17.1843	(2,577,645,000)
2024050903091	S	USDMXN	06/03/2024	(50,000,000)	16.9713	848,565,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024052903885	B	USDMXN	06/03/2024	55,200	16.99508	(938,128)
2024053003170	B	USDMXN	06/03/2024	33,000,000	16.95315	(559,453,950)
2024053003174	B	USDMXN	06/03/2024	877,218	16.928	(14,849,544)
2024053003630	B	USDMXN	06/03/2024	89,000,000	16.95625	(1,509,106,250)
2024053003686	B	USDMXN	06/03/2024	73,000,000	16.97625	(1,239,266,250)
2024053003702	B	USDMXN	06/03/2024	40,000,000	16.97825	(679,130,000)
2024053003727	B	USDMXN	06/03/2024	15,000,000	16.986	(254,790,000)
2024053003527	S	USDMXN	06/03/2024	(66,000)	16.95707	1,119,167
2024053103041	S	USDMXN	06/03/2024	(31,554,609)	16.9643	535,301,845
2024053103064	S	USDMXN	06/03/2024	(255,395)	16.99887	4,341,433
2024053103467	S	USDMXN	06/03/2024	(51,000,000)	16.97	865,470,000
2024053103471	S	USDMXN	06/03/2024	(20,000,000)	16.97	339,400,000
2024040203064	B	EURUSD	04/04/2024	1,000,000	1.07781	(1,077,810)
2024040203038	S	EURUSD	04/04/2024	(1,000,000)	1.077	1,077,000
2023102703312	SO	USDMXN	04/04/2024	(97,110)	18.54715	1,801,114
2023110303613	BO	USDMXN	04/04/2024	29,647	17.87613	(529,974)
2023110803444	BO	USDMXN	04/04/2024	14,650	17.96892	(263,245)
2023111503539	S	USDMXN	04/04/2024	(250,000)	17.74054	4,435,134
2023111503543	S	USDMXN	04/04/2024	(75,000)	17.74019	1,330,515
2023112903167	BO	USDMXN	04/04/2024	22,110	17.54587	(387,939)
2024010303519	SO	USDMXN	04/04/2024	(155,487)	17.30805	2,691,174
2024022703471	BO	USDMXN	04/04/2024	500,000	17.15859	(8,579,297)
2024031303518	BO	USDMXN	04/04/2024	40,000	16.73844	(669,538)
2024040104075	B	USDMXN	04/04/2024	80,000	16.61685	(1,329,348)
2024040104074	S	USDMXN	04/04/2024	(900,000)	16.61353	14,952,177
2024040203005	B	USDMXN	04/04/2024	1,000,000	16.60277	(16,602,770)
2024040203006	B	USDMXN	04/04/2024	1,000,000	16.59953	(16,599,530)
2024040203358	B	USDMXN	04/04/2024	20,000,000	16.57	(331,400,000)
2024040203672	B	USDMXN	04/04/2024	1,000,000	16.5688	(16,568,800)
2024040203707	B	USDMXN	04/04/2024	830,000	16.57056	(13,753,565)
2024040203029	S	USDMXN	04/04/2024	(1,000,000)	16.58415	16,584,150
2024040203037	S	USDMXN	04/04/2024	(1,000,000)	16.59927	16,599,270
2024040203110	S	USDMXN	04/04/2024	(40,000,000)	16.58915	663,566,000
2024040203117	S	USDMXN	04/04/2024	(4,828,699)	16.5818	80,068,526
2024040203202	S	USDMXN	04/04/2024	(20,000,000)	16.58	331,600,000
2024040203204	S	USDMXN	04/04/2024	(20,000,000)	16.58	331,600,000
2024040203527	S	USDMXN	04/04/2024	(2,000,000)	16.57	33,140,000
2024040203529	S	USDMXN	04/04/2024	(1,000,000)	16.57	16,570,000
2024040203735	S	USDMXN	04/04/2024	(1,000,000)	16.55889	16,558,890
2024040203755	S	USDMXN	04/04/2024	(1,000,000)	16.5588	16,558,800
2024040203767	S	USDMXN	04/04/2024	(210,000)	16.56042	3,477,688
2024040203363	B	USDMXN	04/04/2024	126,000	16.5608	(2,086,661)
2024040203678	B	USDMXN	04/04/2024	100,000,000	16.565	(1,656,500,000)
2024040203103	S	USDMXN	04/04/2024	(42,376,659)	16.594	703,198,279
2024043003806	BO	EURMXN	06/04/2024	1,000,000	18.40054	(18,400,541)
2024060303312	S	EURMXN	06/04/2024	(1,000,000)	19.13303	19,133,026
2024021603561	BO	USDMXN	06/04/2024	100,000	17.34182	(1,734,182)
2024040203203	B	USDMXN	06/04/2024	20,000,000	16.74	(334,800,000)
2024052403591	SO	USDMXN	06/04/2024	(238,000)	16.71669	3,978,572
2024060303324	B	USDMXN	06/04/2024	7,500,000	17.5727	(131,795,250)
2024022903043	B	USDMXN	06/04/2024	50,000,000	17.3195	(865,975,000)
2024022903233	S	USDMXN	06/04/2024	(30,000,000)	17.3115	519,345,000
2024022903236	S	USDMXN	06/04/2024	(30,000,000)	17.3065	519,195,000
2024053003025	S	USDMXN	06/04/2024	(122,497,655)	16.9568	2,077,168,237
2024053103065	B	USDMXN	06/04/2024	255,395	17.0017	(4,342,155)
2024053103468	B	USDMXN	06/04/2024	51,000,000	16.9728	(865,612,800)
2024053103472	B	USDMXN	06/04/2024	20,000,000	16.9728	(339,456,000)
2024060303268	B	USDMXN	06/04/2024	509,012	17.55579	(8,936,106)
2024060303570	B	USDMXN	06/04/2024	70,600,000	17.7	(1,249,620,000)
2024060303672	B	USDMXN	06/04/2024	11,400,000	17.69638	(201,738,738)
2024060303390	S	USDMXN	06/04/2024	(61,000,000)	17.571	1,071,831,000
2023031003698	S	USDMXN	04/05/2024	(39,000)	19.82859	773,315
2023090703388	SO	USDMXN	04/05/2024	(39,000)	18.18698	709,292
2024011103430	BO	USDMXN	04/05/2024	63,017	17.1984	(1,083,791)
2024011703449	BO	USDMXN	04/05/2024	141,000	17.50665	(2,468,438)
2024022703798	BO	USDMXN	04/05/2024	100,000	17.16345	(1,716,345)
2024030103243	B	USDMXN	04/05/2024	30,000,000	17.094	(512,820,000)
2024030103483	B	USDMXN	04/05/2024	30,000,000	17.0989	(512,967,000)
2024030803602	BO	USDMXN	04/05/2024	396,400	16.87779	(6,690,354)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024031303256	S	USDMXN	04/05/2024	(60,000,000)	16.7887	1,007,322,000
2024031403648	S	USDMXN	04/05/2024	(143,000)	16.76575	2,397,502
2024031503750	BO	USDMXN	04/05/2024	141,000	16.75594	(2,362,587)
2024040203821	S	USDMXN	04/05/2024	(15,000)	16.5441	248,162
2024040303121	B	USDMXN	04/05/2024	2,000,000	16.56	(33,120,000)
2024040303155	B	USDMXN	04/05/2024	150,000,000	16.5635	(2,484,525,000)
2024040303177	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.553	(827,650,000)
2024040303179	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.55	(827,500,000)
2024040303037	S	USDMXN	04/05/2024	(1,000,000)	16.58385	16,583,850
2024040303089	S	USDMXN	04/05/2024	(1,000,000)	16.58052	16,580,520
2024040303538	S	USDMXN	04/05/2024	(1,000,000)	16.54	16,540,000
2024040303548	S	USDMXN	04/05/2024	(421,077)	16.54173	6,965,342
2024040303591	S	USDMXN	04/05/2024	(20,000,000)	16.54	330,800,000
2023122003522	BO	USDMXN	04/05/2024	4,000,000	17.37037	(69,481,468)
2023122003523	BO	USDMXN	04/05/2024	4,000,000	17.37107	(69,484,268)
2023122003524	BO	USDMXN	04/05/2024	400,000	17.37067	(6,948,267)
2024022303305	S	USDMXN	04/05/2024	(20,000,000)	17.2355	344,710,000
2024040103931	B	USDMXN	04/05/2024	21,000,000	16.639	(349,419,000)
2024040203107	S	USDMXN	04/05/2024	(74,996,113)	16.599	1,244,860,479
2024040303032	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.57	(828,500,000)
2024040303206	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.58	(829,000,000)
2024040303220	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.58	(829,000,000)
2024040303231	B	USDMXN	04/05/2024	50,000,000	16.553	(827,650,000)
2024040303042	S	USDMXN	04/05/2024	(50,000,000)	16.58	829,000,000
2024040303229	S	USDMXN	04/05/2024	(30,000,000)	16.575	497,250,000
2024040303473	S	USDMXN	04/05/2024	(25,000,000)	16.535	413,375,000
2024040403150	S	USDMXN	04/05/2024	(50,000,000)	16.52	826,000,000
2024040403152	S	USDMXN	04/05/2024	(50,000,000)	16.52	826,000,000
2024040403162	S	USDMXN	04/05/2024	(100,000,000)	16.52	1,652,000,000
2024040403166	S	USDMXN	04/05/2024	(100,000,000)	16.52	1,652,000,000
2024040403169	S	USDMXN	04/05/2024	(92,000,000)	16.527	1,520,484,000
2024040403171	S	USDMXN	04/05/2024	(687,300)	16.51883	11,353,385
2023101003363	S	USDMXN	06/05/2024	(256,946)	18.71262	4,808,125
2023101703314	SO	USDMXN	06/05/2024	(258,134)	18.61442	4,805,014
2024010303619	BO	USDMXN	06/05/2024	10,000	17.47019	(174,702)
2024010303536	SO	USDMXN	06/05/2024	(55,157)	17.48041	964,166
2024021303263	SO	USDMXN	06/05/2024	(502,627)	17.52197	8,807,014
2024031303479	BO	USDMXN	06/05/2024	50,000	16.91259	(845,630)
2024040203514	SO	USDMXN	06/05/2024	(490,372)	16.72557	8,201,751
2024041103541	BO	USDMXN	06/05/2024	57,600	16.56682	(954,249)
2024060303015	B	USDMXN	06/05/2024	15,000,000	17.4179	(261,268,500)
2024060303215	B	USDMXN	06/05/2024	1,000,000	17.50887	(17,508,870)
2024060303348	B	USDMXN	06/05/2024	100,000	17.6	(1,760,000)
2024060303168	S	USDMXN	06/05/2024	(1,000,000)	17.50208	17,502,080
2024060303559	S	USDMXN	06/05/2024	(100,000)	17.69621	1,769,621
2024060303921	S	USDMXN	06/05/2024	(37,810)	17.69682	669,115
2024060503164	S	USDMXN	06/05/2024	(7,900,000)	17.5	138,250,000
2023060103583	B	USDMXN	06/05/2024	10,000,000	18.778	(187,780,000)
2024040303043	B	USDMXN	06/05/2024	50,000,000	16.7372	(836,860,000)
2024060303180	B	USDMXN	06/05/2024	521,000	17.5442	(9,140,528)
2024060303391	B	USDMXN	06/05/2024	61,000,000	17.5738	(1,072,001,800)
2024060303269	S	USDMXN	06/05/2024	(509,012)	17.5585	8,937,487
2024060303571	S	USDMXN	06/05/2024	(70,600,000)	17.7028	1,249,817,680
2024060303673	S	USDMXN	06/05/2024	(11,400,000)	17.6991	201,769,740
2024060403138	B	USDMXN	06/05/2024	236,574,074	17.82	(4,215,750,000)
2024060403248	S	USDMXN	06/05/2024	(828,187)	17.88959	14,815,917
2024060403350	S	USDMXN	06/05/2024	(101,000,000)	17.895	1,807,395,000
2024060403356	S	USDMXN	06/05/2024	(83,500,000)	17.95	1,498,825,000
2024060403642	S	USDMXN	06/05/2024	(56,500,000)	17.882	1,010,333,000
2024060503526	B	USDMXN	06/05/2024	236,574,074	17.82	(4,215,750,000)
2024040303178	S	USDMXN	05/06/2024	(50,000,000)	16.6315	831,575,000
2024043003773	B	USDMXN	05/06/2024	30,000,000	17.1184	(513,552,000)
2024043003821	B	USDMXN	05/06/2024	400,000	17.13274	(6,853,096)
2024043003823	S	USDMXN	05/06/2024	(300,000)	17.13723	5,141,169
2024050203581	B	USDMXN	05/06/2024	40,200	16.9306	(680,610)
2024050203849	S	USDMXN	05/06/2024	(966,000)	16.99325	16,415,480
2024050203863	S	USDMXN	05/06/2024	(1,261)	16.99254	21,436
2023122003528	BO	USDMXN	05/06/2024	4,000,000	17.4628	(69,851,194)
2023122003534	BO	USDMXN	05/06/2024	2,000,000	17.4632	(34,926,397)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023122003536	BO	USDMXN	05/06/2024	2,400,000	17.46363	(41,912,712)
2023122003539	BO	USDMXN	05/06/2024	2,400,000	17.46363	(41,912,712)
2024010303173	S	USDMXN	05/06/2024	(30,000,000)	17.392	521,760,000
2024040203679	S	USDMXN	05/06/2024	(100,000,000)	16.6475	1,664,750,000
2024040303033	S	USDMXN	05/06/2024	(50,000,000)	16.6482	832,410,000
2024040303232	S	USDMXN	05/06/2024	(50,000,000)	16.6315	831,575,000
2024050203038	B	USDMXN	05/06/2024	50,000,000	16.94	(847,000,000)
2024050203041	B	USDMXN	05/06/2024	631,862	16.924	(10,693,637)
2024050203044	B	USDMXN	05/06/2024	123,000,000	16.9333	(2,082,795,900)
2024050203550	B	USDMXN	05/06/2024	50,000,000	16.93	(846,500,000)
2024050203553	B	USDMXN	05/06/2024	20,000,000	16.938	(338,760,000)
2024050203819	B	USDMXN	05/06/2024	10,000,000	16.974	(169,740,000)
2024050303009	B	USDMXN	05/06/2024	47,421,458	16.87	(800,000,000)
2024050303011	B	USDMXN	05/06/2024	91,615,203	16.895	(1,547,838,858)
2024050303057	S	USDMXN	05/06/2024	(595,108)	16.96847	10,098,065
2024050303299	S	USDMXN	05/06/2024	(150,000,000)	17.015	2,552,250,000
2023110103303	B	USDMXN	06/06/2024	15,000,000	18.588	(278,820,000)
2024010303421	BO	USDMXN	06/06/2024	24,206	17.48851	(423,327)
2024010303537	BO	USDMXN	06/06/2024	54,809	17.48873	(958,540)
2024020103244	B	USDMXN	06/06/2024	20,000,000	17.47461	(349,492,160)
2024020103276	B	USDMXN	06/06/2024	20,000,000	17.4835	(349,670,000)
2024052303752	SO	USDMXN	06/06/2024	(103,615)	16.75616	1,736,183
2024052403593	SO	USDMXN	06/06/2024	(127,000)	16.72247	2,123,753
2024052803754	B	USDMXN	06/06/2024	50,000,000	16.819	(840,950,000)
2024060303963	S	USDMXN	06/06/2024	(1,000,000)	17.7	17,700,000
2024060403053	B	USDMXN	06/06/2024	2,000,000	17.78	(35,560,000)
2024060403151	B	USDMXN	06/06/2024	3,000,000	17.8	(53,400,000)
2024060403164	B	USDMXN	06/06/2024	2,000,000	17.79	(35,580,000)
2024060403177	B	USDMXN	06/06/2024	1,000,000	17.77406	(17,774,060)
2024060403232	B	USDMXN	06/06/2024	1,000,000	17.8665	(17,866,500)
2024060403291	B	USDMXN	06/06/2024	1,000,000	17.94513	(17,945,130)
2024060403303	B	USDMXN	06/06/2024	1,000,000	17.9392	(17,939,200)
2024060403305	B	USDMXN	06/06/2024	1,000,000	17.9393	(17,939,300)
2024060403661	B	USDMXN	06/06/2024	3,000,000	17.88	(53,640,000)
2024060403707	B	USDMXN	06/06/2024	2,500,000	17.88	(44,700,000)
2024060403759	B	USDMXN	06/06/2024	76,550	17.87164	(1,368,074)
2024060403183	S	USDMXN	06/06/2024	(50,000,000)	17.753	887,650,000
2024060403193	S	USDMXN	06/06/2024	(1,000,000)	17.8	17,800,000
2024060403208	S	USDMXN	06/06/2024	(1,000,000)	17.8995	17,899,500
2024060403282	S	USDMXN	06/06/2024	(300,000)	17.9843	5,395,290
2024060403720	S	USDMXN	06/06/2024	(53,475)	17.87529	955,884
2024060503165	B	USDMXN	06/06/2024	7,900,000	17.5027	(138,271,330)
2024060503368	B	USDMXN	06/06/2024	87,000,000	17.55	(1,526,850,000)
2024060503371	B	USDMXN	06/06/2024	63,000,000	17.55	(1,105,650,000)
2024060603004	S	USDMXN	06/06/2024	(312,420)	17.5532	5,483,971
2024060403249	B	USDMXN	06/06/2024	828,187	17.8925	(14,818,329)
2024060403351	B	USDMXN	06/06/2024	101,000,000	17.89788	(1,807,685,375)
2024060403357	B	USDMXN	06/06/2024	83,500,000	17.95288	(1,499,065,063)
2024060403643	B	USDMXN	06/06/2024	56,500,000	17.8849	(1,010,496,850)
2024060403524	S	USDMXN	06/06/2024	(100,000,000)	17.8885	1,788,850,000
2024060403603	S	USDMXN	06/06/2024	(345,000)	17.86484	6,163,370
2024060403613	S	USDMXN	06/06/2024	(50,000,000)	17.865	893,250,000
2024060503140	S	USDMXN	06/06/2024	(83,000,000)	17.51	1,453,330,000
2024060503150	S	USDMXN	06/06/2024	(47,530)	17.52245	832,836
2024060503324	S	USDMXN	06/06/2024	(150,000,000)	17.535	2,630,250,000
2024010303525	SO	USDMXN	05/07/2024	(362,159)	17.39234	6,298,786
2024030503399	B	USDMXN	05/07/2024	30,000,000	17.092	(512,760,000)
2024030803603	BO	USDMXN	05/07/2024	247,700	16.96246	(4,201,601)
2024050204023	B	USDMXN	05/07/2024	146,000	16.97924	(2,478,969)
2024050204024	B	USDMXN	05/07/2024	90,000	16.9785	(1,528,065)
2024050204022	S	USDMXN	05/07/2024	(118,000)	16.97508	2,003,059
2024050303696	B	USDMXN	05/07/2024	56,280	16.95916	(954,462)
2024050303809	B	USDMXN	05/07/2024	144,350	16.9814	(2,451,265)
2024030503545	S	USDMXN	05/07/2024	(30,000,000)	17.092	512,760,000
2024030503550	S	USDMXN	05/07/2024	(30,000,000)	17.0905	512,715,000
2024040403033	SO	USDMXN	05/07/2024	(118,447,049)	16.585	1,964,444,313
2024040403035	SO	USDMXN	05/07/2024	(118,447,049)	16.585	1,964,444,313
2024050303058	B	USDMXN	05/07/2024	595,108	16.9713	(10,099,752)
2024050303302	B	USDMXN	05/07/2024	150,000,000	17.0177	(2,552,655,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024050303063	S	USDMXN	05/07/2024	(100,000,000)	16.978	1,697,800,000
2024050303158	S	USDMXN	05/07/2024	(981,000)	16.99161	16,668,769
2024050303196	S	USDMXN	05/07/2024	(100,000,000)	17.014	1,701,400,000
2024050603059	B	USDMXN	05/07/2024	683,312	16.9036	(11,550,424)
2024050603243	B	USDMXN	05/07/2024	100,000,000	16.913	(1,691,300,000)
2024050603248	B	USDMXN	05/07/2024	94,000,000	16.913	(1,589,822,000)
2024050603394	B	USDMXN	05/07/2024	200,000,000	16.89	(3,378,000,000)
2024050603398	B	USDMXN	05/07/2024	188,000,000	16.89	(3,175,320,000)
2024050603381	S	USDMXN	05/07/2024	(100,000,000)	16.913	1,691,300,000
2024050603386	S	USDMXN	05/07/2024	(94,000,000)	16.913	1,589,822,000
2024060503112	B	EURUSD	06/07/2024	1,000,000	1.08651	(1,086,510)
2024060503115	B	EURUSD	06/07/2024	1,000,000	1.08643	(1,086,430)
2024060503575	B	EURUSD	06/07/2024	2,000,000	1.08723	(2,174,460)
2024060503225	S	EURUSD	06/07/2024	(2,000,000)	1.08686	2,173,720
2024060503336	S	EURUSD	06/07/2024	(1,000,000)	1.08651	1,086,510
2024060503337	S	EURUSD	06/07/2024	(1,000,000)	1.08652	1,086,520
2023031003882	S	USDMXN	06/07/2024	(39,000)	20.05915	782,307
2023090703402	SO	USDMXN	06/07/2024	(39,000)	18.39169	717,276
2024011103442	BO	USDMXN	06/07/2024	63,017	17.38048	(1,095,266)
2024032703428	BO	USDMXN	06/07/2024	600,000	16.70845	(10,025,072)
2024060503021	B	USDMXN	06/07/2024	1,000,000	17.61968	(17,619,680)
2024060503023	B	USDMXN	06/07/2024	1,000,000	17.617	(17,617,000)
2024060503055	B	USDMXN	06/07/2024	2,000,000	17.62431	(35,248,620)
2024060503058	B	USDMXN	06/07/2024	2,000,000	17.6085	(35,217,000)
2024060503062	B	USDMXN	06/07/2024	1,000,000	17.60518	(17,605,180)
2024060503569	B	USDMXN	06/07/2024	2,500,000	17.55	(43,875,000)
2024060503570	B	USDMXN	06/07/2024	47,120	17.5501	(826,961)
2024060503571	B	USDMXN	06/07/2024	10,000,000	17.585	(175,850,000)
2024060503579	B	USDMXN	06/07/2024	1,000,000	17.55132	(17,551,320)
2024060503651	B	USDMXN	06/07/2024	500,000	17.5794	(8,789,700)
2024060503653	B	USDMXN	06/07/2024	500,000	17.5807	(8,790,350)
2024060503042	S	USDMXN	06/07/2024	(2,000,000)	17.6552	35,310,400
2024060503065	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.5447	17,544,700
2024060503066	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.53599	17,535,990
2024060503067	S	USDMXN	06/07/2024	(3,000,000)	17.52866	52,585,980
2024060503246	S	USDMXN	06/07/2024	(50,000,000)	17.535	876,750,000
2024060503281	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.55371	17,553,710
2024060503321	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.545	17,545,000
2024060503341	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.55282	17,552,820
2024060503369	S	USDMXN	06/07/2024	(87,000,000)	17.55288	1,527,100,125
2024060503372	S	USDMXN	06/07/2024	(63,000,000)	17.55288	1,105,831,125
2024060503373	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.56912	17,569,120
2024060503423	S	USDMXN	06/07/2024	(1,000,000)	17.5717	17,571,700
2024060603005	B	USDMXN	06/07/2024	312,420	17.55604	(5,484,857)
2024030503238	B	USDMXN	06/07/2024	30,000,000	17.159	(514,770,000)
2024050303064	B	USDMXN	06/07/2024	100,000,000	17.0612	(1,706,120,000)
2024052903139	S	USDMXN	06/07/2024	(200,000,000)	16.9707	3,394,140,000
2024052903145	S	USDMXN	06/07/2024	(50,000,000)	16.9792	848,960,000
2024060503141	B	USDMXN	06/07/2024	83,000,000	17.51288	(1,453,568,625)
2024060503151	B	USDMXN	06/07/2024	47,530	17.5254	(832,976)
2024060503576	B	USDMXN	06/07/2024	390,000	17.55149	(6,845,081)
2024060503730	B	USDMXN	06/07/2024	75,000,000	17.575	(1,318,125,000)
2024060503136	S	USDMXN	06/07/2024	(30,000,000)	17.545	526,350,000
2024060503728	S	USDMXN	06/07/2024	(75,000,000)	17.575	1,318,125,000
2024060503736	S	USDMXN	06/07/2024	(50,000,000)	17.545	877,250,000
2024060503739	S	USDMXN	06/07/2024	(30,000,000)	17.524	525,720,000
2024060603026	B	USDMXN	06/07/2024	120,237	17.55403	(2,110,651)
2024060603592	B	USDMXN	06/07/2024	56,996,000	17.545	(999,994,820)
2024060603675	B	USDMXN	06/07/2024	60,000,000	17.5515	(1,053,090,000)
2024060603692	B	USDMXN	06/07/2024	85,372,000	17.57	(1,499,986,040)
2024060603713	B	USDMXN	06/07/2024	148,000,000	17.93	(2,653,640,000)
2024060603719	B	USDMXN	06/07/2024	632,000	17.95947	(11,350,382)
2024060603831	B	USDMXN	06/07/2024	148,000,000	17.93	(2,653,640,000)
2024040403143	B	EURUSD	04/08/2024	1,000,000	1.08635	(1,086,350)
2024040403311	B	EURUSD	04/08/2024	1,000,000	1.08609	(1,086,090)
2024040403218	S	EURUSD	04/08/2024	(1,000,000)	1.08647	1,086,470
2024040403423	S	EURUSD	04/08/2024	(1,000,000)	1.08602	1,086,020
2024020103701	BO	USDMXN	04/08/2024	500,000	17.25464	(8,627,319)
2024020603127	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	17.2104	(516,312,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024030503624	BO	USDMXN	04/08/2024	68,750	17.03164	(1,170,925)
2024040103579	BO	USDMXN	04/08/2024	149,000	16.66738	(2,483,440)
2024040103392	SO	USDMXN	04/08/2024	(19,948)	16.67856	332,704
2024040103397	SO	USDMXN	04/08/2024	(72,773)	16.67926	1,213,800
2024040103398	SO	USDMXN	04/08/2024	(1,491)	16.67956	24,869
2024040403145	B	USDMXN	04/08/2024	100,000,000	16.535	(1,653,500,000)
2024040403206	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.52007	(16,520,070)
2024040403211	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.51966	(16,519,660)
2024040403219	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.5151	(16,515,100)
2024040403252	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.51556	(16,515,560)
2024040403355	B	USDMXN	04/08/2024	25,000,000	16.51	(412,750,000)
2024040403483	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.53247	(16,532,470)
2024040403485	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.53317	(16,533,170)
2024040403498	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.51984	(16,519,840)
2024040403503	B	USDMXN	04/08/2024	1,310,501	16.52196	(21,652,045)
2024040403532	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.53315	(16,533,150)
2024040403553	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.53877	(16,538,770)
2024040403561	B	USDMXN	04/08/2024	2,000,000	16.56058	(33,121,160)
2024040403563	B	USDMXN	04/08/2024	1,000,000	16.55929	(16,559,290)
2024040403052	S	USDMXN	04/08/2024	(1,000,000)	16.53934	16,539,340
2024040403110	S	USDMXN	04/08/2024	(20,000,000)	16.52	330,400,000
2024040403142	S	USDMXN	04/08/2024	(1,000,000)	16.53141	16,531,410
2024040403422	S	USDMXN	04/08/2024	(2,000,000)	16.49521	32,990,420
2024040403426	S	USDMXN	04/08/2024	(2,000,000)	16.49976	32,999,520
2023100403246	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	18.524	(555,720,000)
2023120603168	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	17.6225	(528,675,000)
2024010403076	S	USDMXN	04/08/2024	(50,000,000)	17.3382	866,910,000
2024020603686	B	USDMXN	04/08/2024	40,000,000	17.22	(688,800,000)
2024030603579	B	USDMXN	04/08/2024	50,000,000	16.969	(848,450,000)
2024032103731	S	USDMXN	04/08/2024	(100,000,000)	16.777	1,677,700,000
2024040403151	B	USDMXN	04/08/2024	50,000,000	16.52673	(826,336,500)
2024040403153	B	USDMXN	04/08/2024	50,000,000	16.52673	(826,336,500)
2024040403163	B	USDMXN	04/08/2024	100,000,000	16.52673	(1,652,673,000)
2024040403167	B	USDMXN	04/08/2024	100,000,000	16.52673	(1,652,673,000)
2024040403170	B	USDMXN	04/08/2024	92,000,000	16.53375	(1,521,105,000)
2024040403172	B	USDMXN	04/08/2024	687,300	16.5257	(11,358,110)
2024040403177	B	USDMXN	04/08/2024	25,000,000	16.532	(413,300,000)
2024040403204	B	USDMXN	04/08/2024	25,000,000	16.538	(413,450,000)
2024040403539	B	USDMXN	04/08/2024	15,000,000	16.53	(247,950,000)
2024040403541	B	USDMXN	04/08/2024	10,000,000	16.53	(165,300,000)
2024040403576	B	USDMXN	04/08/2024	30,000,000	16.55	(496,500,000)
2024040403053	S	USDMXN	04/08/2024	(2,124,000)	16.53649	35,123,505
2024040403180	S	USDMXN	04/08/2024	(100,000,000)	16.538	1,653,800,000
2024040403186	S	USDMXN	04/08/2024	(50,000,000)	16.538	826,900,000
2024040403195	S	USDMXN	04/08/2024	(50,000,000)	16.538	826,900,000
2024040403198	S	USDMXN	04/08/2024	(50,000,000)	16.538	826,900,000
2024040403580	S	USDMXN	04/08/2024	(50,000,000)	16.57	828,500,000
2024040503189	S	USDMXN	04/08/2024	(151,712,838)	16.4785	2,500,000,000
2024040503370	S	USDMXN	04/08/2024	(91,030,465)	16.478	1,500,000,000
2024040503375	S	USDMXN	04/08/2024	(60,000,000)	16.46	987,600,000
2024040503378	S	USDMXN	04/08/2024	(2,611,338)	16.47236	43,014,904
2023050403360	S	USDMXN	05/08/2024	(10,000,000)	19.247	192,469,955
2023051103066	B	USDMXN	05/08/2024	10,000,000	18.93499	(189,349,920)
2023092603661	SO	USDMXN	05/08/2024	(275,300)	18.20422	5,011,622
2023101003368	S	USDMXN	05/08/2024	(268,976)	18.63401	5,012,108
2023101703312	SO	USDMXN	05/08/2024	(269,942)	18.52675	5,001,148
2023111503476	S	USDMXN	05/08/2024	(280,300)	17.846	5,002,232
2023112903429	SO	USDMXN	05/08/2024	(283,206)	17.67001	5,004,254
2024020203013	S	USDMXN	05/08/2024	(10,000,000)	17.3606	173,606,000
2024020603129	S	USDMXN	05/08/2024	(30,000,000)	17.2964	518,892,000
2024032503813	BO	USDMXN	05/08/2024	49,200	16.79645	(826,385)
2024032603396	SO	USDMXN	05/08/2024	(691,629)	16.77134	11,599,546
2024040903740	BO	USDMXN	05/08/2024	58,800	16.46549	(968,171)
2024041503536	BO	USDMXN	05/08/2024	100,800	16.75989	(1,689,396)
2024042303377	BO	USDMXN	05/08/2024	20,400	17.0142	(347,090)
2024042403605	BO	USDMXN	05/08/2024	142,968	17.08345	(2,442,387)
2024050603360	B	USDMXN	05/08/2024	291,482	16.88688	(4,922,222)
2024040403181	B	USDMXN	05/08/2024	100,000,000	16.6155	(1,661,550,000)
2024040403187	B	USDMXN	05/08/2024	50,000,000	16.6155	(830,775,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024040403196	B	USDMXN	05/08/2024	50,000,000	16.6155	(830,775,000)
2024040403199	B	USDMXN	05/08/2024	50,000,000	16.6155	(830,775,000)
2024050603382	B	USDMXN	05/08/2024	100,000,000	16.91565	(1,691,565,000)
2024050603387	B	USDMXN	05/08/2024	94,000,000	16.91565	(1,590,071,100)
2024050603060	S	USDMXN	05/08/2024	(683,312)	16.906	11,552,066
2024050603244	S	USDMXN	05/08/2024	(100,000,000)	16.91565	1,691,565,000
2024050603249	S	USDMXN	05/08/2024	(94,000,000)	16.91565	1,590,071,100
2024050603395	S	USDMXN	05/08/2024	(200,000,000)	16.8926	3,378,520,000
2024050603399	S	USDMXN	05/08/2024	(188,000,000)	16.8926	3,175,808,800
2024050703055	S	USDMXN	05/08/2024	(617,690)	16.85763	10,412,792
2024050703058	S	USDMXN	05/08/2024	(9,000,000)	16.843	151,587,000
2024040503056	B	EURUSD	04/09/2024	1,000,000	1.08226	(1,082,260)
2024040503048	S	EURUSD	04/09/2024	(1,000,000)	1.08119	1,081,190
2023071203634	BO	USDMXN	04/09/2024	38,462	17.74745	(682,594)
2023111403616	B	USDMXN	04/09/2024	100,000	17.80513	(1,780,513)
2024020903504	S	USDMXN	04/09/2024	(761,647)	17.24408	13,133,903
2024040203519	SO	USDMXN	04/09/2024	(31,340)	16.57656	519,509
2024040203522	SO	USDMXN	04/09/2024	(61,848)	16.57676	1,025,240
2024040203604	SO	USDMXN	04/09/2024	(99,297)	16.58775	1,647,114
2024040403763	S	USDMXN	04/09/2024	(450,000)	16.5808	7,461,360
2024040503047	B	USDMXN	04/09/2024	1,000,000	16.46365	(16,463,650)
2024040503057	B	USDMXN	04/09/2024	1,000,000	16.45988	(16,459,880)
2024040503172	B	USDMXN	04/09/2024	10,000,000	16.475	(164,750,000)
2024040503628	B	USDMXN	04/09/2024	4,000,000	16.465	(65,860,000)
2024040503634	B	USDMXN	04/09/2024	48,327	16.46512	(795,710)
2024040503780	B	USDMXN	04/09/2024	325,000	16.4648	(5,351,060)
2024040503065	S	USDMXN	04/09/2024	(2,000,000)	16.49	32,980,000
2024040503124	S	USDMXN	04/09/2024	(1,000,000)	16.48843	16,488,430
2024040503135	S	USDMXN	04/09/2024	(1,000,000)	16.4783	16,478,300
2024040503184	S	USDMXN	04/09/2024	(1,000,000)	16.4818	16,481,800
2024040503407	S	USDMXN	04/09/2024	(1,000,000)	16.47905	16,479,050
2024040503190	B	USDMXN	04/09/2024	151,691,665	16.4808	(2,500,000,000)
2024040503371	B	USDMXN	04/09/2024	91,017,484	16.48035	(1,500,000,000)
2024040503376	B	USDMXN	04/09/2024	60,000,000	16.46235	(987,741,000)
2024040503379	B	USDMXN	04/09/2024	2,611,338	16.4748	(43,021,269)
2024040803088	S	USDMXN	04/09/2024	(10,000,000)	16.37	163,700,000
2024040803213	S	USDMXN	04/09/2024	(955,755)	16.3298	15,607,285
2024040803495	S	USDMXN	04/09/2024	(243,000,000)	16.345	3,971,835,000
2023122203607	BO	USDMXN	05/09/2024	50,000	17.35333	(867,667)
2024010303417	BO	USDMXN	05/09/2024	24,206	17.40667	(421,346)
2024010303526	BO	USDMXN	05/09/2024	62,864	17.40422	(1,094,099)
2024042903598	B	USDMXN	05/09/2024	40,000,000	17.04802	(681,920,760)
2024050703540	S	USDMXN	05/09/2024	(423,860)	16.90726	7,166,311
2024050903165	S	USDMXN	05/09/2024	(30,000,000)	16.875	506,250,000
2024050703056	B	USDMXN	05/09/2024	617,690	16.8604	(10,414,505)
2024050703059	B	USDMXN	05/09/2024	9,000,000	16.8457	(151,611,300)
2024050703085	B	USDMXN	05/09/2024	50,000,000	16.86	(843,000,000)
2024050703193	B	USDMXN	05/09/2024	50,000,000	16.915	(845,750,000)
2024050703556	B	USDMXN	05/09/2024	743,000	16.90465	(12,560,155)
2024050703061	S	USDMXN	05/09/2024	(50,000,000)	16.85	842,500,000
2024050703064	S	USDMXN	05/09/2024	(50,000,000)	16.855	842,750,000
2024050703066	S	USDMXN	05/09/2024	(20,000,000)	16.8435	336,870,000
2024050703071	S	USDMXN	05/09/2024	(60,000,000)	16.85	1,011,000,000
2024050703080	S	USDMXN	05/09/2024	(30,000,000)	16.852	505,560,000
2024050703083	S	USDMXN	05/09/2024	(50,000,000)	16.85	842,500,000
2024050703322	S	USDMXN	05/09/2024	(10,000,000)	16.92	169,200,000
2024050803032	B	USDMXN	05/09/2024	647,082	16.9351	(10,958,393)
2024050803049	B	USDMXN	05/09/2024	119,000,000	16.943	(2,016,217,000)
2023062703048	BO	USDMXN	04/10/2024	350,000	17.97281	(6,290,482)
2023072003386	SO	USDMXN	04/10/2024	(282,869)	17.68283	5,001,932
2023072403304	B	USDMXN	04/10/2024	500,000	17.63194	(8,815,969)
2023072403306	S	USDMXN	04/10/2024	(200,000)	17.62108	3,524,216
2023072803196	BO	USDMXN	04/10/2024	400,000	17.4355	(6,974,201)
2023080303458	SO	USDMXN	04/10/2024	(276,396)	18.09072	5,000,198
2023081003241	BO	USDMXN	04/10/2024	300,000	17.69337	(5,308,011)
2023081003243	B	USDMXN	04/10/2024	100,000	17.70402	(1,770,402)
2023081103546	SO	USDMXN	04/10/2024	(281,563)	17.7654	5,002,080
2023091203033	BO	USDMXN	04/10/2024	300,000	17.97767	(5,393,301)
2023091303139	B	USDMXN	04/10/2024	300,000	17.7442	(5,323,259)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091403638	B	USDMXN	04/10/2024	300,000	17.7162	(5,314,859)
2023091903444	B	USDMXN	04/10/2024	250,000	17.69503	(4,423,758)
2023100903426	BO	USDMXN	04/10/2024	56,496	18.76194	(1,059,974)
2023101003370	S	USDMXN	04/10/2024	(275,616)	18.54693	5,111,836
2023101703401	S	USDMXN	04/10/2024	(276,438)	18.45828	5,102,566
2023112103155	BO	USDMXN	04/10/2024	75,000	17.58623	(1,318,967)
2024010503483	BO	USDMXN	04/10/2024	100,000	17.17216	(1,717,216)
2024010803353	B	USDMXN	04/10/2024	20,000,000	17.0655	(341,310,000)
2024021303260	SO	USDMXN	04/10/2024	(668,549)	17.36574	11,609,850
2024021403207	BO	USDMXN	04/10/2024	59,200	17.25449	(1,021,466)
2024022603142	BO	USDMXN	04/10/2024	47,600	17.23688	(820,475)
2024022603143	BO	USDMXN	04/10/2024	50,400	17.23728	(868,759)
2024022703511	BO	USDMXN	04/10/2024	92,414	17.18223	(1,587,878)
2024022703796	BO	USDMXN	04/10/2024	72,800	17.17713	(1,250,495)
2024022903255	BO	USDMXN	04/10/2024	72,800	17.15945	(1,249,208)
2024030403936	BO	USDMXN	04/10/2024	42,250	17.06811	(721,128)
2024031103678	BO	USDMXN	04/10/2024	87,300	16.87868	(1,473,508)
2024031303646	BO	USDMXN	04/10/2024	75,000	16.75314	(1,256,486)
2024031303727	BO	USDMXN	04/10/2024	33,600	16.73711	(562,367)
2024032003416	BO	USDMXN	04/10/2024	34,956	16.74261	(585,255)
2024040803637	B	USDMXN	04/10/2024	2,000,000	16.3226	(32,645,200)
2024041003002	S	USDMXN	04/10/2024	(30,000,000)	16.45	493,500,000
2024040403002	S	USDMXN	04/10/2024	(13,275,174)	16.535	219,505,000
2024040803089	B	USDMXN	04/10/2024	10,000,000	16.3724	(163,724,000)
2024040803214	B	USDMXN	04/10/2024	955,755	16.3323	(15,609,678)
2024040803388	B	USDMXN	04/10/2024	50,000,000	16.336	(816,800,000)
2024040803496	B	USDMXN	04/10/2024	243,000,000	16.3474	(3,972,418,200)
2024040803510	B	USDMXN	04/10/2024	30,000,000	16.336	(490,080,000)
2024040903137	B	USDMXN	04/10/2024	524,644	16.34382	(8,574,693)
2024040903036	S	USDMXN	04/10/2024	(122,549,020)	16.32	2,000,000,000
2024040903118	S	USDMXN	04/10/2024	(100,612,370)	16.33	1,643,000,000
2024040903129	S	USDMXN	04/10/2024	(123,000,000)	16.317	2,006,991,000
2023031003681	SO	USDMXN	05/10/2024	(31,200)	19.92579	621,685
2023090703393	SO	USDMXN	05/10/2024	(31,200)	18.30154	571,008
2024010803453	BO	USDMXN	05/10/2024	50,000	17.14154	(857,077)
2024011103437	BO	USDMXN	05/10/2024	63,017	17.3001	(1,090,200)
2024031903822	BO	USDMXN	05/10/2024	286,282	16.95773	(4,854,691)
2024050803391	B	USDMXN	05/10/2024	47,612	16.88501	(803,929)
2024050903166	B	USDMXN	05/10/2024	30,000,000	16.8777	(506,331,000)
2024010803319	B	USDMXN	05/10/2024	40,000,000	17.1385	(685,540,000)
2024040803152	B	USDMXN	05/10/2024	100,000,000	16.4406	(1,644,060,000)
2024040803389	S	USDMXN	05/10/2024	(50,000,000)	16.4136	820,680,000
2024040803511	S	USDMXN	05/10/2024	(30,000,000)	16.4138	492,414,000
2024050803462	B	USDMXN	05/10/2024	50,000,000	16.899	(844,950,000)
2024050803033	S	USDMXN	05/10/2024	(647,082)	16.9376	10,960,012
2024050803050	S	USDMXN	05/10/2024	(119,000,000)	16.9457	2,016,538,300
2024050803315	S	USDMXN	05/10/2024	(20,000,000)	16.9	338,000,000
2024050803347	S	USDMXN	05/10/2024	(20,000,000)	16.887	337,740,000
2024050803423	S	USDMXN	05/10/2024	(20,000,000)	16.89	337,800,000
2024050903006	B	USDMXN	05/10/2024	201,223	16.9123	(3,403,140)
2024050903030	B	USDMXN	05/10/2024	70,000,000	16.93	(1,185,100,000)
2024050903159	B	USDMXN	05/10/2024	857,467	16.87021	(14,465,647)
2024050903357	B	USDMXN	05/10/2024	73,000,000	16.862	(1,230,926,000)
2024050903139	S	USDMXN	05/10/2024	(73,857,467)	16.878	1,246,566,329
2024051003017	B	USDMXN	05/10/2024	149,120,000	16.765	(2,499,996,800)
2024051003019	S	USDMXN	05/10/2024	(149,120,000)	16.765	2,499,996,800
2024051003062	S	USDMXN	05/10/2024	(10,000,000)	16.73	167,300,000
2024052303747	SO	USDMXN	06/10/2024	(127,000)	16.76572	2,129,246
2024060503833	B	USDMXN	06/10/2024	157,919	17.51447	(2,765,864)
2024060503831	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.50699	17,506,990
2024060603038	B	USDMXN	06/10/2024	2,000,000	17.53194	(35,063,880)
2024060603136	B	USDMXN	06/10/2024	2,000,000	17.51722	(35,034,440)
2024060603581	B	USDMXN	06/10/2024	5,000,000	17.535	(87,675,000)
2024060603678	B	USDMXN	06/10/2024	2,000,000	17.64925	(35,298,500)
2024060603725	B	USDMXN	06/10/2024	500,000	17.8999	(8,949,950)
2024060603748	B	USDMXN	06/10/2024	200,000	17.846	(3,569,200)
2024060603052	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.5319	17,531,900
2024060603058	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.52891	17,528,910
2024060603139	S	USDMXN	06/10/2024	(50,000,000)	17.505	875,250,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024060603150	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.50711	17,507,110
2024060603155	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.5074	17,507,400
2024060603246	S	USDMXN	06/10/2024	(2,000,000)	17.54277	35,085,540
2024060603276	S	USDMXN	06/10/2024	(2,000,000)	17.54895	35,097,900
2024060603309	S	USDMXN	06/10/2024	(1,000,000)	17.55015	17,550,150
2024040403581	B	USDMXN	06/10/2024	50,000,000	16.7338	(836,690,000)
2024050703062	B	USDMXN	06/10/2024	50,000,000	16.9352	(846,760,000)
2024050703065	B	USDMXN	06/10/2024	50,000,000	16.9402	(847,010,000)
2024060603027	S	USDMXN	06/10/2024	(120,237)	17.5625	2,111,669
2024060603128	S	USDMXN	06/10/2024	(30,000,000)	17.529	525,870,000
2024060603132	S	USDMXN	06/10/2024	(30,000,000)	17.529	525,870,000
2024060603446	S	USDMXN	06/10/2024	(100,000,000)	17.548	1,754,800,000
2024060603593	S	USDMXN	06/10/2024	(56,996,000)	17.55355	1,000,482,136
2024060603609	S	USDMXN	06/10/2024	(20,000,000)	17.54	350,800,000
2024060603671	S	USDMXN	06/10/2024	(20,000,000)	17.525	350,500,000
2024060603676	S	USDMXN	06/10/2024	(60,000,000)	17.56	1,053,600,000
2024060603693	S	USDMXN	06/10/2024	(85,372,000)	17.57855	1,500,715,971
2024060603714	S	USDMXN	06/10/2024	(148,000,000)	17.9384	2,654,883,200
2024060603720	S	USDMXN	06/10/2024	(632,000)	17.9677	11,355,586
2024060603732	S	USDMXN	06/10/2024	(14,000,000)	17.6015	246,421,000
2024060603832	S	USDMXN	06/10/2024	(148,000,000)	17.9384	2,654,883,200
2024060703067	B	USDMXN	06/10/2024	90,664,533	18.0916	(1,640,266,466)
2024060703071	B	USDMXN	06/10/2024	49,896,327	18.0374	(900,000,000)
2024060703232	B	USDMXN	06/10/2024	403,627	18.29099	(7,382,738)
2024060703236	B	USDMXN	06/10/2024	134,000,000	18.325	(2,455,550,000)
2024060703240	B	USDMXN	06/10/2024	130,000,000	18.325	(2,382,250,000)
2024040903065	B	EURUSD	04/11/2024	1,000,000	1.08581	(1,085,810)
2024040903146	B	EURUSD	04/11/2024	1,000,000	1.08541	(1,085,410)
2024040903444	B	EURUSD	04/11/2024	1,000,000	1.08529	(1,085,290)
2024040903298	S	EURUSD	04/11/2024	(2,000,000)	1.086	2,172,000
2024040903603	S	EURUSD	04/11/2024	(1,000,000)	1.08478	1,084,780
2023122203613	BO	USDMXN	04/11/2024	50,000	17.2699	(863,495)
2024010303413	BO	USDMXN	04/11/2024	30,528	17.32494	(528,896)
2024010303520	SO	USDMXN	04/11/2024	(14,108)	17.32784	244,461
2024022703472	BO	USDMXN	04/11/2024	500,000	17.17758	(8,588,791)
2024040203758	BO	USDMXN	04/11/2024	13,870	16.57997	(229,964)
2024040803695	S	USDMXN	04/11/2024	(1,000,000)	16.32038	16,320,380
2024040803696	S	USDMXN	04/11/2024	(1,000,000)	16.3172	16,317,200
2024040903032	B	USDMXN	04/11/2024	2,000,000	16.31287	(32,625,740)
2024040903048	B	USDMXN	04/11/2024	30,000,000	16.316	(489,480,000)
2024040903052	B	USDMXN	04/11/2024	10,000,000	16.33	(163,300,000)
2024040903056	B	USDMXN	04/11/2024	20,000,000	16.33	(326,600,000)
2024040903319	B	USDMXN	04/11/2024	3,000,000	16.39529	(49,185,870)
2024040903321	B	USDMXN	04/11/2024	1,000,000	16.3986	(16,398,600)
2024040903552	B	USDMXN	04/11/2024	1,000,000	16.40508	(16,405,080)
2024040903705	B	USDMXN	04/11/2024	500,000	16.39245	(8,196,225)
2024040903039	S	USDMXN	04/11/2024	(2,000,000)	16.34	32,680,000
2024040903044	S	USDMXN	04/11/2024	(10,000,000)	16.33	163,300,000
2024040903046	S	USDMXN	04/11/2024	(20,000,000)	16.33	326,600,000
2024040903202	S	USDMXN	04/11/2024	(1,000,000)	16.36	16,360,000
2024040903209	S	USDMXN	04/11/2024	(1,000,000)	16.36393	16,363,930
2024040903415	S	USDMXN	04/11/2024	(1,000,000)	16.405	16,405,000
2024040903441	S	USDMXN	04/11/2024	(2,649,460)	16.405	43,464,391
2024040903605	S	USDMXN	04/11/2024	(3,000,000)	16.42	49,260,000
2024041003003	B	USDMXN	04/11/2024	30,000,000	16.4526	(493,578,000)
2024041103567	S	USDMXN	04/11/2024	(20,000,000)	16.427	328,540,000
2024010903111	B	USDMXN	04/11/2024	30,000,000	17.155	(514,650,000)
2024030703657	B	USDMXN	04/11/2024	50,000,000	16.9445	(847,225,000)
2024040203104	B	USDMXN	04/11/2024	42,331,506	16.6117	(703,198,279)
2024040903037	B	USDMXN	04/11/2024	122,530,250	16.3225	(2,000,000,000)
2024040903119	B	USDMXN	04/11/2024	100,596,969	16.3325	(1,643,000,000)
2024040903130	B	USDMXN	04/11/2024	123,000,000	16.3195	(2,007,298,500)
2024040903382	B	USDMXN	04/11/2024	100,000,000	16.4025	(1,640,250,000)
2024040903553	B	USDMXN	04/11/2024	50,000,000	16.397	(819,850,000)
2024040903138	S	USDMXN	04/11/2024	(524,644)	16.3461	8,575,889
2024040903375	S	USDMXN	04/11/2024	(100,000,000)	16.38	1,638,000,000
2024040903378	S	USDMXN	04/11/2024	(50,000,000)	16.38	819,000,000
2024040903432	S	USDMXN	04/11/2024	(50,000,000)	16.404	820,200,000
2024040903567	S	USDMXN	04/11/2024	(80,000,000)	16.392	1,311,360,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024041003061	S	USDMXN	04/11/2024	(16,792)	16.45514	276,317
2024041003087	S	USDMXN	04/11/2024	(200,000,000)	16.466	3,293,200,000
2024041003095	S	USDMXN	04/11/2024	(196,000,000)	16.45	3,224,200,000
2024041103016	B	USDMXN	04/11/2024	121,500,000	16.43	(1,996,245,000)
2024041103244	B	USDMXN	04/11/2024	121,500,000	16.43	(1,996,245,000)
2024041103019	S	USDMXN	04/11/2024	(121,500,000)	16.43	1,996,245,000
2024060703075	B	EURUSD	06/11/2024	1,000,000	1.08238	(1,082,380)
2024060703109	S	EURUSD	06/11/2024	(1,000,000)	1.08117	1,081,170
2023092703619	S	USDMXN	06/11/2024	(151,253)	18.44956	2,790,556
2024020803418	SO	USDMXN	06/11/2024	(165,885)	17.48298	2,900,164
2024021603562	BO	USDMXN	06/11/2024	100,000	17.36094	(1,736,094)
2024052203213	SO	USDMXN	06/11/2024	(221,982)	16.68344	3,703,423
2024052303749	SO	USDMXN	06/11/2024	(374,000)	16.7685	6,271,419
2024060603840	S	USDMXN	06/11/2024	(130,603)	17.97343	2,347,388
2024060703190	B	USDMXN	06/11/2024	1,000,000	18.2575	(18,257,500)
2024060703191	B	USDMXN	06/11/2024	1,000,000	18.2567	(18,256,700)
2024060703438	B	USDMXN	06/11/2024	1,000,000	18.3182	(18,318,200)
2024060703454	B	USDMXN	06/11/2024	1,000,000	18.26995	(18,269,950)
2024060703487	B	USDMXN	06/11/2024	25,000	18.3228	(458,070)
2024060703108	S	USDMXN	06/11/2024	(80,000)	18.34532	1,467,626
2024060703250	S	USDMXN	06/11/2024	(2,000,000)	18.325	36,650,000
2024060703425	S	USDMXN	06/11/2024	(1,000,000)	18.32373	18,323,730
2024060703452	S	USDMXN	06/11/2024	(1,000,000)	18.28304	18,283,040
2024061103011	B	USDMXN	06/11/2024	750,000	18.37518	(13,781,388)
2024061103044	S	USDMXN	06/11/2024	(8,100,000)	18.49	149,769,000
2024061103862	S	USDMXN	06/11/2024	(746,660)	18.293	13,658,651
2024030703295	B	USDMXN	06/11/2024	30,000,000	17.13	(513,900,000)
2024040903568	B	USDMXN	06/11/2024	80,000,000	16.5515	(1,324,120,000)
2024060703624	B	USDMXN	06/11/2024	50,000,000	18.355	(917,750,000)
2024060703626	B	USDMXN	06/11/2024	50,000,000	18.345	(917,250,000)
2024060703076	S	USDMXN	06/11/2024	(2,159,000)	18.12871	39,139,885
2024060703233	S	USDMXN	06/11/2024	(403,627)	18.2936	7,383,791
2024060703237	S	USDMXN	06/11/2024	(134,000,000)	18.3279	2,455,938,600
2024060703241	S	USDMXN	06/11/2024	(130,000,000)	18.3279	2,382,627,000
2024061003112	B	USDMXN	06/11/2024	58,000,000	18.41	(1,067,780,000)
2024061003115	B	USDMXN	06/11/2024	779,224	18.40762	(14,343,657)
2024032003283	B	EURMXN	04/12/2024	60,000,000	18.25528	(1,095,316,854)
2024041003032	B	EURUSD	04/12/2024	2,000,000	1.07563	(2,151,260)
2024041003157	B	EURUSD	04/12/2024	1,000,000	1.07473	(1,074,730)
2024041003200	B	EURUSD	04/12/2024	2,000,000	1.07379	(2,147,580)
2024041003059	S	EURUSD	04/12/2024	(1,000,000)	1.07548	1,075,480
2024041003163	S	EURUSD	04/12/2024	(1,000,000)	1.07431	1,074,310
2024041003164	S	EURUSD	04/12/2024	(1,000,000)	1.0743	1,074,300
2024041003331	S	EURUSD	04/12/2024	(2,000,000)	1.07373	2,147,460
2023041403199	SO	USDJPY	04/12/2024	(14,840,000)	126.6618	1,879,661,112
2024013003053	BO	JPYUSD	04/12/2024	20,272,000	145.5917	(139,239)
2023031003693	S	USDMXN	04/12/2024	(39,000)	19.84781	774,065
2023090703390	SO	USDMXN	04/12/2024	(39,000)	18.21008	710,193
2024011103425	BO	USDMXN	04/12/2024	63,017	17.21853	(1,085,060)
2024021403414	BO	USDMXN	04/12/2024	132,000	17.26312	(2,278,732)
2024022703799	BO	USDMXN	04/12/2024	100,000	17.18256	(1,718,256)
2024030803366	B	USDMXN	04/12/2024	50,000,000	16.886	(844,300,000)
2024040203605	SO	USDMXN	04/12/2024	(41,447)	16.59439	687,788
2024040303156	S	USDMXN	04/12/2024	(150,000,000)	16.5799	2,486,985,000
2024040903790	B	USDMXN	04/12/2024	180,000	16.38906	(2,950,031)
2024041003030	B	USDMXN	04/12/2024	1,000,000	16.46375	(16,463,750)
2024041003031	B	USDMXN	04/12/2024	1,000,000	16.46614	(16,466,140)
2024041003308	B	USDMXN	04/12/2024	1,500,000	16.475	(24,712,500)
2024041003330	B	USDMXN	04/12/2024	2,000,000	16.4602	(32,920,400)
2024041003476	B	USDMXN	04/12/2024	1,000,000	16.44031	(16,440,310)
2024041003477	B	USDMXN	04/12/2024	1,000,000	16.44073	(16,440,730)
2024041003058	S	USDMXN	04/12/2024	(1,000,000)	16.4581	16,458,100
2024041003075	S	USDMXN	04/12/2024	(1,000,000)	16.4655	16,465,500
2024041003150	S	USDMXN	04/12/2024	(50,000,000)	16.485	824,250,000
2024041003364	S	USDMXN	04/12/2024	(2,000,000)	16.44015	32,880,300
2024041003396	S	USDMXN	04/12/2024	(100,000)	16.4616	1,646,160
2024041003398	S	USDMXN	04/12/2024	(1,000,000)	16.46202	16,462,020
2024041003401	S	USDMXN	04/12/2024	(1,000,000)	16.45936	16,459,360
2024041003438	S	USDMXN	04/12/2024	(20,000,000)	16.4354	328,708,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024041003632	S	USDMXN	04/12/2024	(450,000)	16.43666	7,396,497
2024041003637	S	USDMXN	04/12/2024	(50,000,000)	16.465	823,250,000
2024041103080	S	USDMXN	04/12/2024	(107,000,000)	16.455	1,760,685,000
2024041103216	S	USDMXN	04/12/2024	(30,000,000)	16.47	494,100,000
2024030703645	B	USDJPY	04/12/2024	15,000,000	147.2967	(2,209,450,500)
2024011003002	B	USDMXN	04/12/2024	4,000,000	17.2285	(68,914,000)
2024040203108	B	USDMXN	04/12/2024	74,915,777	16.6168	(1,244,860,479)
2024040303221	S	USDMXN	04/12/2024	(50,000,000)	16.5963	829,815,000
2024041003062	B	USDMXN	04/12/2024	16,792	16.4579	(276,363)
2024041003073	B	USDMXN	04/12/2024	50,000,000	16.47	(823,500,000)
2024041003088	B	USDMXN	04/12/2024	200,000,000	16.46855	(3,293,710,000)
2024041003096	B	USDMXN	04/12/2024	196,000,000	16.45255	(3,224,699,800)
2024041003193	B	USDMXN	04/12/2024	30,000,000	16.505	(495,150,000)
2024041003600	B	USDMXN	04/12/2024	30,000,000	16.44	(493,200,000)
2024041003070	S	USDMXN	04/12/2024	(20,000,000)	16.453	329,060,000
2024041003490	S	USDMXN	04/12/2024	(50,000,000)	16.447	822,350,000
2024041103020	B	USDMXN	04/12/2024	121,500,000	16.43255	(1,996,554,825)
2024041103000	S	USDMXN	04/12/2024	(54,871,357)	16.402	900,000,000
2024041103005	S	USDMXN	04/12/2024	(54,851,292)	16.408	900,000,000
2024041103009	S	USDMXN	04/12/2024	(54,851,292)	16.408	900,000,000
2024041103017	S	USDMXN	04/12/2024	(121,500,000)	16.43255	1,996,554,825
2024041103245	S	USDMXN	04/12/2024	(121,500,000)	16.43255	1,996,554,825
2024061003160	B	EURUSD	06/12/2024	1,000,000	1.07568	(1,075,680)
2024061003183	B	EURUSD	06/12/2024	1,000,000	1.07581	(1,075,810)
2024061003308	B	EURUSD	06/12/2024	1,000,000	1.07589	(1,075,890)
2024061003118	S	EURUSD	06/12/2024	(1,000,000)	1.07463	1,074,630
2024061003132	S	EURUSD	06/12/2024	(1,000,000)	1.07464	1,074,640
2024061003267	S	EURUSD	06/12/2024	(1,000,000)	1.07546	1,075,460
2023060603443	B	USDMXN	06/12/2024	750,000	18.63781	(13,978,359)
2023060603555	S	USDMXN	06/12/2024	(750,000)	18.60442	13,953,317
2023071803049	BO	USDMXN	06/12/2024	200,000	17.75938	(3,551,875)
2023072003612	BO	USDMXN	06/12/2024	250,000	17.94984	(4,487,461)
2023090603298	S	USDMXN	06/12/2024	(208,333)	18.47192	3,848,317
2023090803328	SO	USDMXN	06/12/2024	(125,000)	18.46325	2,307,906
2023092603223	SO	USDMXN	06/12/2024	(166,667)	18.29372	3,048,953
2023100303498	SO	USDMXN	06/12/2024	(166,667)	18.69634	3,116,056
2023101703654	S	USDMXN	06/12/2024	(833,333)	18.74042	15,617,017
2023112103455	B	USDMXN	06/12/2024	500,000	17.82268	(8,911,342)
2023121403844	BO	USDMXN	06/12/2024	180,000	17.69118	(3,184,412)
2023121903859	B	USDMXN	06/12/2024	368,500	17.57715	(6,477,179)
2024010503486	BO	USDMXN	06/12/2024	100,000	17.36297	(1,736,297)
2024010803665	B	USDMXN	06/12/2024	300,000	17.25084	(5,175,253)
2024031303480	BO	USDMXN	06/12/2024	50,000	16.9311	(846,555)
2024040203757	BO	USDMXN	06/12/2024	61,200	16.74515	(1,024,803)
2024052203611	BO	USDMXN	06/12/2024	38,764	16.72496	(648,326)
2024061003060	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.49685	(18,496,850)
2024061003061	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.49619	(18,496,190)
2024061003096	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.36235	(18,362,350)
2024061003097	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.35943	(18,359,430)
2024061003203	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.38	(18,380,000)
2024061003224	B	USDMXN	06/12/2024	50,000,000	18.4	(920,000,000)
2024061003226	B	USDMXN	06/12/2024	100,000,000	18.3765	(1,837,650,000)
2024061003264	B	USDMXN	06/12/2024	1,000,000	18.397	(18,397,000)
2024061003502	B	USDMXN	06/12/2024	75,000,000	18.325	(1,374,375,000)
2024061003065	S	USDMXN	06/12/2024	(1,000,000)	18.44665	18,446,650
2024061003067	S	USDMXN	06/12/2024	(1,000,000)	18.43533	18,435,330
2024061003102	S	USDMXN	06/12/2024	(2,000,000)	18.3953	36,790,600
2024061003145	S	USDMXN	06/12/2024	(1,000,000)	18.40354	18,403,540
2024061003273	S	USDMXN	06/12/2024	(1,000,000)	18.32047	18,320,470
2024061103045	B	USDMXN	06/12/2024	8,100,000	18.4928	(149,791,680)
2024061103012	S	USDMXN	06/12/2024	(750,000)	18.37809	13,783,567
2023122203676	SO	USDMXN	06/12/2024	(15,100,000)	17.5858	265,545,580
2023122203680	SO	USDMXN	06/12/2024	(15,100,000)	17.5858	265,545,580
2024040103932	S	USDMXN	06/12/2024	(21,000,000)	16.8185	353,188,500
2024041003074	S	USDMXN	06/12/2024	(50,000,000)	16.631	831,550,000
2024041003194	S	USDMXN	06/12/2024	(30,000,000)	16.6665	499,995,000
2024050803363	BO	USDMXN	06/12/2024	126,000	16.97478	(2,138,822)
2024050803365	BO	USDMXN	06/12/2024	126,000	16.97478	(2,138,822)
2024060603366	B	USDMXN	06/12/2024	20,000,000	17.562	(351,240,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024061003113	S	USDMXN	06/12/2024	(58,000,000)	18.41305	1,067,956,900
2024061003116	S	USDMXN	06/12/2024	(779,224)	18.4106	14,345,981
2024061003231	S	USDMXN	06/12/2024	(70,000,000)	18.407	1,288,490,000
2024061003546	S	USDMXN	06/12/2024	(20,000,000)	18.275	365,500,000
2024061103071	B	USDMXN	06/12/2024	63,000,000	18.43	(1,161,090,000)
2024061103078	B	USDMXN	06/12/2024	733,150	18.44248	(13,521,111)
2024061203272	B	USDMXN	06/12/2024	26,624,000	18.78	(499,998,720)
2024061203274	B	USDMXN	06/12/2024	26,624,000	18.78	(499,998,720)
2024061203277	S	USDMXN	06/12/2024	(26,624,000)	18.78	499,998,720
2024061203279	S	USDMXN	06/12/2024	(26,624,000)	18.78	499,998,720
2024041103079	B	EURUSD	04/15/2024	2,000,000	1.07038	(2,140,760)
2024041103396	B	EURUSD	04/15/2024	1,000,000	1.07249	(1,072,490)
2024041103491	B	EURUSD	04/15/2024	1,000,000	1.07277	(1,072,770)
2024041103262	S	EURUSD	04/15/2024	(2,000,000)	1.07192	2,143,840
2023031003630	SO	USDMXN	04/15/2024	(175,000)	19.90657	3,483,649
2023031403148	SO	USDMXN	04/15/2024	(175,000)	20.57823	3,601,190
2023071303123	B	USDMXN	04/15/2024	409,230	17.80271	(7,285,404)
2023091403454	B	USDMXN	04/15/2024	409,230	17.72662	(7,254,266)
2023102603554	B	USDMXN	04/15/2024	2,205,000	18.70795	(41,251,039)
2023110603393	B	USDMXN	04/15/2024	350,000	18.0054	(6,301,889)
2023111403695	B	USDMXN	04/15/2024	875,789	17.81982	(15,606,407)
2023121803626	BO	USDMXN	04/15/2024	564,749	17.49987	(9,883,032)
2024020903245	S	USDMXN	04/15/2024	(2,000,000)	17.2695	34,539,000
2024020903252	S	USDMXN	04/15/2024	(30,000,000)	17.2695	518,085,000
2024031303476	BO	USDMXN	04/15/2024	2,500,000	16.76	(41,900,000)
2024032703852	SO	USDMXN	04/15/2024	(585,000)	16.59318	9,707,010
2024040103582	BO	USDMXN	04/15/2024	44,000	16.68572	(734,172)
2024041103081	B	USDMXN	04/15/2024	107,000,000	16.46265	(1,761,503,550)
2024041103217	B	USDMXN	04/15/2024	30,000,000	16.47765	(494,329,500)
2024041103257	B	USDMXN	04/15/2024	2,000,000	16.45162	(32,903,240)
2024041103388	B	USDMXN	04/15/2024	5,000,000	16.5386	(82,693,000)
2024041103392	B	USDMXN	04/15/2024	250,000	16.4536	(4,113,400)
2024041103534	B	USDMXN	04/15/2024	100,000	16.42951	(1,642,951)
2024041103568	B	USDMXN	04/15/2024	20,000,000	16.4374	(328,748,000)
2024041103643	B	USDMXN	04/15/2024	2,000,000	16.445	(32,890,000)
2024041103747	B	USDMXN	04/15/2024	190,000	16.43709	(3,123,047)
2024041103077	S	USDMXN	04/15/2024	(2,000,000)	16.48343	32,966,860
2024041103119	S	USDMXN	04/15/2024	(50,000,000)	16.477	823,850,000
2024041103300	S	USDMXN	04/15/2024	(30,000,000)	16.45	493,500,000
2024041103399	S	USDMXN	04/15/2024	(1,000,000)	16.431	16,431,000
2024041103470	S	USDMXN	04/15/2024	(1,000,000)	16.44625	16,446,250
2024041103557	S	USDMXN	04/15/2024	(10,000,000)	16.427	164,270,000
2024041103632	S	USDMXN	04/15/2024	(1,000,000)	16.44664	16,446,640
2024041103640	S	USDMXN	04/15/2024	(1,000,000)	16.44632	16,446,320
2024041103644	S	USDMXN	04/15/2024	(4,000,000)	16.445	65,780,000
2024041103681	S	USDMXN	04/15/2024	(50,000,000)	16.445	822,250,000
2024041103689	S	USDMXN	04/15/2024	(4,000,000)	16.445	65,780,000
2024041503216	BO	USDMXN	04/15/2024	3,000,000	16.65732	(49,971,960)
2024041503627	B	USDMXN	04/15/2024	30,000,000	16.725	(501,750,000)
2023101103054	S	USDMXN	04/15/2024	(20,000,000)	18.376	367,520,000
2024040403003	B	USDMXN	04/15/2024	13,265,466	16.5471	(219,505,000)
2024041103047	B	USDMXN	04/15/2024	1,275,000	16.45894	(20,985,149)
2024041103218	B	USDMXN	04/15/2024	50,000,000	16.485	(824,250,000)
2024041103695	B	USDMXN	04/15/2024	50,000,000	16.445	(822,250,000)
2024041103699	B	USDMXN	04/15/2024	50,000,000	16.445	(822,250,000)
2024041103779	B	USDMXN	04/15/2024	20,000,000	16.439	(328,780,000)
2024041103782	B	USDMXN	04/15/2024	30,000,000	16.439	(493,170,000)
2024041103458	S	USDMXN	04/15/2024	(5,000,000)	16.452	82,260,000
2024041103467	S	USDMXN	04/15/2024	(15,000,000)	16.452	246,780,000
2024041103480	S	USDMXN	04/15/2024	(10,000,000)	16.441	164,410,000
2024041103483	S	USDMXN	04/15/2024	(15,000,000)	16.442	246,630,000
2024041203349	S	USDMXN	04/15/2024	(1,626)	16.67783	27,124
2024041203628	S	USDMXN	04/15/2024	(92,000,000)	16.62	1,529,040,000
2024040203607	BO	EURMXN	04/16/2024	134,229	17.88241	(2,400,338)
2024041203251	B	EURUSD	04/16/2024	1,000,000	1.06465	(1,064,650)
2024041203343	B	EURUSD	04/16/2024	1,000,000	1.06385	(1,063,850)
2024041203148	S	EURUSD	04/16/2024	(1,000,000)	1.06359	1,063,590
2024041203155	S	EURUSD	04/16/2024	(1,000,000)	1.06372	1,063,720
2024041203268	S	EURUSD	04/16/2024	(1,000,000)	1.06475	1,064,750

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092703617	S	USDMXN	04/16/2024	(98,288)	18.27386	1,796,104
2023101803218	SO	USDMXN	04/16/2024	(95,633)	18.83804	1,801,539
2023102703321	SO	USDMXN	04/16/2024	(96,871)	18.58531	1,800,377
2023110703546	SO	USDMXN	04/16/2024	(99,917)	17.92492	1,791,004
2023111403618	B	USDMXN	04/16/2024	100,000	17.82879	(1,782,879)
2023111403367	S	USDMXN	04/16/2024	(100,677)	17.87151	1,799,250
2023121903362	B	USDMXN	04/16/2024	2,044,206	17.40973	(35,589,070)
2023121903605	B	USDMXN	04/16/2024	1,812,786	17.41095	(31,562,334)
2024010903396	B	USDMXN	04/16/2024	1,968,313	17.23707	(33,927,943)
2024011603708	B	USDMXN	04/16/2024	1,431,003	17.46496	(24,992,414)
2024020803386	SO	USDMXN	04/16/2024	(115,567)	17.31109	2,000,591
2024022803291	SO	USDMXN	04/16/2024	(116,144)	17.22782	2,000,907
2024040103882	BO	USDMXN	04/16/2024	218,642	16.67579	(3,646,027)
2024041203212	B	USDMXN	04/16/2024	1,000,000	16.71682	(16,716,820)
2024041203213	B	USDMXN	04/16/2024	1,000,000	16.715	(16,715,000)
2024041203267	B	USDMXN	04/16/2024	1,000,000	16.66291	(16,662,910)
2024041203510	B	USDMXN	04/16/2024	559,000	16.60716	(9,283,402)
2024041203514	B	USDMXN	04/16/2024	298,000	16.62164	(4,953,249)
2024041203762	B	USDMXN	04/16/2024	60,000	16.65539	(999,323)
2024041203250	S	USDMXN	04/16/2024	(1,000,000)	16.67654	16,676,540
2024041203342	S	USDMXN	04/16/2024	(1,000,000)	16.68418	16,684,180
2024041203360	S	USDMXN	04/16/2024	(50,000,000)	16.663	833,150,000
2024041203743	S	USDMXN	04/16/2024	(1,000,000)	16.64818	16,648,180
2024041503628	S	USDMXN	04/16/2024	(30,000,000)	16.72755	501,826,500
2024041203350	B	USDMXN	04/16/2024	1,626	16.6805	(27,128)
2024041203630	B	USDMXN	04/16/2024	92,000,000	16.62255	(1,529,274,600)
2024041203622	S	USDMXN	04/16/2024	(50,000,000)	16.663	833,150,000
2024041503113	B	USDMXN	04/16/2024	125,254	16.71338	(2,093,424)
2024041503008	S	USDMXN	04/16/2024	(55,507,938)	16.608	921,875,837
2024041503078	B	EURUSD	04/17/2024	1,000,000	1.06275	(1,062,750)
2024041503223	B	EURUSD	04/17/2024	2,000,000	1.06447	(2,128,940)
2024041503086	S	EURUSD	04/17/2024	(1,000,000)	1.06352	1,063,520
2024041503188	S	EURUSD	04/17/2024	(1,000,000)	1.06365	1,063,650
2024041503189	S	EURUSD	04/17/2024	(1,000,000)	1.06366	1,063,660
2023090603291	S	USDMXN	04/17/2024	(208,333)	18.28378	3,809,121
2023090803327	SO	USDMXN	04/17/2024	(125,000)	18.28423	2,285,529
2023092603221	SO	USDMXN	04/17/2024	(166,667)	18.12153	3,020,256
2023100303495	SO	USDMXN	04/17/2024	(166,667)	18.51846	3,086,409
2023101203188	B	USDMXN	04/17/2024	1,203,054	18.48724	(22,241,153)
2023101703665	SO	USDMXN	04/17/2024	(833,333)	18.58143	15,484,522
2023121803834	BO	USDMXN	04/17/2024	12,800	17.51081	(224,138)
2024011203650	B	USDMXN	04/17/2024	60,904	17.11346	(1,042,278)
2024011203081	S	USDMXN	04/17/2024	(30,000,000)	17.12656	513,796,920
2024011203377	S	USDMXN	04/17/2024	(30,000,000)	17.11	513,300,000
2024011703870	B	USDMXN	04/17/2024	93,633	17.4724	(1,635,993)
2024012303350	B	USDMXN	04/17/2024	226,409	17.61875	(3,989,049)
2024021403208	BO	USDMXN	04/17/2024	59,200	17.27402	(1,022,622)
2024021403231	BO	USDMXN	04/17/2024	59,200	17.27392	(1,022,616)
2024022603141	BO	USDMXN	04/17/2024	47,600	17.25714	(821,440)
2024031103679	BO	USDMXN	04/17/2024	40,050	16.89679	(676,716)
2024031203649	BO	USDMXN	04/17/2024	91,500	16.88526	(1,545,001)
2024032003411	BO	USDMXN	04/17/2024	37,800	16.75293	(633,261)
2024041503085	B	USDMXN	04/17/2024	1,000,000	16.6716	(16,671,600)
2024041503087	B	USDMXN	04/17/2024	1,000,000	16.6685	(16,668,500)
2024041503112	B	USDMXN	04/17/2024	2,000,000	16.72768	(33,455,360)
2024041503196	B	USDMXN	04/17/2024	1,000,000	16.6756	(16,675,600)
2024041503201	B	USDMXN	04/17/2024	9,040,000	16.7	(150,968,000)
2024041503284	B	USDMXN	04/17/2024	40,000,000	16.64	(665,600,000)
2024041503312	B	USDMXN	04/17/2024	3,000,000	16.652	(49,956,000)
2024041503316	B	USDMXN	04/17/2024	80,000,000	16.652	(1,332,160,000)
2024041503531	B	USDMXN	04/17/2024	2,500,000	16.7	(41,750,000)
2024041503629	B	USDMXN	04/17/2024	30,000,000	16.72	(501,600,000)
2024041503089	S	USDMXN	04/17/2024	(1,000,000)	16.70148	16,701,480
2024041503092	S	USDMXN	04/17/2024	(1,000,000)	16.70374	16,703,740
2024041503222	S	USDMXN	04/17/2024	(2,000,000)	16.64575	33,291,500
2024041503228	S	USDMXN	04/17/2024	(1,000,000)	16.64277	16,642,770
2024041503390	S	USDMXN	04/17/2024	(1,000,000)	16.70412	16,704,120
2023082303186	B	USDMXN	04/17/2024	54,320,000	17.542	(952,881,440)
2023082303233	S	USDMXN	04/17/2024	(25,000,000)	17.5375	438,437,500

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023082303344	S	USDMXN	04/17/2024	(30,000,000)	17.5395	526,185,000
2023082403075	B	USDMXN	04/17/2024	45,621,962	17.51	(798,840,560)
2023082403079	B	MXNUSD	04/17/2024	798,840,560	17.51364	(45,612,491)
2023091103067	B	USDMXN	04/17/2024	69,230,000	18.159	(1,257,147,570)
2023091103127	S	USDMXN	04/17/2024	(39,230,000)	18.13818	711,560,762
2023091103157	S	USDMXN	04/17/2024	(30,000,000)	18.1465	544,395,000
2024040803151	S	USDMXN	04/17/2024	(100,000,000)	16.38	1,638,000,000
2024041503202	B	USDMXN	04/17/2024	578,000	16.67898	(9,640,450)
2024041503510	B	USDMXN	04/17/2024	50,000,000	16.7175	(835,875,000)
2024041503512	B	USDMXN	04/17/2024	50,000,000	16.7175	(835,875,000)
2024041503517	B	USDMXN	04/17/2024	15,000,000	16.721	(250,815,000)
2024041503114	S	USDMXN	04/17/2024	(125,254)	16.7159	2,093,740
2024041503468	S	USDMXN	04/17/2024	(100,000,000)	16.725	1,672,500,000
2024041503507	S	USDMXN	04/17/2024	(50,000,000)	16.7175	835,875,000
2024041503515	S	USDMXN	04/17/2024	(50,000,000)	16.7175	835,875,000
2024041503665	S	USDMXN	04/17/2024	(50,000,000)	16.718	835,900,000
2024041603050	B	USDMXN	04/17/2024	735,754	17.01563	(12,519,324)
2024041603120	B	USDMXN	04/17/2024	32,184,740	17.054	(548,878,560)
2024041603285	B	USDMXN	04/17/2024	815,260	17.02343	(13,878,522)
2024041603670	B	USDMXN	04/17/2024	155,000,000	17.013	(2,637,015,000)
2023021603196	BO	USDMXN	04/18/2024	3,950,000	20.10297	(79,406,732)
2023120803647	BO	USDMXN	04/18/2024	94,488	17.719	(1,674,233)
2023120803652	BO	USDMXN	04/18/2024	10,124	17.71963	(179,394)
2024010303414	BO	USDMXN	04/18/2024	30,528	17.3453	(529,517)
2024010303524	BO	USDMXN	04/18/2024	63,917	17.34519	(1,108,651)
2024011603193	S	USDMXN	04/18/2024	(30,000,000)	17.396	521,880,000
2024041603045	B	USDMXN	04/18/2024	1,000,000	16.96342	(16,963,420)
2024041603100	B	USDMXN	04/18/2024	30,000,000	17.03	(510,900,000)
2024041603189	B	USDMXN	04/18/2024	2,000,000	17.01	(34,020,000)
2024041603302	B	USDMXN	04/18/2024	50,000,000	17.037	(851,850,000)
2024041603367	B	USDMXN	04/18/2024	50,000,000	17.025	(851,250,000)
2024041603428	B	USDMXN	04/18/2024	1,000,000	17.04151	(17,041,510)
2024041603578	B	USDMXN	04/18/2024	1,000,000	17.0109	(17,010,900)
2024041603762	B	USDMXN	04/18/2024	68,900	17.05743	(1,175,257)
2024041603046	S	USDMXN	04/18/2024	(1,000,000)	17.00495	17,004,950
2024041603085	S	USDMXN	04/18/2024	(1,000,000)	17.0418	17,041,800
2024041603113	S	USDMXN	04/18/2024	(1,000,000)	17.0377	17,037,700
2024041603463	S	USDMXN	04/18/2024	(2,742,345)	17.02	46,674,712
2024041603539	S	USDMXN	04/18/2024	(5,000,000)	17	85,000,000
2024041603540	S	USDMXN	04/18/2024	(4,000,000)	16.99903	67,996,120
2024040903376	B	USDMXN	04/18/2024	100,000,000	16.3977	(1,639,770,000)
2024040903379	B	USDMXN	04/18/2024	50,000,000	16.3977	(819,885,000)
2024041603051	S	USDMXN	04/18/2024	(735,754)	17.0182	12,521,215
2024041603277	S	USDMXN	04/18/2024	(80,000,000)	17.04	1,363,200,000
2024041603286	S	USDMXN	04/18/2024	(815,260)	17.0259	13,880,534
2024041603289	S	USDMXN	04/18/2024	(330,000)	17.0273	5,619,009
2024041603327	S	USDMXN	04/18/2024	(10,000,000)	17	170,000,000
2024041603671	S	USDMXN	04/18/2024	(155,000,000)	17.0155	2,637,402,500
2024041603674	S	USDMXN	04/18/2024	(10,000,000)	17.015	170,150,000
2024041703209	B	USDMXN	04/18/2024	22,000,000	16.954	(372,988,000)
2024041703212	B	USDMXN	04/18/2024	639,832	17.02742	(10,894,683)
2024041703379	B	EURUSD	04/19/2024	1,000,000	1.06596	(1,065,960)
2024041703390	B	EURUSD	04/19/2024	1,000,000	1.0662	(1,066,200)
2024041703320	S	EURUSD	04/19/2024	(1,000,000)	1.06532	1,065,320
2024041703333	S	EURUSD	04/19/2024	(1,000,000)	1.06549	1,065,490
2023031003691	S	USDMXN	04/19/2024	(39,000)	19.86494	774,733
2023090703389	SO	USDMXN	04/19/2024	(39,000)	18.23295	711,085
2024011103436	BO	USDMXN	04/19/2024	63,017	17.23885	(1,086,341)
2024022003800	BO	USDMXN	04/19/2024	55,000	17.22959	(947,627)
2024022703800	BO	USDMXN	04/19/2024	100,000	17.20116	(1,720,116)
2024030803875	BO	USDMXN	04/19/2024	1,000,000	16.91771	(16,917,713)
2024031303498	BO	USDMXN	04/19/2024	500,000	16.77334	(8,386,670)
2024031303753	BO	USDMXN	04/19/2024	367,000	16.76134	(6,151,412)
2024031403539	BO	USDMXN	04/19/2024	500,000	16.79634	(8,398,169)
2024041203389	SO	USDMXN	04/19/2024	(462,000)	16.70535	7,717,870
2024041603836	B	USDMXN	04/19/2024	310,000	17.08292	(5,295,705)
2024041703234	B	USDMXN	04/19/2024	2,000,000	16.99287	(33,985,740)
2024041703316	B	USDMXN	04/19/2024	1,000,000	16.9769	(16,976,900)
2024041703319	B	USDMXN	04/19/2024	1,000,000	16.97455	(16,974,550)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024041703647	B	USDMXN	04/19/2024	3,000,000	16.97	(50,910,000)
2024041703675	B	USDMXN	04/19/2024	325,000	16.95651	(5,510,866)
2024041703187	S	USDMXN	04/19/2024	(1,000,000)	16.9877	16,987,700
2024041703282	S	USDMXN	04/19/2024	(1,000,000)	17.01208	17,012,080
2024041703380	S	USDMXN	04/19/2024	(1,000,000)	16.9625	16,962,500
2024041703397	S	USDMXN	04/19/2024	(1,000,000)	16.96279	16,962,790
2024041703458	S	USDMXN	04/19/2024	(20,000,000)	16.94	338,800,000
2023101703083	B	USDMXN	04/19/2024	20,000,000	18.52	(370,400,000)
2023121503325	S	USDMXN	04/19/2024	(40,000,000)	17.544	701,760,000
2024031403073	B	USDMXN	04/19/2024	80,000,000	16.7795	(1,342,360,000)
2024040303207	S	USDMXN	04/19/2024	(50,000,000)	16.6145	830,725,000
2024041703157	B	USDMXN	04/19/2024	50,000,000	16.938	(846,900,000)
2024041703210	S	USDMXN	04/19/2024	(22,000,000)	16.9566	373,045,200
2024041703213	S	USDMXN	04/19/2024	(639,832)	17.0299	10,896,268
2024041803079	B	USDMXN	04/19/2024	117,322,696	17.047	(2,000,000,000)
2024041803114	B	USDMXN	04/19/2024	89,090,040	17.056	(1,519,519,727)
2024041803521	B	USDMXN	04/19/2024	58,661,348	17.047	(1,000,000,000)
2024041803526	B	USDMXN	04/19/2024	58,661,348	17.047	(1,000,000,000)
2024041803542	B	USDMXN	04/19/2024	117,322,696	17.047	(2,000,000,000)
2024041803294	S	USDMXN	04/19/2024	(100,000,000)	17.095	1,709,500,000
2024041803297	S	USDMXN	04/19/2024	(736,555)	17.07038	12,573,268
2024041803529	S	USDMXN	04/19/2024	(77,000,000)	17.13	1,319,010,000
2024041803166	B	EURUSD	04/22/2024	1,000,000	1.06643	(1,066,430)
2024041803213	B	EURUSD	04/22/2024	1,000,000	1.06579	(1,065,790)
2024041803472	B	EURUSD	04/22/2024	1,000,000	1.06471	(1,064,710)
2024041803475	B	EURUSD	04/22/2024	1,000,000	1.0646	(1,064,600)
2024041803483	B	EURUSD	04/22/2024	1,000,000	1.0646	(1,064,600)
2024041803113	S	EURUSD	04/22/2024	(1,000,000)	1.06588	1,065,880
2024041803126	S	EURUSD	04/22/2024	(1,000,000)	1.06599	1,065,990
2024041803644	S	EURUSD	04/22/2024	(1,000,000)	1.06426	1,064,260
2024041803645	S	EURUSD	04/22/2024	(2,000,000)	1.06428	2,128,560
2023101703454	B	USDMXN	04/22/2024	300,000	18.51316	(5,553,948)
2024012303638	B	USDMXN	04/22/2024	265,816	17.56898	(4,670,112)
2024040103583	BO	USDMXN	04/22/2024	53,000	16.70432	(885,329)
2024040103883	BO	USDMXN	04/22/2024	126,564	16.69149	(2,112,542)
2024040403713	SO	USDMXN	04/22/2024	(298,000)	16.60186	4,947,353
2024041103682	B	USDMXN	04/22/2024	50,000,000	16.4632	(823,160,000)
2024041703720	B	USDMXN	04/22/2024	40,000	16.97097	(678,839)
2024041803109	B	USDMXN	04/22/2024	1,000,000	17.05829	(17,058,290)
2024041803125	B	USDMXN	04/22/2024	1,000,000	17.05519	(17,055,190)
2024041803226	B	USDMXN	04/22/2024	1,000,000	17.12453	(17,124,530)
2024041803259	B	USDMXN	04/22/2024	1,000,000	17.10364	(17,103,640)
2024041803161	S	USDMXN	04/22/2024	(1,000,000)	17.0813	17,081,300
2024041803163	S	USDMXN	04/22/2024	(1,000,000)	17.08237	17,082,370
2024041803390	S	USDMXN	04/22/2024	(2,000,000)	17.135	34,270,000
2024041803639	S	USDMXN	04/22/2024	(1,000,000)	17.06558	17,065,580
2024041803646	S	USDMXN	04/22/2024	(2,452,950)	17.06275	41,854,073
2024041903071	S	USDMXN	04/22/2024	(70,000,000)	17.2765	1,209,355,000
2024041903077	S	USDMXN	04/22/2024	(100,000,000)	17.212	1,721,200,000
2024021503125	S	USDMXN	04/22/2024	(58,000,000)	17.239	999,862,000
2024021503756	S	USDMXN	04/22/2024	(58,000,000)	17.239	999,862,000
2024030703629	BO	USDMXN	04/22/2024	387,000	16.98947	(6,574,926)
2024041803280	B	USDMXN	04/22/2024	20,000,000	17.13	(342,600,000)
2024041803295	B	USDMXN	04/22/2024	100,000,000	17.1035	(1,710,350,000)
2024041803298	B	USDMXN	04/22/2024	736,555	17.0791	(12,579,693)
2024041803412	B	USDMXN	04/22/2024	30,000,000	17.125	(513,750,000)
2024041803432	B	USDMXN	04/22/2024	20,000,000	17.13	(342,600,000)
2024041803434	B	USDMXN	04/22/2024	15,000,000	17.1375	(257,062,500)
2024041803530	B	USDMXN	04/22/2024	77,000,000	17.13855	(1,319,668,350)
2024041803173	S	USDMXN	04/22/2024	(1,046,000)	17.12607	17,913,869
2024041803578	S	USDMXN	04/22/2024	(80,000,000)	17.095	1,367,600,000
2024041903166	S	USDMXN	04/22/2024	(20,000,000)	17.253	345,060,000
2024041903647	B	EURUSD	04/23/2024	1,000,000	1.06506	(1,065,060)
2024041903130	S	EURUSD	04/23/2024	(1,000,000)	1.0675	1,067,500
2023111403621	B	USDMXN	04/23/2024	100,000	17.84996	(1,784,996)
2023111603357	B	USDMXN	04/23/2024	100,000	17.71456	(1,771,456)
2024041803756	B	USDMXN	04/23/2024	41,000	17.0542	(699,222)
2024041903072	B	USDMXN	04/23/2024	70,000,000	17.27935	(1,209,554,500)
2024041903078	B	USDMXN	04/23/2024	100,000,000	17.2149	(1,721,490,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024041903129	B	USDMXN	04/23/2024	1,000,000	17.25954	(17,259,540)
2024041903138	B	USDMXN	04/23/2024	1,000,000	17.24128	(17,241,280)
2024041903183	B	USDMXN	04/23/2024	1,000,000	17.22823	(17,228,230)
2024041903702	B	USDMXN	04/23/2024	25,000	17.2302	(430,755)
2024041903188	S	USDMXN	04/23/2024	(50,000,000)	17.237	861,850,000
2024041903298	S	USDMXN	04/23/2024	(30,000,000)	17.208	516,240,000
2024041903338	S	USDMXN	04/23/2024	(30,000,000)	17.175	515,250,000
2024042303149	BO	USDMXN	04/23/2024	3,000,000	17.00738	(51,022,152)
2024041803579	B	USDMXN	04/23/2024	80,000,000	17.0977	(1,367,816,000)
2024041903167	B	USDMXN	04/23/2024	20,000,000	17.25585	(345,117,000)
2024041903064	S	USDMXN	04/23/2024	(60,000,000)	17.255	1,035,300,000
2024041903066	S	USDMXN	04/23/2024	(50,000,000)	17.24	862,000,000
2024041903088	S	USDMXN	04/23/2024	(50,000,000)	17.31	865,500,000
2024041903093	S	USDMXN	04/23/2024	(15,000,000)	17.285	259,275,000
2024041903359	S	USDMXN	04/23/2024	(50,000,000)	17.18	859,000,000
2024041903470	S	USDMXN	04/23/2024	(15,000,000)	17.155	257,325,000
2024041903500	S	USDMXN	04/23/2024	(30,000,000)	17.135	514,050,000
2024042203180	B	USDMXN	04/23/2024	335,565	17.12992	(5,748,209)
2024042203335	B	USDMXN	04/23/2024	87,000,000	17.14	(1,491,180,000)
2024042203496	B	USDMXN	04/23/2024	137,000,000	17.14	(2,348,180,000)
2024042203338	S	USDMXN	04/23/2024	(87,000,000)	17.14	1,491,180,000
2024042203085	B	EURUSD	04/24/2024	1,000,000	1.06464	(1,064,640)
2024042203490	B	EURUSD	04/24/2024	1,000,000	1.06535	(1,065,350)
2024042203079	S	EURUSD	04/24/2024	(1,000,000)	1.06414	1,064,140
2024042203431	S	EURUSD	04/24/2024	(1,000,000)	1.06592	1,065,920
2023071403663	BO	USDMXN	04/24/2024	250,000	17.62153	(4,405,384)
2023072003507	SO	USDMXN	04/24/2024	(32,294)	17.74547	573,081
2023072703097	BO	USDMXN	04/24/2024	450,000	17.61049	(7,924,722)
2023111503479	S	USDMXN	04/24/2024	(286,565)	17.80434	5,102,100
2023112103444	B	USDMXN	04/24/2024	500,000	17.68369	(8,841,846)
2023121403846	BO	USDMXN	04/24/2024	130,000	17.5492	(2,281,396)
2024010303528	BO	USDMXN	04/24/2024	80,000	17.36517	(1,389,211)
2024010803663	B	USDMXN	04/24/2024	300,000	17.10835	(5,132,504)
2024022703272	SO	USDMXN	04/24/2024	(674,340)	17.20858	11,604,434
2024031303489	BO	USDMXN	04/24/2024	47,150	16.79117	(791,703)
2024031303728	BO	USDMXN	04/24/2024	32,200	16.77347	(540,106)
2024032003412	BO	USDMXN	04/24/2024	90,000	16.77063	(1,509,357)
2024032603674	BO	USDMXN	04/24/2024	119,850	16.71976	(2,003,863)
2024032603395	SO	USDMXN	04/24/2024	(692,951)	16.73439	11,596,114
2024040203430	SO	USDMXN	04/24/2024	(698,543)	16.61252	11,604,561
2024040403714	BO	USDMXN	04/24/2024	94,800	16.64587	(1,578,028)
2024040903741	BO	USDMXN	04/24/2024	48,800	16.42628	(801,602)
2024041503630	S	USDMXN	04/24/2024	(30,000,000)	16.7388	502,164,000
2024042203078	B	USDMXN	04/24/2024	1,000,000	17.18198	(17,181,980)
2024042203092	B	USDMXN	04/24/2024	1,000,000	17.14302	(17,143,020)
2024042203241	B	USDMXN	04/24/2024	20,000,000	17.113	(342,260,000)
2024042203464	B	USDMXN	04/24/2024	3,000,000	17.135	(51,405,000)
2024042203475	B	USDMXN	04/24/2024	2,000,000	17.135	(34,270,000)
2024042203489	B	USDMXN	04/24/2024	1,000,000	17.13538	(17,135,380)
2024042203132	S	USDMXN	04/24/2024	(2,000,000)	17.12289	34,245,780
2024042203368	S	USDMXN	04/24/2024	(14,600,000)	17.123	249,995,800
2024042203430	S	USDMXN	04/24/2024	(1,000,000)	17.14647	17,146,470
2024042303233	BO	USDMXN	04/24/2024	3,000,000	17.00166	(51,004,988)
2024041503469	B	USDMXN	04/24/2024	100,000,000	16.7437	(1,674,370,000)
2024042203339	B	USDMXN	04/24/2024	87,000,000	17.14275	(1,491,419,250)
2024042203181	S	USDMXN	04/24/2024	(335,565)	17.1325	5,749,075
2024042203336	S	USDMXN	04/24/2024	(87,000,000)	17.14275	1,491,419,250
2024042203497	S	USDMXN	04/24/2024	(137,000,000)	17.14275	2,348,556,750
2024042303064	B	USDMXN	04/24/2024	928,524	16.98793	(15,773,698)
2024042303434	B	USDMXN	04/24/2024	67,000,000	16.976	(1,137,392,000)
2024042303180	B	EURUSD	04/25/2024	1,000,000	1.06994	(1,069,940)
2024042303272	S	EURUSD	04/25/2024	(1,000,000)	1.07017	1,070,170
2024010303415	BO	USDMXN	04/25/2024	30,528	17.36545	(530,133)
2024010303527	BO	USDMXN	04/25/2024	63,917	17.36583	(1,109,972)
2024010803451	BO	USDMXN	04/25/2024	50,000	17.09798	(854,899)
2024012303619	B	USDMXN	04/25/2024	30,000,000	17.61	(528,300,000)
2024012303644	S	USDMXN	04/25/2024	(50,000)	17.57784	878,892
2024032703957	BO	USDMXN	04/25/2024	20,000	16.62377	(332,475)
2024040903725	BO	USDMXN	04/25/2024	144,513	16.43019	(2,374,376)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024042303056	B	USDMXN	04/25/2024	1,000,000	17.01769	(17,017,690)
2024042303066	B	USDMXN	04/25/2024	1,000,000	16.98952	(16,989,520)
2024042303302	B	USDMXN	04/25/2024	4,000,000	16.985	(67,940,000)
2024042303404	B	USDMXN	04/25/2024	1,000,000	16.9812	(16,981,200)
2024042303057	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	16.9934	16,993,400
2024042303058	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	16.99089	16,990,890
2024042303179	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	16.99102	16,991,020
2024042303192	S	USDMXN	04/25/2024	(50,000,000)	16.9955	849,775,000
2024042303195	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	16.99784	16,997,840
2024042303254	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	17.001	17,001,000
2024042303257	S	USDMXN	04/25/2024	(1,521,159)	17.00377	25,865,438
2024042303264	S	USDMXN	04/25/2024	(1,000,000)	17.01	17,010,000
2024042303576	S	USDMXN	04/25/2024	(2,000,000)	16.96756	33,935,120
2024042303577	S	USDMXN	04/25/2024	(2,000,000)	16.96533	33,930,660
2024042303649	S	USDMXN	04/25/2024	(58,389)	16.96576	990,617
2024042303668	S	USDMXN	04/25/2024	(20,000,000)	16.965	339,300,000
2023122203329	BO	USDMXN	04/25/2024	5,700,000	17.33	(98,781,006)
2024042303067	B	USDMXN	04/25/2024	94,000	16.9869	(1,596,769)
2024042303151	B	USDMXN	04/25/2024	30,000,000	16.98	(509,400,000)
2024042303453	B	USDMXN	04/25/2024	20,000,000	16.985	(339,700,000)
2024042303456	B	USDMXN	04/25/2024	10,000,000	16.985	(169,850,000)
2024042303612	B	USDMXN	04/25/2024	50,000,000	16.965	(848,250,000)
2024042303614	B	USDMXN	04/25/2024	100,000,000	16.965	(1,696,500,000)
2024042303004	S	USDMXN	04/25/2024	(30,000,000)	17.13	513,900,000
2024042303065	S	USDMXN	04/25/2024	(928,524)	16.9906	15,776,178
2024042303435	S	USDMXN	04/25/2024	(67,000,000)	16.97868	1,137,571,225
2024042403062	S	USDMXN	04/25/2024	(760,013)	17.0522	12,959,898
2024042403084	S	USDMXN	04/25/2024	(23,000,000)	17.06	392,380,000
2023042703261	B	EURMXN	04/26/2024	770,000	21.66972	(16,685,683)
2023042703681	S	EURMXN	04/26/2024	(770,000)	21.61881	16,646,482
2024042403118	B	EURUSD	04/26/2024	1,000,000	1.06889	(1,068,890)
2024042403119	B	EURUSD	04/26/2024	1,000,000	1.06888	(1,068,880)
2024042403164	S	EURUSD	04/26/2024	(1,000,000)	1.06847	1,068,470
2024042403604	S	EURUSD	04/26/2024	(1,000,000)	1.07057	1,070,570
2023031003683	SO	USDMXN	04/26/2024	(39,000)	19.88159	775,382
2023090703391	SO	USDMXN	04/26/2024	(39,000)	18.25581	711,977
2023111603389	B	USDMXN	04/26/2024	250,000	17.72185	(4,430,464)
2024011103435	BO	USDMXN	04/26/2024	63,017	17.25927	(1,087,627)
2024011703451	BO	USDMXN	04/26/2024	141,000	17.56667	(2,476,900)
2024020903507	S	USDMXN	04/26/2024	(295,087)	17.29413	5,103,273
2024022203663	B	USDMXN	04/26/2024	20,000,000	17.2868	(345,736,000)
2024022703801	BO	USDMXN	04/26/2024	100,000	17.21975	(1,721,975)
2024032703958	BO	USDMXN	04/26/2024	36,500	16.62634	(606,862)
2024040303631	BO	USDMXN	04/26/2024	100,000	16.60205	(1,660,205)
2024040403564	BO	USDMXN	04/26/2024	5,000,000	16.61366	(83,068,322)
2024041003439	B	USDMXN	04/26/2024	20,000,000	16.47229	(329,445,720)
2024041203392	SO	USDMXN	04/26/2024	(316,000)	16.58293	5,240,205
2024041603368	S	USDMXN	04/26/2024	(50,000,000)	17.0466	852,330,000
2024042303759	B	USDMXN	04/26/2024	30,000	16.9621	(508,863)
2024042403047	B	USDMXN	04/26/2024	1,000,000	17.06055	(17,060,550)
2024042403254	B	USDMXN	04/26/2024	2,000,000	17.12325	(34,246,500)
2024042403300	B	USDMXN	04/26/2024	2,000,000	17.13052	(34,261,040)
2024042403528	B	USDMXN	04/26/2024	90,000,000	17.06	(1,535,400,000)
2024042403639	B	USDMXN	04/26/2024	613,800	17.07639	(10,481,488)
2024042403056	S	USDMXN	04/26/2024	(1,000,000)	17.04805	17,048,050
2024042403242	S	USDMXN	04/26/2024	(1,000,000)	17.10439	17,104,390
2024042403335	S	USDMXN	04/26/2024	(1,000,000)	17.10372	17,103,720
2024042403340	S	USDMXN	04/26/2024	(1,000,000)	17.09198	17,091,980
2024042403355	S	USDMXN	04/26/2024	(1,000,000)	17.08628	17,086,280
2024042403596	S	USDMXN	04/26/2024	(555,421)	17.0433	9,466,207
2024042403630	S	USDMXN	04/26/2024	(500,000)	17.07086	8,535,430
2024042603098	S	USDMXN	04/26/2024	(7,400,000)	17.16	126,984,000
2024042503658	BO	CADMXN	04/26/2024	8,000,000	12.58932	(100,714,570)
2024041003360	S	USDMXN	04/26/2024	(50,000,000)	16.5092	825,460,000
2024041703158	S	USDMXN	04/26/2024	(50,000,000)	16.9564	847,820,000
2024042403063	B	USDMXN	04/26/2024	760,013	17.055	(12,962,025)
2024042403085	B	USDMXN	04/26/2024	23,000,000	17.06268	(392,441,525)
2024042403071	S	USDMXN	04/26/2024	(100,000,000)	17.053	1,705,300,000
2024042403270	S	USDMXN	04/26/2024	(10,000,000)	17.085	170,850,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024042403403	S	USDMXN	04/26/2024	(50,000,000)	17.067	853,350,000
2024042503068	B	USDMXN	04/26/2024	18,976	17.23119	(326,974)
2024042503319	B	USDMXN	04/26/2024	105,000,000	17.195	(1,805,475,000)
2023081003155	BO	USDMXN	04/29/2024	500,000	17.75185	(8,875,925)
2023101103312	SO	USDMXN	04/29/2024	(97,455)	18.47909	1,800,880
2023101703215	B	USDMXN	04/29/2024	290,557	18.53792	(5,386,321)
2023101803244	SO	USDMXN	04/29/2024	(95,349)	18.87816	1,800,013
2023102703335	SO	USDMXN	04/29/2024	(96,675)	18.62772	1,800,835
2023110303227	BO	USDMXN	04/29/2024	620,000	17.92235	(11,111,855)
2023110303941	SO	USDMXN	04/29/2024	(19,166)	17.98391	344,686
2023110703547	SO	USDMXN	04/29/2024	(99,767)	17.96519	1,792,333
2023111403370	S	USDMXN	04/29/2024	(100,503)	17.91077	1,800,087
2023112103393	S	USDMXN	04/29/2024	(102,070)	17.69575	1,806,206
2023121503639	BO	USDMXN	04/29/2024	5,602	17.6038	(98,622)
2024012203383	BON	USDMXN	04/29/2024	1,000,000,000	17.431	(17,431,000,000)
2024012203386	BON	USDMXN	04/29/2024	100,000,000	17.431	(1,743,100,000)
2024012203388	BON	USDMXN	04/29/2024	100,000,000	17.431	(1,743,100,000)
2024012203339	SON	USDMXN	04/29/2024	(200,000,000)	17.4305	3,486,100,000
2024012203695	SON	USDMXN	04/29/2024	(200,000,000)	17.4305	3,486,100,000
2024020803391	SO	USDMXN	04/29/2024	(115,280)	17.35051	2,000,167
2024022803294	SO	USDMXN	04/29/2024	(115,882)	17.26583	2,000,799
2024031103505	BON	USDMXN	04/29/2024	200,000,000	16.9246	(3,384,920,000)
2024031103496	SON	USDMXN	04/29/2024	(100,000,000)	16.928	1,692,800,000
2024031103497	SON	USDMXN	04/29/2024	(100,000,000)	16.928	1,692,800,000
2024040303634	BO	USDMXN	04/29/2024	41,500	16.60867	(689,260)
2024040403146	S	USDMXN	04/29/2024	(100,000,000)	16.5887	1,658,870,000
2024041103120	B	USDMXN	04/29/2024	50,000,000	16.5138	(825,690,000)
2024041203394	SO	USDMXN	04/29/2024	(470,000)	16.6195	7,811,163
2024042403745	B	USDMXN	04/29/2024	150,000	17.08914	(2,563,371)
2024042503100	B	USDMXN	04/29/2024	2,000,000	17.23622	(34,472,440)
2024042503103	BO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	(17,050,000)
2024042503104	BO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	(17,050,000)
2024042503105	BON	USDMXN	04/29/2024	200,000,000	17.4305	(3,486,100,000)
2024042503106	BON	USDMXN	04/29/2024	100,000,000	16.928	(1,692,800,000)
2024042503108	BO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	(33,250,000)
2024042503109	BON	USDMXN	04/29/2024	100,000,000	16.928	(1,692,800,000)
2024042503110	BO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	(33,250,000)
2024042503170	B	USDMXN	04/29/2024	2,000,000	17.23953	(34,479,060)
2024042503647	B	USDMXN	04/29/2024	258,000	17.19007	(4,435,038)
2024042503074	S	USDMXN	04/29/2024	(2,000,000)	17.25875	34,517,500
2024042503101	SON	USDMXN	04/29/2024	(100,000,000)	17.431	1,743,100,000
2024042503102	SON	USDMXN	04/29/2024	(100,000,000)	17.431	1,743,100,000
2024042503107	SO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	34,000,000
2024042503111	SON	USDMXN	04/29/2024	(200,000,000)	16.9246	3,384,920,000
2024042503112	SO	USDMXN	04/29/2024	0	17.2605	67,180,000
2024042503484	S	USDMXN	04/29/2024	(1,000,000)	17.17955	17,179,550
2024042503485	S	USDMXN	04/29/2024	(1,000,000)	17.18141	17,181,410
2024042603099	B	USDMXN	04/29/2024	7,400,000	17.1677	(127,040,980)
2023102503131	S	USDMXN	04/29/2024	(10,000,000)	18.888	188,880,000
2024042503069	S	USDMXN	04/29/2024	(18,976)	17.2392	327,126
2024042503320	S	USDMXN	04/29/2024	(105,000,000)	17.20295	1,806,309,750
2024042603082	B	USDMXN	04/29/2024	799,457	17.13974	(13,702,489)
2024042603203	B	USDMXN	04/29/2024	206,000,000	17.17	(3,537,020,000)
2024042903064	B	USDMXN	04/29/2024	87,700,000	17.095	(1,499,231,500)
2024042903066	S	USDMXN	04/29/2024	(87,700,000)	17.095	1,499,231,500
2024042603145	B	EURUSD	04/30/2024	1,000,000	1.06811	(1,068,110)
2024042603147	B	EURUSD	04/30/2024	1,000,000	1.06817	(1,068,170)
2024042603481	B	EURUSD	04/30/2024	2,000,000	1.06984	(2,139,680)
2024042603169	S	EURUSD	04/30/2024	(1,000,000)	1.06744	1,067,440
2024042603184	S	EURUSD	04/30/2024	(1,000,000)	1.0675	1,067,500
2024042603312	S	EURUSD	04/30/2024	(2,000,000)	1.06958	2,139,160
2022110103593	B	USDMXN	04/30/2024	4,230,000	21.70431	(91,809,244)
2023031003631	SO	USDMXN	04/30/2024	(125,000)	19.95436	2,494,295
2023031403149	SO	USDMXN	04/30/2024	(125,000)	20.62709	2,578,387
2023070303476	B	USDMXN	04/30/2024	192,800	18.00133	(3,470,656)
2023091303518	B	USDMXN	04/30/2024	48,400	17.84253	(863,578)
2023110603395	B	USDMXN	04/30/2024	250,000	18.05096	(4,512,741)
2023112903801	B	USDMXN	04/30/2024	241,400	17.69533	(4,271,652)
2024012903238	S	USDMXN	04/30/2024	(30,000,000)	17.4765	524,295,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024012903423	S	USDMXN	04/30/2024	(30,000,000)	17.5077	525,231,000
2024040203703	BO	USDMXN	04/30/2024	66,524	16.63561	(1,106,667)
2024041603761	SO	USDMXN	04/30/2024	(500,000)	17.0857	8,542,852
2024041903189	B	USDMXN	04/30/2024	50,000,000	17.257	(862,850,000)
2024042603210	B	USDMXN	04/30/2024	2,000,000	17.16	(34,320,000)
2024042603219	B	USDMXN	04/30/2024	1,000,000	17.15221	(17,152,210)
2024042603229	B	USDMXN	04/30/2024	1,000,000	17.15219	(17,152,190)
2024042603239	B	USDMXN	04/30/2024	1,000,000	17.14815	(17,148,150)
2024042603575	B	USDMXN	04/30/2024	600,000	17.1442	(10,286,520)
2024042603576	B	USDMXN	04/30/2024	200,000	17.14351	(3,428,702)
2024042603133	S	USDMXN	04/30/2024	(3,000,000)	17.18	51,540,000
2024042603146	S	USDMXN	04/30/2024	(1,000,000)	17.1899	17,189,900
2024042603170	S	USDMXN	04/30/2024	(1,000,000)	17.19627	17,196,270
2024042603555	S	USDMXN	04/30/2024	(3,000,000)	17.14275	51,428,250
2024043003212	B	USDMXN	04/30/2024	41,417,000	17.07	(706,988,190)
2024043003208	S	USDMXN	04/30/2024	(41,417,000)	17.07	706,988,190
2024012603156	B	USDMXN	04/30/2024	30,000,000	17.444	(523,320,000)
2024012603160	B	USDMXN	04/30/2024	30,000,000	17.441	(523,230,000)
2024012903242	S	USDMXN	04/30/2024	(30,000,000)	17.4765	524,295,000
2024042603083	S	USDMXN	04/30/2024	(799,457)	17.1423	13,704,535
2024042603204	S	USDMXN	04/30/2024	(206,000,000)	17.17278	3,537,591,650
2024042903067	B	USDMXN	04/30/2024	87,700,000	17.0977	(1,499,468,290)
2024042903072	B	USDMXN	04/30/2024	447,817	17.07277	(7,645,473)
2024042903097	B	USDMXN	04/30/2024	70,250,000	17.08	(1,199,870,000)
2024042903137	B	USDMXN	04/30/2024	58,580,000	17.07	(999,960,600)
2024042903139	B	USDMXN	04/30/2024	38,170,000	17.07	(651,561,900)
2024042903065	S	USDMXN	04/30/2024	(87,700,000)	17.0977	1,499,468,290
2024020803098	B	USDMXN	05/13/2024	15,000,000	17.33587	(260,038,110)
2024020803734	S	USDMXN	05/13/2024	(30,000,000)	17.415	522,450,000
2024030803871	SO	USDMXN	05/13/2024	(19,765,250)	16.981	335,633,710
2024040903712	BO	USDMXN	05/13/2024	50,000	16.47957	(823,979)
2024041003151	B	USDMXN	05/13/2024	50,000,000	16.5665	(828,325,000)
2024050903535	B	USDMXN	05/13/2024	147,150	16.81325	(2,474,070)
2024050903659	B	USDMXN	05/13/2024	69,121	16.7814	(1,159,947)
2024050903463	S	USDMXN	05/13/2024	(1,739,295)	16.87117	29,343,942
2024050903633	S	USDMXN	05/13/2024	(1,006,333)	16.78691	16,893,222
2024051303236	BO	USDMXN	05/13/2024	3,000,000	16.8048	(50,414,409)
2024011003402	B	USDMXN	05/13/2024	30,000,000	17.338	(520,140,000)
2024040903383	S	USDMXN	05/13/2024	(100,000,000)	16.4851	1,648,510,000
2024040903554	S	USDMXN	05/13/2024	(50,000,000)	16.48	824,000,000
2024041003361	B	USDMXN	05/13/2024	50,000,000	16.5546	(827,730,000)
2024041003491	B	USDMXN	05/13/2024	50,000,000	16.5285	(826,425,000)
2024050903034	B	USDMXN	05/13/2024	30,000,000	16.926	(507,780,000)
2024050903246	B	USDMXN	05/13/2024	479,000	16.88205	(8,086,502)
2024050903567	B	USDMXN	05/13/2024	15,000,000	16.8	(252,000,000)
2024050903007	S	USDMXN	05/13/2024	(201,223)	16.9202	3,404,729
2024050903031	S	USDMXN	05/13/2024	(70,000,000)	16.9379	1,185,653,000
2024050903160	S	USDMXN	05/13/2024	(857,467)	16.8777	14,472,072
2024050903358	S	USDMXN	05/13/2024	(73,000,000)	16.86985	1,231,499,050
2024051003020	B	USDMXN	05/13/2024	149,120,000	16.77285	(2,501,167,392)
2024051003099	B	USDMXN	05/13/2024	922,021	16.74861	(15,442,558)
2024051003494	B	USDMXN	05/13/2024	100,000,000	16.78	(1,678,000,000)
2024051003499	B	USDMXN	05/13/2024	5,705,944	16.77635	(95,724,902)
2024051003018	S	USDMXN	05/13/2024	(149,120,000)	16.77285	2,501,167,392
2023111503577	BO	EURMXN	05/14/2024	290,000	19.51659	(5,659,812)
2023111403381	S	USDMXN	05/14/2024	(144,871)	17.94752	2,600,076
2023112103391	S	USDMXN	05/14/2024	(147,026)	17.73439	2,607,416
2023112803303	S	USDMXN	05/14/2024	(147,828)	17.6084	2,603,014
2023120503346	SO	USDMXN	05/14/2024	(145,406)	17.83534	2,593,366
2024020803400	SO	USDMXN	05/14/2024	(218,466)	17.39593	3,800,419
2024021203182	B	USDMXN	05/14/2024	20,000,000	17.3065	(346,130,000)
2024022803295	SO	USDMXN	05/14/2024	(219,666)	17.30396	3,801,092
2024050803519	SO	USDMXN	05/14/2024	(2,000,000)	16.9025	33,804,994
2024051003632	B	USDMXN	05/14/2024	38,020	16.78711	(638,246)
2024051003692	S	USDMXN	05/14/2024	(285,000)	16.78267	4,783,061
2024031203525	B	USDMXN	05/14/2024	118,000,000	16.9695	(2,002,401,000)
2024031203630	S	USDMXN	05/14/2024	(30,000,000)	16.978	509,340,000
2024051003063	B	USDMXN	05/14/2024	10,000,000	16.7404	(167,404,000)
2024051003560	B	USDMXN	05/14/2024	15,000,000	16.785	(251,775,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024051003100	S	USDMXN	05/14/2024	(922,021)	16.7509	15,444,674
2024051003495	S	USDMXN	05/14/2024	(100,000,000)	16.7826	1,678,260,000
2024051003500	S	USDMXN	05/14/2024	(5,705,944)	16.7789	95,739,469
2024051303291	S	USDMXN	05/14/2024	(795,470)	16.81983	13,379,669
2024051303421	S	USDMXN	05/14/2024	(34,000,000)	16.808	571,472,000
2024020803251	B	EURMXN	05/15/2024	125,000	18.77912	(2,347,390)
2024051303577	B	EURMXN	05/15/2024	431,865	18.14119	(7,834,545)
2023031003633	SO	USDMXN	05/15/2024	(175,000)	20.00216	3,500,377
2023031403150	SO	USDMXN	05/15/2024	(175,000)	20.67641	3,618,371
2023061403061	BO	USDMXN	05/15/2024	800,000	18.24659	(14,597,270)
2023090603293	S	USDMXN	05/15/2024	(208,333)	18.38129	3,829,435
2023090803326	SO	USDMXN	05/15/2024	(125,000)	18.37445	2,296,806
2023091403452	B	USDMXN	05/15/2024	402,758	17.82056	(7,177,372)
2023092603222	SO	USDMXN	05/15/2024	(166,667)	18.20747	3,034,578
2023100303497	SO	USDMXN	05/15/2024	(166,667)	18.60653	3,101,089
2023101203191	B	USDMXN	05/15/2024	1,652,217	18.57698	(30,693,196)
2023101703652	S	USDMXN	05/15/2024	(833,333)	18.65061	15,542,175
2023110603397	B	USDMXN	05/15/2024	350,000	18.10189	(6,335,663)
2023112103163	BO	USDMXN	05/15/2024	34,000	17.69085	(601,489)
2023121403845	BO	USDMXN	05/15/2024	110,000	17.6088	(1,936,968)
2023121803653	BO	USDMXN	05/15/2024	554,388	17.59121	(9,752,353)
2023121903364	B	USDMXN	05/15/2024	2,039,663	17.50328	(35,700,795)
2023121903607	B	USDMXN	05/15/2024	1,808,757	17.49887	(31,651,207)
2024010303531	BO	USDMXN	05/15/2024	50,000	17.42639	(871,319)
2024010503484	BO	USDMXN	05/15/2024	100,000	17.27749	(1,727,749)
2024011203652	B	USDMXN	05/15/2024	66,859	17.1939	(1,149,567)
2024011703872	B	USDMXN	05/15/2024	4,668	17.55775	(81,960)
2024012303352	B	USDMXN	05/15/2024	238,607	17.69913	(4,223,144)
2024020803365	BON	USDMXN	05/15/2024	100,000,000	17.391	(1,739,100,000)
2024020803353	SON	USDMXN	05/15/2024	(100,000,000)	17.3918	1,739,180,000
2024032503814	BO	USDMXN	05/15/2024	49,200	16.81528	(827,312)
2024040503598	BO	USDMXN	05/15/2024	45,550	16.57295	(754,898)
2024041103746	BO	USDMXN	05/15/2024	53,200	16.51866	(878,793)
2024042903642	BO	USDMXN	05/15/2024	68,800	17.0645	(1,174,037)
2024051303177	BON	USDMXN	05/15/2024	100,000,000	17.3918	(1,739,180,000)
2024051303180	BO	USDMXN	05/15/2024	0	16.7955	(59,550,000)
2024051303576	B	USDMXN	05/15/2024	1,076,000	16.81377	(18,091,617)
2024051303179	SO	USDMXN	05/15/2024	0	16.7955	59,630,000
2024051303178	SON	USDMXN	05/15/2024	(100,000,000)	17.391	1,739,100,000
2023111303273	B	USDMXN	05/15/2024	30,000,000	18.194	(545,820,000)
2024041103219	S	USDMXN	05/15/2024	(50,000,000)	16.565	828,250,000
2024041103696	S	USDMXN	05/15/2024	(50,000,000)	16.5243	826,215,000
2024041103700	S	USDMXN	05/15/2024	(50,000,000)	16.5243	826,215,000
2024042303050	BO	USDMXN	05/15/2024	29,277,433	17.078	(500,000,000)
2024050203247	BO	USDMXN	05/15/2024	20,400	16.95109	(345,802)
2024050203249	BO	USDMXN	05/15/2024	20,400	16.95109	(345,802)
2024050203692	BO	USDMXN	05/15/2024	20,400	16.99092	(346,615)
2024050203695	BO	USDMXN	05/15/2024	20,400	16.99092	(346,615)
2024050603262	BO	USDMXN	05/15/2024	38,000	16.9083	(642,516)
2024050603338	BO	USDMXN	05/15/2024	38,000	16.9083	(642,516)
2024051303201	B	USDMXN	05/15/2024	35,000,000	16.813	(588,455,000)
2024051303292	B	USDMXN	05/15/2024	795,470	16.8227	(13,381,955)
2024051303398	B	USDMXN	05/15/2024	763,000	16.80661	(12,823,443)
2024051303422	B	USDMXN	05/15/2024	34,000,000	16.8107	(571,563,800)
2024051303515	B	USDMXN	05/15/2024	75,000,000	16.805	(1,260,375,000)
2024051403186	S	USDMXN	05/15/2024	(689,282)	16.8412	11,608,341
2024051403400	S	USDMXN	05/15/2024	(24,000,000)	16.85	404,400,000
2024010303418	BO	USDMXN	05/16/2024	24,206	17.42738	(421,847)
2024010303530	BO	USDMXN	05/16/2024	55,474	17.42912	(966,863)
2024010803454	BO	USDMXN	05/16/2024	50,000	17.15889	(857,945)
2024011703508	SO	USDMXN	05/16/2024	(100,000)	17.61634	1,761,634
2024051403537	B	USDMXN	05/16/2024	34,548	16.84459	(581,947)
2024051403581	B	USDMXN	05/16/2024	999,156	16.84437	(16,830,151)
2024051403048	B	USDMXN	05/16/2024	10,000,000	16.875	(168,750,000)
2024051403187	B	USDMXN	05/16/2024	689,282	16.844	(11,610,269)
2024051403401	B	USDMXN	05/16/2024	24,000,000	16.8527	(404,464,800)
2024051503427	S	USDMXN	05/16/2024	(842,468)	16.65537	14,031,617
2024051503432	S	USDMXN	05/16/2024	(32,000,000)	16.652	532,864,000
2024051603008	B	USDMXN	05/16/2024	65,700,000	16.72	(1,098,504,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024051603006	S	USDMXN	05/16/2024	(65,700,000)	16.72	1,098,504,000
2023031003680	SO	USDMXN	05/17/2024	(31,200)	19.94789	622,374
2023090703394	SO	USDMXN	05/17/2024	(31,200)	18.32421	571,715
2023110103281	BO	USDMXN	05/17/2024	590,000	18.52708	(10,930,977)
2024011103441	BO	USDMXN	05/17/2024	63,017	17.32046	(1,091,483)
2024040203676	BO	USDMXN	05/17/2024	1,000,000	16.6828	(16,682,801)
2024040203691	BO	USDMXN	05/17/2024	1,000,000	16.68276	(16,682,763)
2024043003077	S	USDMXN	05/17/2024	(7,000,000)	17.07858	119,550,053
2024051403754	B	USDMXN	05/17/2024	43,000	16.84142	(724,181)
2024051503273	B	USDMXN	05/17/2024	20,400	16.69235	(340,524)
2024051503280	B	USDMXN	05/17/2024	39,207	16.69252	(654,464)
2024051503754	B	USDMXN	05/17/2024	91,950	16.68098	(1,533,816)
2024051603736	S	USDMXN	05/17/2024	(20,000,000)	16.67234	333,446,880
2023111503663	S	USDMXN	05/17/2024	(20,000,000)	17.848	356,960,000
2024032103521	SO	USDMXN	05/17/2024	(1,241,880)	16.9089	20,998,830
2024041503508	B	USDMXN	05/17/2024	50,000,000	16.7988	(839,940,000)
2024041503516	B	USDMXN	05/17/2024	50,000,000	16.7988	(839,940,000)
2024043003382	S	USDMXN	05/17/2024	(50,000,000)	17.1512	857,560,000
2024051503428	B	USDMXN	05/17/2024	842,468	16.6582	(14,034,005)
2024051503433	B	USDMXN	05/17/2024	32,000,000	16.6547	(532,950,400)
2024051503567	B	USDMXN	05/17/2024	20,000,000	16.694	(333,880,000)
2024051603007	B	USDMXN	05/17/2024	65,700,000	16.72265	(1,098,678,105)
2024051603009	S	USDMXN	05/17/2024	(65,700,000)	16.72265	1,098,678,105
2024051603014	S	USDMXN	05/17/2024	(880,445)	16.72803	14,728,110
2024051603067	S	USDMXN	05/17/2024	(89,000,000)	16.695	1,485,855,000
2024051703314	B	USDMXN	05/17/2024	90,000,000	16.66	(1,499,400,000)
2024051703317	S	USDMXN	05/17/2024	(90,000,000)	16.66	1,499,400,000
2024051703766	S	USDMXN	05/17/2024	(15,000,000)	16.6	249,000,000
2024051703178	BO	EURUSD	05/20/2024	10,000,000	1.08665	(10,866,480)
2024030803604	BO	USDMXN	05/20/2024	391,700	16.99664	(6,657,584)
2024041503727	BO	USDMXN	05/20/2024	325,000	16.81779	(5,465,782)
2024043003813	SO	USDMXN	05/20/2024	(307,000)	17.16667	5,270,167
2024051503059	B	USDMXN	05/20/2024	50,000,000	16.8	(840,000,000)
2024051503068	BON	USDMXN	05/20/2024	50,000,000	16.8	(840,000,000)
2024051503295	BON	USDMXN	05/20/2024	50,000,000	16.8	(840,000,000)
2024051503055	S	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024051503062	S	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024051503070	SON	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024051503297	SON	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024051603013	B	USDMXN	05/20/2024	1,114,700	16.73736	(18,657,135)
2024051603124	BO	USDMXN	05/20/2024	0	16.693	(5,350,000)
2024051603123	BON	USDMXN	05/20/2024	50,000,000	16.8	(840,000,000)
2024051603238	B	USDMXN	05/20/2024	133,200	16.69678	(2,224,011)
2024051603544	B	USDMXN	05/20/2024	1,612,000	16.66823	(26,869,187)
2024051603666	B	USDMXN	05/20/2024	269,000	16.6749	(4,485,548)
2024051603737	B	USDMXN	05/20/2024	20,000,000	16.6807	(333,614,000)
2024051603122	SON	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024051603125	SO	USDMXN	05/20/2024	0	16.693	5,350,000
2024051603786	S	USDMXN	05/20/2024	(901,000)	16.68188	15,030,374
2023121503134	B	USDMXN	05/20/2024	15,000,000	17.652	(264,780,000)
2024041603278	B	USDMXN	05/20/2024	80,000,000	17.13	(1,370,400,000)
2024050203039	S	USDMXN	05/20/2024	(50,000,000)	16.978	848,900,000
2024051603015	B	USDMXN	05/20/2024	880,445	16.7362	(14,735,308)
2024051603068	B	USDMXN	05/20/2024	89,000,000	16.70305	(1,486,571,450)
2024051703104	B	USDMXN	05/20/2024	60,067,275	16.648	(1,000,000,000)
2024051703106	B	USDMXN	05/20/2024	77,518,241	16.61	(1,287,577,975)
2024051703108	B	USDMXN	05/20/2024	11,238,506	16.61	(186,671,589)
2024051703318	B	USDMXN	05/20/2024	90,000,000	16.6678	(1,500,102,000)
2024051703767	B	USDMXN	05/20/2024	15,000,000	16.6086	(249,129,000)
2024051703315	S	USDMXN	05/20/2024	(90,000,000)	16.6678	1,500,102,000
2024051703508	S	USDMXN	05/20/2024	(287,795)	16.60847	4,779,842
2024051703593	S	USDMXN	05/20/2024	(120,000,000)	16.615	1,993,800,000
2024051703691	S	USDMXN	05/20/2024	(172,904)	16.60505	2,871,078
2024051703722	S	USDMXN	05/20/2024	(100,000,000)	16.61	1,661,000,000
2024051703754	S	USDMXN	05/20/2024	(138,000,000)	16.605	2,291,490,000
2024052003290	B	USDMXN	05/20/2024	93,600,000	16.55	(1,549,080,000)
2024052003292	S	USDMXN	05/20/2024	(93,600,000)	16.55	1,549,080,000
2024031503754	B	USDMXN	05/21/2024	500,000	16.86969	(8,434,845)
2024032603662	BO	USDMXN	05/21/2024	2,500,000	16.79285	(41,982,128)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024051603847	B	USDMXN	05/21/2024	128,000	16.69272	(2,136,668)
2024051703695	B	USDMXN	05/21/2024	800,000	16.60939	(13,287,512)
2023121903219	S	USDMXN	05/21/2024	(15,000,000)	17.508	262,620,000
2024051703509	B	USDMXN	05/21/2024	287,795	16.6112	(4,780,628)
2024051703594	B	USDMXN	05/21/2024	120,000,000	16.6177	(1,994,124,000)
2024051703692	B	USDMXN	05/21/2024	172,904	16.6078	(2,871,554)
2024051703723	B	USDMXN	05/21/2024	100,000,000	16.6127	(1,661,270,000)
2024051703755	B	USDMXN	05/21/2024	138,000,000	16.6078	(2,291,876,400)
2024051703486	S	USDMXN	05/21/2024	(739,000)	16.60638	12,272,115
2024051703491	S	USDMXN	05/21/2024	(100,000,000)	16.62	1,662,000,000
2024051703577	S	USDMXN	05/21/2024	(20,000,000)	16.615	332,300,000
2024052003293	B	USDMXN	05/21/2024	93,600,000	16.55275	(1,549,337,400)
2024052003070	S	USDMXN	05/21/2024	(924,780)	16.58219	15,334,865
2024052003112	S	USDMXN	05/21/2024	(189,000,000)	16.585	3,134,565,000
2024052003291	S	USDMXN	05/21/2024	(93,600,000)	16.55275	1,549,337,400
2024052103371	B	USDMXN	05/21/2024	30,000,000	16.664	(499,920,000)
2024052103511	B	USDMXN	05/21/2024	30,000,000	16.659	(499,770,000)
2023101003367	S	USDMXN	05/22/2024	(268,341)	18.66998	5,009,923
2023101703456	B	USDMXN	05/22/2024	300,000	18.61087	(5,583,260)
2023101703317	SO	USDMXN	05/22/2024	(269,426)	18.57068	5,003,424
2023112903416	SO	USDMXN	05/22/2024	(282,400)	17.70486	4,999,853
2024021303264	SO	USDMXN	05/22/2024	(664,071)	17.48285	11,609,852
2024022703273	SO	USDMXN	05/22/2024	(671,413)	17.28216	11,603,467
2024032603397	SO	USDMXN	05/22/2024	(690,024)	16.80819	11,598,056
2024040203441	SO	USDMXN	05/22/2024	(685,235)	16.68982	11,436,447
2024041903642	BO	USDMXN	05/22/2024	98,350	17.21848	(1,693,438)
2024052003117	B	USDMXN	05/22/2024	83,304	16.58969	(1,381,988)
2024052003118	B	USDMXN	05/22/2024	128,000	16.5892	(2,123,418)
2024052003494	B	USDMXN	05/22/2024	44,350	16.56432	(734,628)
2024052003719	B	USDMXN	05/22/2024	2,500,000	16.56372	(41,409,300)
2024052103173	S	USDMXN	05/22/2024	(150,000,000)	16.58	2,487,000,000
2024052103175	S	USDMXN	05/22/2024	(50,000,000)	16.58	829,000,000
2023122003428	B	USDMXN	05/22/2024	15,000,000	17.4955	(262,432,500)
2024022003735	S	USDMXN	05/22/2024	(30,000,000)	17.321	519,630,000
2024050603334	BO	USDMXN	05/22/2024	33,276	16.91967	(563,019)
2024050603343	BO	USDMXN	05/22/2024	33,276	16.91967	(563,019)
2024050703107	BO	USDMXN	05/22/2024	37,312	16.93377	(631,833)
2024050703109	BO	USDMXN	05/22/2024	37,312	16.93377	(631,833)
2024052003071	B	USDMXN	05/22/2024	924,780	16.585	(15,337,469)
2024052003113	B	USDMXN	05/22/2024	189,000,000	16.58775	(3,135,084,750)
2024052103029	B	USDMXN	05/22/2024	45,639,953	16.55605	(755,617,349)
2024052103222	S	USDMXN	05/22/2024	(15,000,000)	16.59	248,850,000
2024052103226	S	USDMXN	05/22/2024	(15,000,000)	16.607	249,105,000
2024052103372	S	USDMXN	05/22/2024	(30,000,000)	16.66665	499,999,500
2024052103512	S	USDMXN	05/22/2024	(30,000,000)	16.66165	499,849,500
2023033103644	B	USDMXN	05/23/2024	4,450,000	19.5158	(86,845,310)
2024010303419	BO	USDMXN	05/23/2024	24,206	17.4482	(422,351)
2024010303532	BO	USDMXN	05/23/2024	55,474	17.44982	(968,011)
2024010803455	BO	USDMXN	05/23/2024	50,000	17.17912	(858,956)
2024012303646	S	USDMXN	05/23/2024	(50,000)	17.6589	882,945
2024022103538	B	USDMXN	05/23/2024	30,000,000	17.309	(519,270,000)
2024041903339	B	USDMXN	05/23/2024	30,000,000	17.2605	(517,815,000)
2024052003810	B	USDMXN	05/23/2024	300,000	16.56826	(4,970,478)
2024052103174	B	USDMXN	05/23/2024	150,000,000	16.58273	(2,487,408,750)
2024052103176	B	USDMXN	05/23/2024	50,000,000	16.58273	(829,136,250)
2024052103553	B	USDMXN	05/23/2024	300,000	16.64166	(4,992,498)
2024052103554	B	USDMXN	05/23/2024	1,500,000	16.6409	(24,961,350)
2024052103567	B	USDMXN	05/23/2024	3,000,000	16.63	(49,890,000)
2024052103606	B	USDMXN	05/23/2024	22,408	16.63322	(372,717)
2024011903355	S	USDMXN	05/23/2024	(30,000,000)	17.4685	524,055,000
2024041903089	B	USDMXN	05/23/2024	50,000,000	17.3965	(869,825,000)
2024041903360	B	USDMXN	05/23/2024	50,000,000	17.2655	(863,275,000)
2024042903154	S	USDMXN	05/23/2024	(50,000,000)	17.0968	854,840,000
2024052103223	B	USDMXN	05/23/2024	15,000,000	16.59273	(248,890,875)
2024052103227	B	USDMXN	05/23/2024	15,000,000	16.60973	(249,145,875)
2024052103079	S	USDMXN	05/23/2024	(849,000)	16.59548	14,089,563
2024052103206	S	USDMXN	05/23/2024	(50,000,000)	16.579	828,950,000
2024052203049	S	USDMXN	05/23/2024	(126,336)	16.65493	2,104,119
2024052203102	S	USDMXN	05/23/2024	(50,000,000)	16.655	832,750,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024052203104	S	USDMXN	05/23/2024	(120,000,000)	16.655	1,998,600,000
2024052203107	S	USDMXN	05/23/2024	(44,000,000)	16.655	732,820,000
2023031003679	SO	USDMXN	05/24/2024	(31,200)	19.96999	623,064
2023052203198	S	USDMXN	05/24/2024	(10,000,000)	19.145	191,450,000
2023052903307	B	USDMXN	05/24/2024	10,000,000	18.78131	(187,813,140)
2023090703396	SO	USDMXN	05/24/2024	(31,200)	18.34673	572,418
2023103003666	BO	USDMXN	05/24/2024	2,000,000	18.67066	(37,341,314)
2024011103440	BO	USDMXN	05/24/2024	63,017	17.34047	(1,092,744)
2024021603559	BO	USDMXN	05/24/2024	100,000	17.30896	(1,730,896)
2024043003055	S	USDMXN	05/24/2024	(7,000,000)	17.11663	119,816,431
2024052403680	S	USDMXN	05/24/2024	(20,000,000)	16.7	334,000,000
2024043003376	S	USDMXN	05/24/2024	(50,000,000)	17.147	857,350,000
2024052203050	B	USDMXN	05/24/2024	126,336	16.6577	(2,104,469)
2024052203103	B	USDMXN	05/24/2024	50,000,000	16.6577	(832,885,000)
2024052203105	B	USDMXN	05/24/2024	120,000,000	16.6577	(1,998,924,000)
2024052203108	B	USDMXN	05/24/2024	44,000,000	16.6577	(732,938,800)
2024052303026	S	USDMXN	05/24/2024	(608,336)	16.70953	10,165,009
2024052303033	S	USDMXN	05/24/2024	(139,000,000)	16.725	2,324,775,000
2024052403039	B	EURUSD	05/28/2024	1,000,000	1.08468	(1,084,680)
2024052403093	B	EURUSD	05/28/2024	1,000,000	1.08467	(1,084,670)
2024052403098	B	EURUSD	05/28/2024	1,000,000	1.0845	(1,084,500)
2024052403120	S	EURUSD	05/28/2024	(2,000,000)	1.0851	2,170,200
2024052403123	S	EURUSD	05/28/2024	(1,000,000)	1.0851	1,085,100
2023101103315	SO	USDMXN	05/28/2024	(140,035)	18.57187	2,600,712
2023101803240	SO	USDMXN	05/28/2024	(137,174)	18.96174	2,601,058
2023111403396	S	USDMXN	05/28/2024	(144,509)	17.99377	2,600,262
2023112103389	S	USDMXN	05/28/2024	(146,710)	17.77452	2,607,700
2023112803305	S	USDMXN	05/28/2024	(147,518)	17.64669	2,603,204
2023121503646	BO	USDMXN	05/28/2024	4,461	17.68346	(78,886)
2024020803408	SO	USDMXN	05/28/2024	(217,940)	17.4364	3,800,090
2024022003621	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.3358	(866,790,000)
2024022003628	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.3358	(866,790,000)
2024022003645	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.3418	867,090,000
2024022003652	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.3418	867,090,000
2024022603380	S	USDMXN	05/28/2024	(40,000,000)	17.3695	694,780,000
2024031903792	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.0057	(850,285,000)
2024031903800	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.0117	850,585,000
2024042903641	BO	USDMXN	05/28/2024	69,038	17.09958	(1,180,521)
2024052203658	B	USDMXN	05/28/2024	60,000	16.6557	(999,342)
2024052303238	BO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	(30,190,000)
2024052303239	BO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	(30,190,000)
2024052303240	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.3418	(867,090,000)
2024052303246	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.3418	(867,090,000)
2024052303243	BO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	(13,685,000)
2024052303244	BON	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.0117	(850,585,000)
2024052303236	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.3358	866,790,000
2024052303237	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.3358	866,790,000
2024052303241	SO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	30,490,000
2024052303247	SO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	30,490,000
2024052303242	SON	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.0057	850,285,000
2024052303245	SO	USDMXN	05/28/2024	0	16.732	13,985,000
2024052303403	S	USDMXN	05/28/2024	(2,500,000)	16.7	41,750,000
2024052303808	S	USDMXN	05/28/2024	(200,000)	16.72589	3,345,178
2024052403681	B	USDMXN	05/28/2024	20,000,000	16.7118	(334,236,000)
2024052403066	S	USDMXN	05/28/2024	(40,000,000)	16.72	668,800,000
2024052403106	S	USDMXN	05/28/2024	(30,000,000)	16.73	501,900,000
2024052803095	S	USDMXN	05/28/2024	(7,500,000)	16.7	125,250,000
2023112203506	B	USDMXN	05/28/2024	15,000,000	17.724	(265,860,000)
2023122203337	BO	USDMXN	05/28/2024	5,400,000	17.42829	(94,112,772)
2024042303152	S	USDMXN	05/28/2024	(30,000,000)	17.0712	512,136,000
2024042303613	S	USDMXN	05/28/2024	(50,000,000)	17.0553	852,765,000
2024042303615	S	USDMXN	05/28/2024	(100,000,000)	17.0553	1,705,530,000
2024042403072	B	USDMXN	05/28/2024	100,000,000	17.1412	(1,714,120,000)
2024042403404	B	USDMXN	05/28/2024	50,000,000	17.1548	(857,740,000)
2024052303027	B	USDMXN	05/28/2024	608,336	16.7204	(10,171,624)
2024052303034	B	USDMXN	05/28/2024	139,000,000	16.7357	(2,326,262,300)
2024052303587	S	USDMXN	05/28/2024	(15,000,000)	16.685	250,275,000
2024052703277	B	EURUSD	05/29/2024	1,000,000	1.08582	(1,085,820)
2024052703341	B	EURUSD	05/29/2024	1,000,000	1.0858	(1,085,800)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024052703136	S	EURUSD	05/29/2024	(1,000,000)	1.08568	1,085,680
2024052703232	S	EURUSD	05/29/2024	(1,000,000)	1.08614	1,086,140
2023072803197	BO	USDMXN	05/29/2024	700,000	17.57754	(12,304,275)
2023081003153	BO	USDMXN	05/29/2024	650,000	17.84671	(11,600,359)
2023081003247	B	USDMXN	05/29/2024	550,000	17.85361	(9,819,486)
2023091303131	B	USDMXN	05/29/2024	300,000	17.90841	(5,372,522)
2023091503078	B	USDMXN	05/29/2024	350,000	17.83837	(6,243,430)
2023091903442	B	USDMXN	05/29/2024	450,000	17.84447	(8,030,013)
2023092003169	B	USDMXN	05/29/2024	250,000	17.78468	(4,446,170)
2023110703531	S	USDMXN	05/29/2024	(381,124)	18.06529	6,885,117
2023111503551	B	USDMXN	05/29/2024	500,000	17.90584	(8,952,920)
2023121503375	B	USDMXN	05/29/2024	500,000	17.65134	(8,825,671)
2024040103831	BO	USDMXN	05/29/2024	54,200	16.79797	(910,450)
2024040403731	BO	USDMXN	05/29/2024	33,200	16.73176	(555,495)
2024041903643	BO	USDMXN	05/29/2024	20,400	17.23931	(351,682)
2024043003814	BO	USDMXN	05/29/2024	54,800	17.19773	(942,436)
2024052403067	B	USDMXN	05/29/2024	40,000,000	16.7227	(668,908,000)
2024052403107	B	USDMXN	05/29/2024	30,000,000	16.7327	(501,981,000)
2024052403130	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.71	(33,420,000)
2024052403149	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.71	(33,420,000)
2024052403175	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.69131	(33,382,620)
2024052403207	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.68312	(33,366,240)
2024052403767	B	USDMXN	05/29/2024	40,000	16.69227	(667,691)
2024052403799	B	USDMXN	05/29/2024	110,000	16.69997	(1,836,997)
2024052403038	S	USDMXN	05/29/2024	(1,000,000)	16.71845	16,718,450
2024052403051	S	USDMXN	05/29/2024	(1,000,000)	16.72175	16,721,750
2024052403092	S	USDMXN	05/29/2024	(1,000,000)	16.72716	16,727,160
2024052403111	S	USDMXN	05/29/2024	(1,000,000)	16.72446	16,724,460
2024052403173	S	USDMXN	05/29/2024	(100,000,000)	16.697	1,669,700,000
2024052403336	S	USDMXN	05/29/2024	(4,000,000)	16.7	66,800,000
2024052403355	S	USDMXN	05/29/2024	(50,000,000)	16.695	834,750,000
2024052403566	S	USDMXN	05/29/2024	(10,000,000)	16.693	166,930,000
2024052403595	S	USDMXN	05/29/2024	(400,000)	16.7029	6,681,160
2024052403723	S	USDMXN	05/29/2024	(687,500)	16.68915	11,473,791
2024052403766	S	USDMXN	05/29/2024	(121,450)	16.68949	2,026,935
2024052703054	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.66718	(33,334,360)
2024052703588	B	USDMXN	05/29/2024	2,000,000	16.66672	(33,333,440)
2024052703272	S	USDMXN	05/29/2024	(1,000,000)	16.65756	16,657,560
2024052803096	B	USDMXN	05/29/2024	7,500,000	16.7026	(125,269,500)
2024052803039	S	USDMXN	05/29/2024	(45,000,000)	16.695	751,275,000
2024030403956	BO	USDMXN	05/29/2024	400,000	17.23431	(6,893,722)
2024030403957	BO	USDMXN	05/29/2024	500,000	17.20356	(8,601,782)
2024052403391	B	USDMXN	05/29/2024	100,000,000	16.695	(1,669,500,000)
2024052403393	B	USDMXN	05/29/2024	100,000,000	16.696	(1,669,600,000)
2024052403251	S	USDMXN	05/29/2024	(100,000,000)	16.685	1,668,500,000
2024052803089	B	USDMXN	05/29/2024	125,000,000	16.691	(2,086,375,000)
2024052803108	B	USDMXN	05/29/2024	124,448,400	16.691	(2,077,168,238)
2024052803070	S	USDMXN	05/29/2024	(39,320,165)	16.6905	656,273,218
2024052803104	S	USDMXN	05/29/2024	(679,835)	16.71586	11,364,021
2024052803113	S	USDMXN	05/29/2024	(448,400)	16.73076	7,502,065
2024052803494	S	USDMXN	05/29/2024	(59,523,810)	16.8	1,000,000,000
2024052803582	S	USDMXN	05/29/2024	(24,000,000)	16.805	403,320,000
2024052803584	S	USDMXN	05/29/2024	(476,190)	16.79974	7,999,875
2024052803014	B	EURUSD	05/30/2024	1,000,000	1.08705	(1,087,050)
2024052803466	B	EURUSD	05/30/2024	1,000,000	1.0866	(1,086,600)
2024052803035	S	EURUSD	05/30/2024	(1,000,000)	1.0859	1,085,900
2024052803789	S	EURUSD	05/30/2024	(1,000,000)	1.08598	1,085,980
2023031003632	SO	USDMXN	05/30/2024	(125,000)	20.04995	2,506,244
2023031403152	SO	USDMXN	05/30/2024	(125,000)	20.72512	2,590,640
2023053003212	S	USDMXN	05/30/2024	(10,000,000)	18.87324	188,732,359
2023101703217	B	USDMXN	05/30/2024	289,010	18.63745	(5,386,403)
2023110603400	B	USDMXN	05/30/2024	250,000	18.14807	(4,537,018)
2024010303420	BO	USDMXN	05/30/2024	24,206	17.46812	(422,833)
2024010303534	SO	USDMXN	05/30/2024	(37,850)	17.46248	660,955
2024010803456	BO	USDMXN	05/30/2024	50,000	17.19935	(859,968)
2024052703628	B	USDMXN	05/30/2024	500,000	16.70341	(8,351,705)
2024052803036	B	USDMXN	05/30/2024	1,000,000	16.69766	(16,697,660)
2024052803040	B	USDMXN	05/30/2024	45,000,000	16.69768	(751,395,375)
2024052803099	B	USDMXN	05/30/2024	50,000,000	16.692	(834,600,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024052803101	B	USDMXN	05/30/2024	50,000,000	16.692	(834,600,000)
2024052803171	B	USDMXN	05/30/2024	2,000,000	16.72251	(33,445,020)
2024052803173	B	USDMXN	05/30/2024	2,000,000	16.7219	(33,443,800)
2024052803222	B	USDMXN	05/30/2024	2,000,000	16.71199	(33,423,980)
2024052803715	B	USDMXN	05/30/2024	10,000,000	16.792	(167,920,000)
2024052803013	S	USDMXN	05/30/2024	(1,000,000)	16.68056	16,680,560
2024052803110	S	USDMXN	05/30/2024	(2,000,000)	16.73152	33,463,040
2024052803112	S	USDMXN	05/30/2024	(2,000,000)	16.73247	33,464,940
2024052803124	S	USDMXN	05/30/2024	(1,000,000)	16.73082	16,730,820
2024052803241	S	USDMXN	05/30/2024	(2,000,000)	16.73	33,460,000
2024052803753	S	USDMXN	05/30/2024	(50,000,000)	16.8	840,000,000
2024052803790	S	USDMXN	05/30/2024	(41,813)	16.8046	702,649
2024052903029	S	USDMXN	05/30/2024	(40,000,000)	16.92	676,800,000
2024052903031	S	USDMXN	05/30/2024	(10,000,000)	16.92	169,200,000
2024052803105	B	USDMXN	05/30/2024	679,835	16.7186	(11,365,885)
2024052803114	B	USDMXN	05/30/2024	448,400	16.7335	(7,503,295)
2024052803495	B	USDMXN	05/30/2024	59,514,068	16.80275	(1,000,000,000)
2024052803583	B	USDMXN	05/30/2024	24,000,000	16.80775	(403,386,000)
2024052803585	B	USDMXN	05/30/2024	476,190	16.8026	(8,001,238)
2024052803703	B	USDMXN	05/30/2024	643,000	16.81212	(10,810,193)
2024052903161	S	USDMXN	05/30/2024	(84,205)	16.95512	1,427,712
2024052903418	S	USDMXN	05/30/2024	(104,000,000)	16.95	1,762,800,000
2024052903044	B	EURUSD	05/31/2024	1,000,000	1.08197	(1,081,970)
2024052903045	B	EURUSD	05/31/2024	1,000,000	1.08167	(1,081,670)
2024052903064	S	EURUSD	05/31/2024	(1,000,000)	1.08136	1,081,360
2024052903066	S	EURUSD	05/31/2024	(1,000,000)	1.08133	1,081,330
2022110103596	B	USDMXN	05/31/2024	4,230,000	21.80542	(92,236,914)
2023031003880	S	USDMXN	05/31/2024	(31,200)	20.03551	625,108
2023090703395	SO	USDMXN	05/31/2024	(31,200)	18.36926	573,121
2023111603391	B	USDMXN	05/31/2024	250,000	17.82721	(4,456,802)
2023120503138	B	USDMXN	05/31/2024	40,200	17.93263	(720,892)
2024010303535	SO	USDMXN	05/31/2024	(37,000)	17.46515	646,211
2024011103444	BO	USDMXN	05/31/2024	63,017	17.36047	(1,094,005)
2024021603560	BO	USDMXN	05/31/2024	100,000	17.32819	(1,732,819)
2024052403596	B	USDMXN	05/31/2024	400,000	16.7084	(6,683,361)
2024052903030	B	USDMXN	05/31/2024	40,000,000	16.92273	(676,909,000)
2024052903032	B	USDMXN	05/31/2024	10,000,000	16.92273	(169,227,250)
2024052903075	B	USDMXN	05/31/2024	1,000,000	16.95067	(16,950,670)
2024052903084	B	USDMXN	05/31/2024	1,000,000	16.95905	(16,959,050)
2024052903088	B	USDMXN	05/31/2024	1,000,000	16.96167	(16,961,670)
2024052903173	B	USDMXN	05/31/2024	1,000,000	16.94056	(16,940,560)
2024052903449	B	USDMXN	05/31/2024	1,000,000	16.93	(16,930,000)
2024052903740	B	USDMXN	05/31/2024	229,633	16.97211	(3,897,351)
2024052903284	S	USDMXN	05/31/2024	(1,000,000)	16.90645	16,906,450
2024052903285	S	USDMXN	05/31/2024	(2,000,000)	16.90287	33,805,740
2024052903302	S	USDMXN	05/31/2024	(2,000,000)	16.92	33,840,000
2024052903328	S	USDMXN	05/31/2024	(1,000,000)	16.93	16,930,000
2024052903354	S	USDMXN	05/31/2024	(1,500,000)	16.95	25,425,000
2024052903525	S	USDMXN	05/31/2024	(1,000,000)	16.92355	16,923,550
2024052903670	S	USDMXN	05/31/2024	(2,000,000)	16.93	33,860,000
2024052803090	S	USDMXN	05/31/2024	(125,000,000)	16.6963	2,087,037,500
2024052803109	S	USDMXN	05/31/2024	(124,408,895)	16.6963	2,077,168,238
2024052903138	B	USDMXN	05/31/2024	200,000,000	16.9515	(3,390,300,000)
2024052903144	B	USDMXN	05/31/2024	50,000,000	16.96	(848,000,000)
2024052903162	B	USDMXN	05/31/2024	84,205	16.9579	(1,427,946)
2024052903419	B	USDMXN	05/31/2024	104,000,000	16.95275	(1,763,086,000)
2024052903146	S	USDMXN	05/31/2024	(50,000,000)	16.9625	848,125,000
2024052903447	S	USDMXN	05/31/2024	(15,000,000)	16.94	254,100,000
2024052903464	S	USDMXN	05/31/2024	(15,000,000)	16.945	254,175,000
2024052903679	S	USDMXN	05/31/2024	(15,000,000)	16.926	253,890,000
2024052903687	S	USDMXN	05/31/2024	(50,000,000)	16.95	847,500,000
2024053003024	B	USDMXN	05/31/2024	122,575,725	16.946	(2,077,168,237)
2024053003169	S	USDMXN	05/31/2024	(33,000,000)	16.945	559,185,000
2024053003173	S	USDMXN	05/31/2024	(877,218)	16.91966	14,842,225
2024053003629	S	USDMXN	05/31/2024	(89,000,000)	16.948	1,508,372,000
2024053003685	S	USDMXN	05/31/2024	(73,000,000)	16.968	1,238,664,000
2024053003701	S	USDMXN	05/31/2024	(40,000,000)	16.97	678,800,000
2024061103055	B	EURUSD	06/13/2024	1,000,000	1.07223	(1,072,230)
2024061103057	B	EURUSD	06/13/2024	1,000,000	1.07216	(1,072,160)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024061103387	B	EURUSD	06/13/2024	1,000,000	1.07416	(1,074,160)
2024061103088	S	EURUSD	06/13/2024	(2,000,000)	1.0728	2,145,600
2024061103221	S	EURUSD	06/13/2024	(1,000,000)	1.07327	1,073,270
2024010303422	BO	USDMXN	06/13/2024	30,389	17.50868	(532,071)
2024010303538	BO	USDMXN	06/13/2024	57,055	17.50891	(998,971)
2024052303751	SO	USDMXN	06/13/2024	(164,000)	16.77326	2,750,815
2024061103294	B	USDMXN	06/13/2024	20,000,000	18.425	(368,500,000)
2024061103527	B	USDMXN	06/13/2024	1,000,000	18.5098	(18,509,800)
2024061103528	B	USDMXN	06/13/2024	1,000,000	18.5121	(18,512,100)
2024061103536	B	USDMXN	06/13/2024	417,175	18.50435	(7,719,545)
2024061103572	B	USDMXN	06/13/2024	1,000,000	18.4663	(18,466,300)
2024061103601	B	USDMXN	06/13/2024	1,000,000	18.4776	(18,477,600)
2024061103604	B	USDMXN	06/13/2024	1,000,000	18.47629	(18,476,290)
2024061103013	S	USDMXN	06/13/2024	(10,048)	18.36915	184,566
2024061103380	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.42	18,420,000
2024061103382	S	USDMXN	06/13/2024	(570,588)	18.41812	10,509,157
2024061103438	S	USDMXN	06/13/2024	(1,500,000)	18.435	27,652,500
2024061103455	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.47571	18,475,710
2024061103477	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.47537	18,475,370
2024061103574	S	USDMXN	06/13/2024	(20,000,000)	18.46164	369,232,800
2024061103586	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.5	18,500,000
2024061103596	S	USDMXN	06/13/2024	(5,000,000)	18.51219	92,560,950
2024061103636	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.43364	18,433,640
2024061103670	S	USDMXN	06/13/2024	(1,000,000)	18.43538	18,435,380
2023110903303	S	USDMXN	06/13/2024	(30,000,000)	18.1255	543,765,000
2024031103329	B	USDMXN	06/13/2024	30,000,000	17.0518	(511,554,000)
2024050903092	B	USDMXN	06/13/2024	50,000,000	16.9982	(849,910,000)
2024060403525	B	USDMXN	06/13/2024	100,000,000	17.9088	(1,790,880,000)
2024061103072	S	USDMXN	06/13/2024	(63,000,000)	18.43325	1,161,294,750
2024061103079	S	USDMXN	06/13/2024	(733,150)	18.4457	13,523,470
2024061103772	S	USDMXN	06/13/2024	(20,000,000)	18.51	370,200,000
2024061103798	S	USDMXN	06/13/2024	(10,000,000)	18.51	185,100,000
2024061103806	S	USDMXN	06/13/2024	(20,000,000)	18.51	370,200,000
2024061203278	B	USDMXN	06/13/2024	26,624,000	18.78295	(500,077,261)
2024061203280	B	USDMXN	06/13/2024	26,624,000	18.78295	(500,077,261)
2024061203037	S	USDMXN	06/13/2024	(43,000,000)	18.92	813,560,000
2024061203041	S	USDMXN	06/13/2024	(4,438)	18.89705	83,872
2024061203273	S	USDMXN	06/13/2024	(26,624,000)	18.78295	500,077,261
2024061203275	S	USDMXN	06/13/2024	(26,624,000)	18.78295	500,077,261
2024020803254	B	EURMXN	06/14/2024	125,000	18.89177	(2,361,472)
2024052803739	BO	EURMXN	06/14/2024	147,651	18.30785	(2,703,172)
2024061203391	B	EURUSD	06/14/2024	2,000,000	1.08409	(2,168,180)
2024061203393	B	EURUSD	06/14/2024	2,000,000	1.084	(2,168,000)
2024061203138	S	EURUSD	06/14/2024	(1,000,000)	1.08476	1,084,760
2024061203241	S	EURUSD	06/14/2024	(1,000,000)	1.08455	1,084,550
2024061203431	S	EURUSD	06/14/2024	(2,000,000)	1.08396	2,167,920
2023031003634	SO	USDMXN	06/14/2024	(175,000)	20.09775	3,517,106
2023031003676	SO	USDMXN	06/14/2024	(39,000)	20.03628	781,415
2023031403153	SO	USDMXN	06/14/2024	(175,000)	20.7743	3,635,502
2023090703401	SO	USDMXN	06/14/2024	(39,000)	18.41448	718,165
2023110603402	B	USDMXN	06/14/2024	350,000	18.1951	(6,368,286)
2024011103439	BO	USDMXN	06/14/2024	63,017	17.40049	(1,096,527)
2024032703859	BO	USDMXN	06/14/2024	70,000	16.75658	(1,172,961)
2024041603811	BO	USDMXN	06/14/2024	299,200	17.27128	(5,167,566)
2024052303683	BO	USDMXN	06/14/2024	363,962	16.78506	(6,109,123)
2024052803359	SO	USDMXN	06/14/2024	(291,000)	16.76066	4,877,353
2024060303024	SO	USDMXN	06/14/2024	(200,000)	17.52525	3,505,051
2024061203120	B	USDMXN	06/14/2024	1,000,000	18.87328	(18,873,280)
2024061203121	B	USDMXN	06/14/2024	1,000,000	18.87023	(18,870,230)
2024061203176	B	USDMXN	06/14/2024	3,000,000	18.79406	(56,382,180)
2024061203432	B	USDMXN	06/14/2024	66,467	18.67713	(1,241,416)
2024061203136	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.83655	18,836,550
2024061203137	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.82982	18,829,820
2024061203208	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.75	18,750,000
2024061203227	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.75	18,750,000
2024061203235	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.75021	18,750,210
2024061203390	S	USDMXN	06/14/2024	(1,000,000)	18.72	18,720,000
2024061203395	S	USDMXN	06/14/2024	(700,000)	18.72	13,104,000
2024061403035	B	USDMXN	06/14/2024	200,000,000	18.58	(3,716,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024061403037	S	USDMXN	06/14/2024	(100,000,000)	18.55	1,855,000,000
2024061403039	S	USDMXN	06/14/2024	(100,000,000)	18.55	1,855,000,000
2024031203527	S	USDMXN	06/14/2024	(79,000,000)	17.0505	1,346,989,500
2024031203575	S	USDMXN	06/14/2024	(30,000,000)	17.0555	511,665,000
2024052903038	B	USDMXN	06/14/2024	200,000,000	16.975	(3,395,000,000)
2024060403139	S	USDMXN	06/14/2024	(236,229,407)	17.846	4,215,750,000
2024060503325	B	USDMXN	06/14/2024	150,000,000	17.558	(2,633,700,000)
2024060503527	S	USDMXN	06/14/2024	(236,618,850)	17.846	4,222,700,000
2024061203038	B	USDMXN	06/14/2024	43,000,000	18.9239	(813,727,700)
2024061203042	B	USDMXN	06/14/2024	4,438	18.9011	(83,890)
2024061203264	B	USDMXN	06/14/2024	149,000	18.7354	(2,791,575)
2024061203044	S	USDMXN	06/14/2024	(50,000,000)	18.91	945,500,000
2024061203190	S	USDMXN	06/14/2024	(20,000,000)	18.84	376,800,000
2024061203193	S	USDMXN	06/14/2024	(20,000,000)	18.8405	376,810,000
2024061203255	S	USDMXN	06/14/2024	(106,490,602)	18.781	2,000,000,000
2024061203258	S	USDMXN	06/14/2024	(30,000,000)	18.781	563,430,000
2024061303011	B	USDMXN	06/14/2024	314,210	18.58328	(5,839,059)
2024061303556	B	USDMXN	06/14/2024	191,000,000	18.43	(3,520,130,000)
2024061303090	B	EURUSD	06/17/2024	1,000,000	1.0766	(1,076,600)
2024061303143	B	EURUSD	06/17/2024	1,000,000	1.07639	(1,076,390)
2024061303359	B	EURUSD	06/17/2024	1,000,000	1.07388	(1,073,880)
2024061303216	S	EURUSD	06/17/2024	(1,000,000)	1.07501	1,075,010
2024061303235	S	EURUSD	06/17/2024	(1,000,000)	1.07424	1,074,240
2024061303414	S	EURUSD	06/17/2024	(1,000,000)	1.07406	1,074,060
2023071303121	B	USDMXN	06/17/2024	393,034	17.98749	(7,069,696)
2023091403450	B	USDMXN	06/17/2024	393,034	17.92257	(7,044,181)
2023121803645	BO	USDMXN	06/17/2024	551,512	17.68875	(9,755,557)
2023121903366	B	USDMXN	06/17/2024	2,029,045	17.60381	(35,718,921)
2023121903610	B	USDMXN	06/17/2024	1,799,342	17.59644	(31,662,008)
2024031303188	B	USDMXN	06/17/2024	50,000,000	16.9935	(849,675,000)
2024040303629	BO	USDMXN	06/17/2024	100,000	16.73823	(1,673,823)
2024040303636	SO	USDMXN	06/17/2024	(50,000)	16.73278	836,639
2024041903644	BO	USDMXN	06/17/2024	40,125	17.29443	(693,939)
2024061203747	S	USDMXN	06/17/2024	(28,065)	18.71715	525,297
2024061303089	B	USDMXN	06/17/2024	1,000,000	18.5699	(18,569,900)
2024061303097	B	USDMXN	06/17/2024	1,000,000	18.57023	(18,570,230)
2024061303423	B	USDMXN	06/17/2024	1,000,000	18.52148	(18,521,480)
2024061303553	B	USDMXN	06/17/2024	10,000,000	18.44	(184,400,000)
2024061303566	B	USDMXN	06/17/2024	1,000,000	18.44651	(18,446,510)
2024061303615	B	USDMXN	06/17/2024	1,000,000	18.46209	(18,462,090)
2024061303177	S	USDMXN	06/17/2024	(1,000,000)	18.56	18,560,000
2024061303199	S	USDMXN	06/17/2024	(1,000,000)	18.56	18,560,000
2024061303207	S	USDMXN	06/17/2024	(1,000,000)	18.576	18,576,000
2024061303646	S	USDMXN	06/17/2024	(2,000,000)	18.48	36,960,000
2024061303747	S	USDMXN	06/17/2024	(244,327)	18.43192	4,503,416
2024061403036	S	USDMXN	06/17/2024	(200,000,000)	18.5889	3,717,780,000
2023111503677	B	USDMXN	06/17/2024	20,000,000	17.9395	(358,790,000)
2024041103780	S	USDMXN	06/17/2024	(20,000,000)	16.6057	332,114,000
2024041103783	S	USDMXN	06/17/2024	(30,000,000)	16.6057	498,171,000
2024041503511	S	USDMXN	06/17/2024	(50,000,000)	16.8828	844,140,000
2024041503513	S	USDMXN	06/17/2024	(50,000,000)	16.8828	844,140,000
2024050603501	BO	USDMXN	06/17/2024	41,100	16.97353	(697,612)
2024050603507	BO	USDMXN	06/17/2024	41,100	16.97353	(697,612)
2024060603447	B	USDMXN	06/17/2024	100,000,000	17.5683	(1,756,830,000)
2024061303364	B	USDMXN	06/17/2024	70,000,000	18.515	(1,296,050,000)
2024061303383	B	USDMXN	06/17/2024	15,000,000	18.55	(278,250,000)
2024061303012	S	USDMXN	06/17/2024	(314,210)	18.593	5,842,114
2024061303557	S	USDMXN	06/17/2024	(191,000,000)	18.43958	3,521,959,780
2024061403374	B	USDMXN	06/17/2024	115,000,000	18.435	(2,120,025,000)
2024061403376	B	USDMXN	06/17/2024	150,000,000	18.435	(2,765,250,000)
2024061403379	B	USDMXN	06/17/2024	173,450	18.43241	(3,197,110)
2024061403334	B	EURUSD	06/18/2024	1,000,000	1.07013	(1,070,130)
2024061403494	B	EURUSD	06/18/2024	1,000,000	1.07004	(1,070,040)
2024061403228	S	EURUSD	06/18/2024	(1,000,000)	1.06959	1,069,590
2024061403478	S	EURUSD	06/18/2024	(1,000,000)	1.06991	1,069,910
2023100303196	SO	USDMXN	06/18/2024	(256,131)	18.74097	4,800,142
2023101703311	SO	USDMXN	06/18/2024	(257,594)	18.64827	4,803,682
2024021603563	BO	USDMXN	06/18/2024	100,000	17.38037	(1,738,037)
2024032603398	SO	USDMXN	06/18/2024	(521,451)	16.87856	8,801,344

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024040203517	SO	USDMXN	06/18/2024	(489,289)	16.75953	8,200,256
2024041903646	BO	USDMXN	06/18/2024	300,000	17.29529	(5,188,587)
2024061403030	B	USDMXN	06/18/2024	100,000,000	18.585	(1,858,500,000)
2024061403033	B	USDMXN	06/18/2024	100,000,000	18.585	(1,858,500,000)
2024061403333	B	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	18.43	(18,430,000)
2024061403378	B	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	18.43	(18,430,000)
2024061403389	B	USDMXN	06/18/2024	50,000,000	18.475	(923,750,000)
2024061403397	B	USDMXN	06/18/2024	15,000,000	18.475	(277,125,000)
2024061403589	B	USDMXN	06/18/2024	182,307	18.50941	(3,374,398)
2024061403261	S	USDMXN	06/18/2024	(1,000,000)	18.46821	18,468,210
2024061403695	S	USDMXN	06/18/2024	(30,000,000)	18.46	553,800,000
2024061403840	S	USDMXN	06/18/2024	(449,424)	18.45341	8,293,405
2024050203318	BO	EURMXN	06/18/2024	20,400	18.29096	(373,136)
2024050203320	BO	EURMXN	06/18/2024	20,400	18.29096	(373,136)
2024050203341	BO	EURMXN	06/18/2024	20,400	18.28452	(373,004)
2024050203351	BO	EURMXN	06/18/2024	20,400	18.28452	(373,004)
2024050203300	SO	EURMXN	06/18/2024	(20,400)	18.28607	373,036
2024050203313	SO	EURMXN	06/18/2024	(20,400)	18.28607	373,036
2024050203354	SO	EURMXN	06/18/2024	(20,400)	18.28331	372,980
2024050203357	SO	EURMXN	06/18/2024	(20,400)	18.28331	372,980
2024041903563	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.2922	(17,292,200)
2024041903564	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.29182	(17,291,816)
2024041903568	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.29152	(17,291,516)
2024041903583	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.2922	(17,292,200)
2024041903592	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.29182	(17,291,816)
2024041903595	BO	USDMXN	06/18/2024	1,000,000	17.29152	(17,291,516)
2024061403321	B	USDMXN	06/18/2024	30,000,000	18.477	(554,310,000)
2024061403530	B	USDMXN	06/18/2024	55,000,000	18.48	(1,016,400,000)
2024061403534	B	USDMXN	06/18/2024	25,000,000	18.48	(462,000,000)
2024061403088	S	USDMXN	06/18/2024	(10,000,000)	18.5	185,000,000
2024061403375	S	USDMXN	06/18/2024	(115,000,000)	18.438	2,120,370,000
2024061403377	S	USDMXN	06/18/2024	(150,000,000)	18.438	2,765,700,000
2024061403380	S	USDMXN	06/18/2024	(173,450)	18.4353	3,197,611
2024061403728	S	USDMXN	06/18/2024	(30,000,000)	18.45	553,500,000
2024061703499	S	USDMXN	06/18/2024	(43,000,000)	18.55	797,650,000
2024061703501	S	USDMXN	06/18/2024	(893,121)	18.54175	16,560,029
2024061703508	B	EURUSD	06/20/2024	1,000,000	1.07327	(1,073,270)
2024061703692	B	EURUSD	06/20/2024	1,000,000	1.07317	(1,073,170)
2024061703161	S	EURUSD	06/20/2024	(2,000,000)	1.07219	2,144,380
2024061803045	B	EURUSD	06/20/2024	2,000,000	1.07493	(2,149,860)
2024061803139	B	EURUSD	06/20/2024	2,000,000	1.07398	(2,147,960)
2024061803097	S	EURUSD	06/20/2024	(1,000,000)	1.07389	1,073,890
2024061803099	S	EURUSD	06/20/2024	(1,000,000)	1.07372	1,073,720
2024061803570	S	EURUSD	06/20/2024	(2,000,000)	1.07346	2,146,920
2023101203194	B	USDMXN	06/20/2024	1,338,484	18.68897	(25,014,885)
2024010303423	BO	USDMXN	06/20/2024	30,389	17.52924	(532,696)
2024010303540	BO	USDMXN	06/20/2024	57,055	17.5295	(1,000,145)
2024011203656	B	USDMXN	06/20/2024	65,405	17.29886	(1,131,432)
2024012303354	B	USDMXN	06/20/2024	251,504	17.80378	(4,477,723)
2024020903138	B	USDMXN	06/20/2024	50,000,000	17.4625	(873,125,000)
2024020903028	S	USDMXN	06/20/2024	(108,035,305)	17.448	1,885,000,000
2024021403250	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.4575	(523,725,000)
2024021403245	S	USDMXN	06/20/2024	(30,000,000)	17.4575	523,725,000
2024021503359	B	USDMXN	06/20/2024	20,000,000	17.4155	(348,310,000)
2024021503750	B	USDMXN	06/20/2024	20,000,000	17.4155	(348,310,000)
2024031303481	BO	USDMXN	06/20/2024	50,000	16.95229	(847,614)
2024031903823	BO	USDMXN	06/20/2024	166,038	17.06634	(2,833,660)
2024040403715	BO	USDMXN	06/20/2024	49,600	16.79903	(833,232)
2024052103723	BO	USDMXN	06/20/2024	34,000	16.96783	(576,906)
2024052203608	BO	USDMXN	06/20/2024	56,000	16.74658	(937,808)
2024052903276	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.0395	(511,185,000)
2024060303806	SO	USDMXN	06/20/2024	(271,714)	17.76381	4,826,677
2024060503652	S	USDMXN	06/20/2024	(500,000)	17.61527	8,807,637
2024061003227	S	USDMXN	06/20/2024	(100,000,000)	18.4008	1,840,080,000
2024061303418	BO	USDMXN	06/20/2024	111,272	18.52981	(2,061,849)
2024061703059	B	USDMXN	06/20/2024	2,000,000	18.54024	(37,080,480)
2024061703071	B	USDMXN	06/20/2024	1,000,000	18.54052	(18,540,520)
2024061703191	B	USDMXN	06/20/2024	1,000,000	18.52207	(18,522,070)
2024061703241	B	USDMXN	06/20/2024	1,000,000	18.50415	(18,504,150)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024061703464	B	USDMXN	06/20/2024	50,000,000	18.553	(927,650,000)
2024061703731	B	USDMXN	06/20/2024	325,963	18.54931	(6,046,396)
2024061703766	B	USDMXN	06/20/2024	1,095,429	18.54316	(20,312,720)
2024061703089	S	USDMXN	06/20/2024	(1,000,000)	18.51831	18,518,310
2024061703090	S	USDMXN	06/20/2024	(1,000,000)	18.51924	18,519,240
2024061703426	S	USDMXN	06/20/2024	(2,000,000)	18.54	37,080,000
2024061703709	S	USDMXN	06/20/2024	(10,000,000)	18.569	185,690,000
2023092603073	BO	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	18.232	(546,960,000)
2023092603089	BO	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	18.232	(546,960,000)
2023092603068	S	USDMXN	06/20/2024	(30,000,000)	18.22	546,600,000
2024021503127	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.4025	(522,075,000)
2024021503771	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.4025	(522,075,000)
2024022303032	S	USDMXN	06/20/2024	(50,000,000)	17.4022	870,110,000
2024022803329	S	USDMXN	06/20/2024	(30,000,000)	17.3853	521,559,000
2024030403203	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.282	(518,460,000)
2024030403322	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.251	(517,530,000)
2024030403741	B	USDMXN	06/20/2024	30,000,000	17.247	(517,410,000)
2024030503541	B	USDMXN	06/20/2024	50,000,000	17.207	(860,350,000)
2024031203056	B	USDMXN	06/20/2024	50,000,000	17.0678	(853,390,000)
2024031303405	B	USDMXN	06/20/2024	80,000,000	16.9533	(1,356,264,000)
2024032503545	S	USDMXN	06/20/2024	(64,491,340)	16.917	1,091,000,000
2024041103001	B	USDMXN	06/20/2024	54,265,903	16.585	(900,000,000)
2024041103006	B	USDMXN	06/20/2024	54,246,278	16.591	(900,000,000)
2024041103010	B	USDMXN	06/20/2024	54,247,913	16.5905	(900,000,000)
2024041503009	B	USDMXN	06/20/2024	54,930,781	16.7825	(921,875,837)
2024041603121	S	USDMXN	06/20/2024	(31,854,133)	17.231	548,878,560
2024041803080	S	USDMXN	06/20/2024	(116,160,883)	17.2175	2,000,000,000
2024041803115	S	USDMXN	06/20/2024	(88,205,708)	17.227	1,519,519,727
2024041803522	S	USDMXN	06/20/2024	(58,080,441)	17.2175	1,000,000,000
2024041803527	S	USDMXN	06/20/2024	(58,080,441)	17.2175	1,000,000,000
2024041803543	S	USDMXN	06/20/2024	(116,160,883)	17.2175	2,000,000,000
2024043003843	B	USDMXN	06/20/2024	100,000,000	17.2495	(1,724,950,000)
2024043003027	S	USDMXN	06/20/2024	(54,010,373)	17.1932	928,611,139
2024043003779	S	USDMXN	06/20/2024	(100,000,000)	17.2415	1,724,150,000
2024050203551	S	USDMXN	06/20/2024	(50,000,000)	17.0508	852,540,000
2024050303010	S	USDMXN	06/20/2024	(47,087,076)	16.9898	800,000,000
2024050303012	S	USDMXN	06/20/2024	(90,969,078)	17.015	1,547,838,858
2024050903140	B	USDMXN	06/20/2024	73,379,228	16.988	(1,246,566,329)
2024051703492	B	USDMXN	06/20/2024	100,000,000	16.7007	(1,670,070,000)
2024051703105	S	USDMXN	06/20/2024	(59,768,933)	16.7311	1,000,000,000
2024051703107	S	USDMXN	06/20/2024	(77,132,347)	16.6931	1,287,577,975
2024051703109	S	USDMXN	06/20/2024	(11,182,560)	16.6931	186,671,589
2024052403252	B	USDMXN	06/20/2024	100,000,000	16.7435	(1,674,350,000)
2024060303259	SO	USDMXN	06/20/2024	(160,000)	17.59	2,814,400
2024061703500	B	USDMXN	06/20/2024	43,000,000	18.5562	(797,916,600)
2024061703502	B	USDMXN	06/20/2024	893,121	18.5481	(16,565,700)
2024061703601	S	USDMXN	06/20/2024	(35,000,000)	18.584	650,440,000
2024061803075	B	USDMXN	06/20/2024	20,000,000	18.4315	(368,630,000)
2024061803227	B	USDMXN	06/20/2024	301,840	18.38905	(5,550,548)
2024061803263	B	USDMXN	06/20/2024	50,000,000	18.3835	(919,175,000)
2024061803268	B	USDMXN	06/20/2024	51,000,000	18.3835	(937,558,500)
2024061803102	S	USDMXN	06/20/2024	(92,070)	18.39339	1,693,482
2024061803107	S	USDMXN	06/20/2024	(101,301,840)	18.39	1,862,940,835
2023111503580	BO	EURMXN	06/21/2024	40,000	19.67415	(786,966)
2024062003462	BO	EURMXN	06/21/2024	2,000,000	19.63682	(39,273,646)
2023031003675	SO	USDMXN	06/21/2024	(39,000)	20.05724	782,232
2023090703403	SO	USDMXN	06/21/2024	(39,000)	18.43724	719,052
2023101703459	B	USDMXN	06/21/2024	300,000	18.70637	(5,611,911)
2023120403571	SO	USDMXN	06/21/2024	(200,000)	18.02195	3,604,390
2024011103180	BO	USDMXN	06/21/2024	100,000	17.46439	(1,746,439)
2024011103353	BO	USDMXN	06/21/2024	100,000	17.43704	(1,743,704)
2024011103445	BO	USDMXN	06/21/2024	63,017	17.42112	(1,097,827)
2024061803040	B	USDMXN	06/21/2024	1,000,000	18.40562	(18,405,620)
2024061803312	B	USDMXN	06/21/2024	1,000,000	18.39992	(18,399,920)
2024061803473	B	USDMXN	06/21/2024	500,000	18.3955	(9,197,750)
2024061803543	B	USDMXN	06/21/2024	500,000	18.46284	(9,231,420)
2024061803643	B	USDMXN	06/21/2024	559,000	18.41931	(10,296,394)
2024061803033	S	USDMXN	06/21/2024	(1,000,000)	18.42846	18,428,460
2024061803113	S	USDMXN	06/21/2024	(100,000,000)	18.395	1,839,500,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024061803439	S	USDMXN	06/21/2024	(50,000,000)	18.4405	922,025,000
2024061803475	S	USDMXN	06/21/2024	(1,000,000)	18.49433	18,494,330
2024061803607	SO	USDMXN	06/21/2024	(500,000)	18.418	9,209,000
2024061803636	S	USDMXN	06/21/2024	(1,000,000)	18.43	18,430,000
2024061803774	S	USDMXN	06/21/2024	(159,557)	18.3995	2,935,761
2024061803785	S	USDMXN	06/21/2024	(1,000,000)	18.40885	18,408,850
2024061903035	B	USDMXN	06/21/2024	1,000,000	18.40299	(18,402,990)
2024061903380	B	USDMXN	06/21/2024	150,000	18.44058	(2,766,087)
2024061903423	B	USDMXN	06/21/2024	67,248	18.4462	(1,240,465)
2024061903053	S	USDMXN	06/21/2024	(1,000,000)	18.435	18,435,000
2024031903675	S	USDMXN	06/21/2024	(25,000,000)	17.0945	427,362,500
2024031903679	S	USDMXN	06/21/2024	(25,000,000)	17.0945	427,362,500
2024061203256	B	USDMXN	06/21/2024	106,340,556	18.8075	(2,000,000,000)
2024061803103	B	USDMXN	06/21/2024	92,070	18.397	(1,693,814)
2024061803204	B	USDMXN	06/21/2024	15,000,000	18.385	(275,775,000)
2024061803076	S	USDMXN	06/21/2024	(20,000,000)	18.4348	368,696,000
2024061803208	S	USDMXN	06/21/2024	(15,000,000)	18.385	275,775,000
2024061803228	S	USDMXN	06/21/2024	(301,840)	18.3921	5,551,469
2024061803264	S	USDMXN	06/21/2024	(50,000,000)	18.3868	919,340,000
2024061803269	S	USDMXN	06/21/2024	(51,000,000)	18.3868	937,726,800
2024061803278	S	USDMXN	06/21/2024	(30,000,000)	18.38	551,400,000
2024062003091	B	USDMXN	06/21/2024	101,000,000	18.416	(1,860,016,000)
2024062003096	B	USDMXN	06/21/2024	987,812	18.4167	(18,192,233)
2024062003059	B	EURUSD	06/24/2024	2,000,000	1.07221	(2,144,420)
2024062003068	S	EURUSD	06/24/2024	(1,000,000)	1.0716	1,071,600
2024062003080	S	EURUSD	06/24/2024	(1,000,000)	1.07148	1,071,480
2023121503641	BO	USDMXN	06/24/2024	4,442	17.76703	(78,916)
2024031303482	BO	USDMXN	06/24/2024	50,000	16.96322	(848,161)
2024060603619	SO	USDMXN	06/24/2024	(36,000)	17.60255	633,692
2024062003275	B	USDMXN	06/24/2024	100,000,000	18.405	(1,840,500,000)
2024062003415	B	USDMXN	06/24/2024	1,000,000	18.40475	(18,404,750)
2024062003418	B	USDMXN	06/24/2024	1,000,000	18.40727	(18,407,270)
2024062003603	B	USDMXN	06/24/2024	100,000	18.31302	(1,831,302)
2024062003821	B	USDMXN	06/24/2024	1,000,000	18.37017	(18,370,170)
2024062003823	B	USDMXN	06/24/2024	1,000,000	18.37094	(18,370,940)
2024062003943	B	USDMXN	06/24/2024	667,950	18.3706	(12,270,642)
2024062003103	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.4134	18,413,400
2024062003104	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.41508	18,415,080
2024062003315	S	USDMXN	06/24/2024	(75,000,000)	18.41	1,380,750,000
2024062003476	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.32977	18,329,770
2024062003479	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.32825	18,328,250
2024062003485	S	USDMXN	06/24/2024	(697,304)	18.34329	12,790,849
2024062003623	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.28041	18,280,410
2024062003625	S	USDMXN	06/24/2024	(1,000,000)	18.28013	18,280,130
2024062003688	S	USDMXN	06/24/2024	(100,000,000)	18.275	1,827,500,000
2024032003198	B	USDMXN	06/24/2024	30,000,000	17.0332	(510,996,000)
2024041903065	B	USDMXN	06/24/2024	60,000,000	17.4305	(1,045,830,000)
2024041903067	B	USDMXN	06/24/2024	50,000,000	17.4155	(870,775,000)
2024052103207	B	USDMXN	06/24/2024	50,000,000	16.6647	(833,235,000)
2024062003092	S	USDMXN	06/24/2024	(101,000,000)	18.4256	1,860,985,600
2024062003097	S	USDMXN	06/24/2024	(987,812)	18.4261	18,201,520
2024062003356	S	USDMXN	06/24/2024	(30,000,000)	18.41	552,300,000
2024062103143	S	USDMXN	06/24/2024	(128,000,000)	18.196	2,329,088,000
2024062103174	S	USDMXN	06/24/2024	(375,140)	18.2324	6,839,701
2024062103539	B	EURUSD	06/25/2024	1,000,000	1.0692	(1,069,200)
2024062103264	S	EURUSD	06/25/2024	(1,000,000)	1.06915	1,069,150
2024062403091	BO	EURUSD	06/25/2024	1,600,000	1.07317	(1,717,075)
2024062403102	B	EURUSD	06/25/2024	1,600,000	1.07317	(1,717,075)
2023101103364	SO	USDMXN	06/25/2024	(150,110)	18.67048	2,802,624
2024021603564	BO	USDMXN	06/25/2024	100,000	17.39967	(1,739,967)
2024052203216	SO	USDMXN	06/25/2024	(221,385)	16.72107	3,701,794
2024060603620	SO	USDMXN	06/25/2024	(437,000)	17.60381	7,692,863
2024062003689	B	USDMXN	06/25/2024	100,000,000	18.27815	(1,827,815,000)
2024062103184	B	USDMXN	06/25/2024	1,000,000	18.22	(18,220,000)
2024062103192	B	USDMXN	06/25/2024	1,000,000	18.215	(18,215,000)
2024062103231	B	USDMXN	06/25/2024	1,000,000	18.21	(18,210,000)
2024062103463	B	USDMXN	06/25/2024	25,000	18.2097	(455,243)
2024062103836	B	USDMXN	06/25/2024	174,434	18.14625	(3,165,317)
2024062103094	S	USDMXN	06/25/2024	(1,000,000)	18.20151	18,201,510

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024062103097	S	USDMXN	06/25/2024	(1,000,000)	18.20064	18,200,640
2024062103133	S	USDMXN	06/25/2024	(1,000,000)	18.2004	18,200,400
2024062103490	S	USDMXN	06/25/2024	(150,000,000)	18.17	2,725,500,000
2024062103535	S	USDMXN	06/25/2024	(5,000,000)	18.18	90,900,000
2024062103650	S	USDMXN	06/25/2024	(1,000,000)	18.14963	18,149,630
2024062103675	S	USDMXN	06/25/2024	(1,000,000)	18.15112	18,151,120
2024062103690	S	USDMXN	06/25/2024	(2,000,000)	18.14487	36,289,740
2024032103672	B	USDMXN	06/25/2024	30,000,000	16.987	(509,610,000)
2024032103677	B	USDMXN	06/25/2024	30,000,000	16.987	(509,610,000)
2024032103472	S	USDMXN	06/25/2024	(50,000,000)	17.0205	851,025,000
2024032103474	S	USDMXN	06/25/2024	(30,000,000)	17.0225	510,675,000
2024032103476	S	USDMXN	06/25/2024	(30,000,000)	17.0225	510,675,000
2024032103513	S	USDMXN	06/25/2024	(30,000,000)	17.0305	510,915,000
2024062103144	B	USDMXN	06/25/2024	128,000,000	18.1993	(2,329,510,400)
2024062103175	B	USDMXN	06/25/2024	375,140	18.2358	(6,840,977)
2024062103691	S	USDMXN	06/25/2024	(25,000,000)	18.155	453,875,000
2024062403409	B	USDMXN	06/25/2024	572,899	17.94762	(10,282,165)
2024062403646	B	USDMXN	06/25/2024	31,000,000	17.942	(556,202,000)
2024043003292	B	EURUSD	06/26/2024	50,000,000	1.07004	(53,502,054)
2024043003295	B	EURUSD	06/26/2024	50,000,000	1.07013	(53,506,250)
2024062403132	B	EURUSD	06/26/2024	1,000,000	1.07321	(1,073,210)
2024062403165	B	EURUSD	06/26/2024	1,000,000	1.07283	(1,072,830)
2024062403214	S	EURUSD	06/26/2024	(1,000,000)	1.07236	1,072,360
2024062403267	S	EURUSD	06/26/2024	(1,000,000)	1.0729	1,072,900
2024062503488	S	EURUSD	06/26/2024	(100,000,000)	1.07147	107,147,140
2023070503269	BO	USDMXN	06/26/2024	150,000	18.10619	(2,715,929)
2023072803198	BO	USDMXN	06/26/2024	400,000	17.65548	(7,062,193)
2023081003147	BO	USDMXN	06/26/2024	400,000	17.92887	(7,171,548)
2023091203104	BO	USDMXN	06/26/2024	300,000	18.20649	(5,461,946)
2023091403636	B	USDMXN	06/26/2024	200,000	17.94774	(3,589,549)
2023091503076	B	USDMXN	06/26/2024	300,000	17.9267	(5,378,010)
2023091903439	B	USDMXN	06/26/2024	250,000	17.92789	(4,481,972)
2023122103108	B	USDMXN	06/26/2024	20,000,000	17.582	(351,640,000)
2024011903290	SO	USDMXN	06/26/2024	(200,000)	17.57039	3,514,077
2024031103583	B	USDMXN	06/26/2024	200,000	17.07912	(3,415,825)
2024031303483	BO	USDMXN	06/26/2024	50,000	16.96869	(848,435)
2024052203613	BO	USDMXN	06/26/2024	91,750	16.76081	(1,537,804)
2024052303832	BO	USDMXN	06/26/2024	111,700	16.81213	(1,877,914)
2024060303529	SO	USDMXN	06/26/2024	(300,000)	17.75724	5,327,172
2024060503077	SO	USDMXN	06/26/2024	(100,000)	17.59494	1,759,494
2024061303416	BO	USDMXN	06/26/2024	40,696	18.54714	(754,794)
2024061303419	BO	USDMXN	06/26/2024	62,000	18.54754	(1,149,948)
2024061303672	BO	USDMXN	06/26/2024	72,992	18.50211	(1,350,506)
2024062403212	B	USDMXN	06/26/2024	2,000,000	18.01545	(36,030,900)
2024062403265	B	USDMXN	06/26/2024	1,000,000	18.01307	(18,013,070)
2024062403272	B	USDMXN	06/26/2024	1,000,000	18.01412	(18,014,120)
2024062403427	B	USDMXN	06/26/2024	10,000,000	17.94	(179,400,000)
2024062403730	B	USDMXN	06/26/2024	1,000,000	17.97465	(17,974,650)
2024062403287	S	USDMXN	06/26/2024	(2,000,000)	17.96877	35,937,540
2024062403290	S	USDMXN	06/26/2024	(2,000,000)	17.96829	35,936,580
2024062403642	S	USDMXN	06/26/2024	(50,000,000)	17.94	897,000,000
2024062403711	S	USDMXN	06/26/2024	(1,000,000)	17.95817	17,958,170
2024062403414	B	USDMXN	06/26/2024	5,000,000	17.965	(89,825,000)
2024062403538	B	USDMXN	06/26/2024	30,000,000	17.91	(537,300,000)
2024062403410	S	USDMXN	06/26/2024	(572,899)	17.9502	10,283,643
2024062403530	S	USDMXN	06/26/2024	(30,000,000)	17.91	537,300,000
2024062403647	S	USDMXN	06/26/2024	(31,000,000)	17.9446	556,282,600
2024062503049	B	USDMXN	06/26/2024	193,289	18.09317	(3,497,207)
2024062503373	B	EURUSD	06/27/2024	1,000,000	1.07117	(1,071,170)
2024062503489	B	EURUSD	06/27/2024	100,000,000	1.07152	(107,152,000)
2024062503524	B	EURUSD	06/27/2024	1,000,000	1.07175	(1,071,750)
2024062503574	B	EURUSD	06/27/2024	1,000,000	1.07172	(1,071,720)
2024062503199	S	EURUSD	06/27/2024	(1,000,000)	1.07053	1,070,530
2024062503314	S	EURUSD	06/27/2024	(1,000,000)	1.07056	1,070,560
2024062503319	S	EURUSD	06/27/2024	(1,000,000)	1.07057	1,070,570
2024062503483	B	USDEUR	06/27/2024	25,000,000	1.07149	(23,331,996)
2024062503499	S	EURUSD	06/27/2024	(35,000,000)	1.07152	37,503,200
2024062503504	S	EURUSD	06/27/2024	(40,000,000)	1.07155	42,862,000
2024062503601	B	USDEUR	06/27/2024	1,668,004	1.07157	(1,556,599)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023100503665	SO	USDMXN	06/27/2024	(100,000)	19.093	1,909,300
2023112103771	BO	USDMXN	06/27/2024	618	17.85137	(11,025)
2024010303425	BO	USDMXN	06/27/2024	30,389	17.55049	(533,342)
2024010303539	BO	USDMXN	06/27/2024	64,498	17.55266	(1,132,111)
2024011203484	BO	USDMXN	06/27/2024	100,000	17.32426	(1,732,426)
2024012303648	S	USDMXN	06/27/2024	(50,000)	17.75943	887,971
2024052303684	BO	USDMXN	06/27/2024	414,946	16.82008	(6,979,425)
2024052803749	SO	USDMXN	06/27/2024	(255,459)	16.88015	4,312,186
2024060603621	SO	USDMXN	06/27/2024	(285,000)	17.60342	5,016,974
2024062503042	B	USDMXN	06/27/2024	50,000,000	18.04	(902,000,000)
2024062503148	B	USDMXN	06/27/2024	1,000,000	18.14132	(18,141,320)
2024062503198	B	USDMXN	06/27/2024	1,000,000	18.132	(18,132,000)
2024062503200	B	USDMXN	06/27/2024	1,000,000	18.13289	(18,132,890)
2024062503298	B	USDMXN	06/27/2024	55,075,178	18.157	(1,000,000,000)
2024062503728	B	USDMXN	06/27/2024	2,000,000	18.11801	(36,236,020)
2024062503151	S	USDMXN	06/27/2024	(1,000,000)	18.13008	18,130,080
2024062503295	S	USDMXN	06/27/2024	(2,000,000)	18.16	36,320,000
2024062503690	S	USDMXN	06/27/2024	(2,000,000)	18.14	36,280,000
2024062503693	S	USDMXN	06/27/2024	(74,997)	18.13606	1,360,153
2023111703236	B	USDMXN	06/27/2024	864,000	17.85543	(15,427,092)
2024062503354	B	USDMXN	06/27/2024	30,000,000	18.155	(544,650,000)
2024062503492	B	USDMXN	06/27/2024	150,000,000	18.13	(2,719,500,000)
2024062503620	B	USDMXN	06/27/2024	25,000,000	18.132	(453,300,000)
2024062503050	S	USDMXN	06/27/2024	(193,289)	18.0959	3,497,736
2024062503358	S	USDMXN	06/27/2024	(30,000,000)	18.155	544,650,000
2024062603029	B	USDMXN	06/27/2024	55,076,551	18.201	(1,002,448,311)
2024062603204	B	USDMXN	06/27/2024	27,813	18.23899	(507,286)
2024062603611	B	USDMXN	06/27/2024	40,000,000	18.345	(733,800,000)
2024062603047	B	EURUSD	06/28/2024	2,000,000	1.0685	(2,137,000)
2024062603052	B	EURUSD	06/28/2024	1,000,000	1.06782	(1,067,820)
2024062603094	B	EURUSD	06/28/2024	1,000,000	1.06758	(1,067,580)
2024062603025	S	EURUSD	06/28/2024	(1,000,000)	1.06868	1,068,680
2024062603045	S	EURUSD	06/28/2024	(1,000,000)	1.06939	1,069,390
2024062603116	S	EURUSD	06/28/2024	(2,000,000)	1.0685	2,137,000
2023031003674	SO	USDMXN	06/28/2024	(39,000)	20.07818	783,049
2023090503724	S	USDMXN	06/28/2024	(1,121,997)	18.37075	20,611,918
2023090703404	SO	USDMXN	06/28/2024	(39,000)	18.45785	719,856
2023100303149	SO	USDMXN	06/28/2024	(78,900)	18.71337	1,476,485
2023110303639	BO	USDMXN	06/28/2024	600,000	18.13745	(10,882,470)
2023112903797	B	USDMXN	06/28/2024	65,200	17.87608	(1,165,520)
2024011103446	BO	USDMXN	06/28/2024	63,017	17.44178	(1,099,129)
2024031303484	BO	USDMXN	06/28/2024	50,000	16.97405	(848,702)
2024032703857	BO	USDMXN	06/28/2024	500,000	16.79532	(8,397,662)
2024052403174	B	USDMXN	06/28/2024	100,000,000	16.777	(1,677,700,000)
2024052403724	B	USDMXN	06/28/2024	687,500	16.76968	(11,529,155)
2024053103433	BO	USDMXN	06/28/2024	1,375,000	17.04407	(23,435,598)
2024060703559	SO	USDMXN	06/28/2024	(284,000)	18.38155	5,220,361
2024061803114	B	USDMXN	06/28/2024	100,000,000	18.4166	(1,841,660,000)
2024061803440	B	USDMXN	06/28/2024	50,000,000	18.4622	(923,110,000)
2024062503825	B	USDMXN	06/28/2024	135,923	18.12661	(2,463,822)
2024062603022	B	USDMXN	06/28/2024	1,000,000	18.20618	(18,206,180)
2024062603024	B	USDMXN	06/28/2024	1,000,000	18.20532	(18,205,320)
2024062603050	B	USDMXN	06/28/2024	1,000,000	18.21038	(18,210,380)
2024062603140	B	USDMXN	06/28/2024	20,000,000	18.165	(363,300,000)
2024062603163	B	USDMXN	06/28/2024	30,000,000	18.165	(544,950,000)
2024062603167	B	USDMXN	06/28/2024	30,000,000	18.165	(544,950,000)
2024062603428	B	USDMXN	06/28/2024	1,000,000	18.32152	(18,321,520)
2024062603429	B	USDMXN	06/28/2024	367,541	18.3185	(6,732,800)
2024062603437	B	USDMXN	06/28/2024	332,643	18.30431	(6,088,801)
2024062603439	B	USDMXN	06/28/2024	1,000,000	18.29976	(18,299,760)
2024062603588	B	USDMXN	06/28/2024	50,000,000	18.342	(917,100,000)
2024062603700	B	USDMXN	06/28/2024	42,130	18.36269	(773,622)
2024062603042	S	USDMXN	06/28/2024	(50,000,000)	18.21	910,500,000
2024062603057	S	USDMXN	06/28/2024	(2,000,000)	18.16835	36,336,700
2024062603136	S	USDMXN	06/28/2024	(1,000,000)	18.15722	18,157,220
2024062603228	S	USDMXN	06/28/2024	(1,000,000)	18.23918	18,239,180
2024062603247	S	USDMXN	06/28/2024	(367,541)	18.245	6,705,779
2024062603272	S	USDMXN	06/28/2024	(1,000,000)	18.25	18,250,000
2024062603372	S	USDMXN	06/28/2024	(367,541)	18.27162	6,715,563

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024062603374	S	USDMXN	06/28/2024	(1,000,000)	18.27079	18,270,790
2024062603382	S	USDMXN	06/28/2024	(1,000,000)	18.28038	18,280,380
2024062803044	S	USDMXN	06/28/2024	(50,000,000)	18.32	916,000,000
2024032503373	B	USDMXN	06/28/2024	277,335,222	16.947	(4,700,000,000)
2024032503415	B	USDMXN	06/28/2024	280,285,596	16.947	(4,750,000,000)
2024032503601	S	USDMXN	06/28/2024	(30,000,000)	16.937	508,110,000
2024032503604	S	USDMXN	06/28/2024	(150,000,000)	16.937	2,540,550,000
2024052403392	S	USDMXN	06/28/2024	(100,000,000)	16.775	1,677,500,000
2024052403394	S	USDMXN	06/28/2024	(100,000,000)	16.776	1,677,600,000
2024052903147	B	USDMXN	06/28/2024	50,000,000	17.0386	(851,930,000)
2024052903688	B	USDMXN	06/28/2024	50,000,000	17.0265	(851,325,000)
2024052903039	S	USDMXN	06/28/2024	(200,000,000)	17.0127	3,402,540,000
2024062603095	B	USDMXN	06/28/2024	50,000,000	18.205	(910,250,000)
2024062603396	B	USDMXN	06/28/2024	30,000,000	18.27	(548,100,000)
2024062603048	S	USDMXN	06/28/2024	(700,000)	18.18708	12,730,956
2024062603205	S	USDMXN	06/28/2024	(27,813)	18.2409	507,339
2024062603612	S	USDMXN	06/28/2024	(40,000,000)	18.34745	733,898,000
2024062703224	B	USDMXN	06/28/2024	255,888	18.34269	(4,693,670)
2024062703621	B	USDMXN	06/28/2024	100,000,000	18.44	(1,844,000,000)
2024062703574	S	USDMXN	06/28/2024	(100,000,000)	18.44	1,844,000,000
2024062803135	S	USDMXN	06/28/2024	(70,000,000)	18.3	1,281,000,000
2024062803138	S	USDMXN	06/28/2024	(20,000,000)	18.27	365,400,000

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
E91199	17/04/2024	Unwound	42,820,000	mxn			42,820,000
E91200	17/04/2024	Unwound	42,820,000	mxn			42,820,000
E93467	03/05/2024	Unwound	18,810,000	mxn			18,810,000
E93468	03/05/2024	Unwound	18,810,000	mxn			18,810,000
E94870	03/05/2024	Unwound	38,720,000	mxn			38,720,000
E94871	03/05/2024	Unwound	38,720,000	mxn			38,720,000
E95184	03/05/2024	Unwound	30,490,000	mxn			30,490,000
E95185	03/05/2024	Unwound	30,490,000	mxn			30,490,000
SHH174	17/01/2025	Unwound	300,000	usd	300,000	300,000	
SHH175	17/01/2025	Unwound	296,403	usd	296,403	296,403	
SHH177	17/01/2025	Unwound	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SHH183	17/01/2025	Unwound	150,000	usd	150,000	150,000	
C95199	27/06/2025	Unwound		usd/mxn	1,000	18,150	
SAK055	28/07/2025	Unwound	88,000,000	mex	88,000,000	88,000,000	
MNF479	04/09/2025	Unwound		mxn	81,472,136		
SIE911	11/09/2025	Unwound	18,925,000	usd	18,925,000	18,925,000	
SIE916	11/09/2025	Unwound	5,490,000	usd	5,490,000	5,490,000	
SIE917	11/09/2025	Unwound	5,490,000	usd	5,490,000	5,490,000	
SIF179	11/09/2025	Unwound	18,925,000	usd	18,925,000	18,925,000	
SJI181	22/10/2025	Unwound	401,760,000	mxn	401,760,000	401,760,000	
P18592	08/12/2025	Unwound		mxn			10,000,000
SHR489	08/12/2025	Unwound	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SJF520	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd	54,000,000	54,000,000	
SJF521	09/04/2026	Unwound	54,000,000	usd	54,000,000	54,000,000	
C67355	02/05/2026	Unwound		usd/mxn	2,000,000	37,620,000	
C67357	02/05/2026	Unwound		mxn/usd	37,620,000	2,000,000	
C67359	02/05/2026	Unwound		mxn/usd	148,600,000	8,000,000	
C67367	02/05/2026	Unwound		usd/mxn	8,000,000	148,600,000	
C87924	02/05/2026	Unwound		usd/mxn	50,000,000	855,750,000	
C87925	02/05/2026	Unwound		mxn/usd	855,750,000	50,000,000	
P17581	28/11/2026	Unwound		mxn			250,000,000
E91961	03/12/2026	Unwound	253,605,000	mxn			253,605,000
E91962	03/12/2026	Unwound	253,605,000	mxn			253,605,000
M00276088	08/04/2027	Unwound		mxn		70,000,000	
SLB712	08/04/2027	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SLB713	08/04/2027	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SIJ144	08/03/2028	Unwound	540,833	usd	540,833	540,833	
SIJ148	08/03/2028	Unwound	540,833	usd	540,833	540,833	
SFG309	31/05/2028	Unwound	4,283,500	mxn	4,283,500	4,283,500	

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Nego	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	247,268,751,832	Compra	Divisas	Divisas	178,382,155,760	240,231,908,080	246,601,920,667	666,831,165	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	(246,981,690,525)	Venta	Divisas	Divisas	(178,057,952,405)	(240,066,870,340)	(246,303,797,963)	(677,892,562)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	825,510,000	Compra	Acción	Acción	71,266,772	42,614,992	732,390,000	93,120,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	825,510,000	Venta	Acción	Acción	(69,509,078)	(40,220,627)	732,390,000	93,120,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	13,823,158,279	Compra	Divisas	Divisas	215,520,455	557,592,388	11,392,056,965	2,431,101,315	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	13,823,158,279	Venta	Divisas	Divisas	(170,194,616)	(470,368,679)	11,492,631,065	2,330,527,215	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,159,476,700	Compra	Índice	Índice	275,699,030	255,733,356	14,626,700	4,144,850,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,869,913,400	Venta	Índice	Índice	(81,734,098)	(106,666,249)	29,253,400	1,840,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	42,023,322,080	Compra	Tasas	Tasas	729,770,154	784,754,800	1,650,000,000	35,780,573,362	4,592,748,718	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	41,857,678,166	Venta	Tasas	Tasas	(717,898,773)	(769,002,005)	1,810,000,000	35,585,705,526	4,461,972,640	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	12,020,000	Compra	Acción NE	Acción NE	387,567	312,376	-	12,020,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	12,020,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(2,145,261)	(2,706,742)	-	12,020,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	186,913,400	Compra	Índice NE	Índice NE	48,661,062	27,209,969	29,253,400	157,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,443,891,700	Venta	Índice NE	Índice NE	(242,623,643)	(176,276,639)	14,626,700	2,429,265,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,303,889,351	Compra	Divisas NE	Divisas NE	14,772,956	48,634,764	317,174,286	986,715,065	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,303,889,351	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(56,211,808)	(136,290,189)	317,174,286	986,715,065	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	6,954,170,328	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	647,637,872	175,997,608	-	5,427,373,647	1,526,796,680	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	6,477,524,001	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	321,329,503	(131,736,791)	-	3,061,655,599	3,415,868,403	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	66,861,860,575	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	1,611,153,178	2,264,235,066	580,000,000	43,583,989,606	22,697,870,969	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(107,120,000)	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	68,246,460	(104,098,722)	(107,120,000)	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	130,864,511	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	77,479,546	136,505,586	-	130,864,511	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	128,716,551,124	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD FIJA MXN	FIJA USD / LIBOR USD FIJA MXN	1,933,940,410	1,961,502,227	1,786,728,835	66,825,793,295	60,104,028,994	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	549,378,066,268	CCIRS / IRS	/TASA DE INTERES TIIE MXN	/TASA DE INTERES TIIE MXN	6,272,613,723	10,057,578,248	180,249,934,763	250,310,506,306	118,817,625,199	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	132,405,447,698	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(873,423,667)	(2,057,575,210)	1,786,728,835	67,742,362,375	62,876,356,488	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	529,444,091,668	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(7,531,118,584)	(10,180,578,829)	158,826,022,911	242,305,296,458	128,312,772,299	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2024**

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
100000000000			**A C T I V O**	869,741,168,116	775,992,842,182
100200001001			**Efectivo y equivalentes de efectivo**	47,534,164,290	70,383,884,085
100400001001			**Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)**	1,283,799,058	1,253,565,449
100600001001			**INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS**	181,246,534,820	154,218,644,731
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	72,690,997,880	69,144,825,679
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	103,536,938,753	80,254,960,641
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	5,018,598,187	4,818,858,411
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	5,019,113,713	4,819,390,717
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-515,526	-532,306
101000001001			**Deudores por reporto**	22,890,579,899	133,993,244
101200001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	0	0
101400001001			**Instrumentos financieros derivados**	52,131,034,918	41,589,059,913
	101400102001		Con fines de negociación	41,687,699,217	31,689,990,378
	101400102002		Con fines de cobertura	10,443,335,701	9,899,069,535
101600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS**	-802,806,476	-970,873,328
	101800104001		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1**	494,332,082,700	457,870,144,015
	101800105001		Créditos comerciales	232,618,084,730	230,162,395,113
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	194,790,585,232	196,994,038,020
		101800107002	Entidades financieras	17,695,572,015	15,909,069,623
		101800107003	Entidades gubernamentales	20,131,927,483	17,259,287,470
	101800105002		Créditos de consumo	40,752,915,959	32,665,300,381
	101800105003		Créditos a la vivienda	220,961,082,011	195,042,448,521
		101800507023	Media y residencial	216,328,799,148	189,897,341,902
		101800507024	De interés social	3,857,568	4,399,500
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,628,425,295	5,140,707,119
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2**	6,636,570,619	8,152,400,826
	101800205005		Créditos comerciales	1,792,601,501	4,231,971,199
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	1,792,601,501	4,231,971,199
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	1,105,417,810	702,612,969
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,738,551,308	3,217,816,658
		101800706018	Media y residencial	3,583,755,737	3,092,300,133
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	154,795,571	125,516,525
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		**Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3**	18,561,846,703	19,262,257,003
	101800305008		Créditos comerciales	6,827,816,818	9,441,678,343
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	6,771,450,358	9,385,311,883
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	56,366,460
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	1,014,513,482	857,333,568
	101800305010		Créditos a la vivienda	10,719,516,403	8,963,245,092
		101801006034	Media y residencial	10,253,660,472	8,537,355,049
		101801006035	De interés social	8,855,279	9,868,098
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	457,000,652	416,021,945
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		**Cartera de crédito valuada a valor razonable**	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2024**

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	519,530,500,022	485,284,801,844
	131800103002		Partidas diferidas	3,429,373,733	2,861,433,469
	101800103003		**ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS**	-14,252,491,450	-15,837,066,952
	131800102001		**Cartera de crédito (neto)**	508,707,382,305	472,309,168,361
	131800102002		**Derechos de cobro adquiridos (neto)**	0	0
131800001001			**Total de cartera de crédito (neto)**	508,707,382,305	472,309,168,361
102000001001			**Activos virtuales**	0	0
102200001001			**BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
132400001001			**Otras cuentas por cobrar (neto)**	34,613,231,665	16,216,301,625
132600001001			**Bienes adjudicados (neto)**	798,825,977	451,615,387
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	13,941,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,149,315,590	2,431,789,308
133400001001			**Propiedades, mobiliario y equipo (neto)**	5,298,624,711	4,790,128,252
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,419,073,683	2,611,784,539
103800001001			**INVERSIONES PERMANENTES**	334,614,379	53,847,667
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,540,646,743	5,984,583,958
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,582,205,060	4,521,407,497
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			**P A S I V O**	786,073,168,408	698,167,222,907
200200001001			**CAPTACIÓN TRADICIONAL**	568,429,294,946	508,628,767,265
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	299,048,471,360	257,432,889,717
	200200102002		Depósitos a plazo	247,408,533,935	246,956,556,012
		200200203003	Del público en general	222,126,454,978	204,186,899,869
		200200203004	Mercado de dinero	25,282,078,957	42,769,656,143
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	20,588,365,338	3,007,378,546
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,383,924,313	1,231,942,990
200400001001			**PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS**	35,278,406,980	34,690,282,483
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	22,035,442,942	20,866,541,166
	200400102003		De largo plazo	13,242,964,038	13,823,741,317
230600001001			**VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR**	11,614,566,735	2,800,651,773
200800001001			**ACREEDORES POR REPORTO**	58,639,451,060	66,751,047,708
201000001001			**PRÉSTAMO DE VALORES**	70,908	139,721
201200001001			**COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA**	2,379,324,029	4,239,329,860
	201200102001		Reportos	1,000,955,532	0
	201200102002		Préstamo de valores	1,378,368,497	4,239,329,860
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			**Instrumentos financieros derivados**	49,689,925,401	38,376,539,996
	201400102001		Con fines de negociación	41,450,215,222	30,673,334,636
	201400102002		Con fines de cobertura	8,239,710,179	7,703,205,360
201600001001			**AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS**	0	-187,289
201800001001			**OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN**	0	0
202000001001			**Pasivo por arrendamiento**	2,610,634,416	2,719,867,057
202200001001			**Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal**	0	0
202400001001			**OTRAS CUENTAS POR PAGAR**	39,627,068,641	23,151,887,629
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	27,121,909,442	11,461,563,858
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	2,087,273,295	1,659,950,161
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	4,306,993,619	3,606,077,296
	202400102004		Contribuciones por pagar	599,127,035	462,992,036
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	5,511,765,250	5,961,304,278
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: **2024**

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,056,914,921	9,054,250,281
	203000102001		**OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN**	9,056,914,921	9,054,250,281
	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**	984,880,590	610,510,644
203600001001			**Pasivo por beneficios a los empleados**	6,572,797,600	6,085,248,361
203800001001			**Créditos diferidos y cobros anticipados**	1,189,832,181	1,058,887,418
400000000000			**CAPITAL CONTABLE**	83,667,999,708	77,825,619,275
440200001001			**Participación controladora**	83,666,728,320	77,824,291,518
	400200102001		**CAPITAL CONTRIBUIDO**	13,468,335,561	13,468,335,561
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,716,852,485
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		**CAPITAL GANADO**	70,198,392,759	64,355,955,957
		400200203010	Reservas de capital	10,077,244,487	8,949,346,887
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	59,958,702,616	55,352,780,320
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	54,988,696,181	49,837,386,812
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	4,970,006,435	5,515,393,508
	400200203013		Otros resultados integrales	-7,659,286	-106,562,651
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-608,143,157	-274,604,447
		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	1,188,062,596	645,389,241
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remedición de beneficios definidos a los empleados	-587,578,725	-477,347,445
		400201304013	Incremento por actualización de la remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	7,787,648	-1,925,893
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			**PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA**	1,271,388	1,327,757
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	86,119	87,941
	440400102002		Otra participación no controladora	1,185,269	1,239,816
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			**CUENTAS DE ORDEN**	4,290,628,728,496	3,295,161,242,994
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	388,965,099,288	255,252,079,004
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	489,225,771,403	472,901,993,321
	700800102001		Fideicomisos	460,024,905,308	443,766,042,369
	700800102002		Mandatos	29,200,866,095	29,135,950,952
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	817,825,984,285	691,594,178,122
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	30,526,792,689	9,250,117,599
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,379,127,977	4,239,329,860
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,839,336,522	1,524,923,160
702000001001			Otras cuentas de registro	2,559,866,616,332	1,860,398,621,928

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **02** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2024 Y 2023

(PESOS)

Impresión Final

		TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	41,883,539,103	38,010,900,809
600400101002	Gastos por intereses	28,144,596,894	24,851,499,187
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	**MARGEN FINANCIERO**	13,738,942,209	13,159,401,622
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	2,350,207,097	431,854,571
330000000002	**MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS**	11,388,735,112	12,727,547,051
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	2,630,549,238	2,449,238,649
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	215,101,229	226,465,138
501400301007	Resultado por intermediación	1,222,791,885	1,123,199,685
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	299,481,977	490,263,211
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	8,520,253,022	8,713,526,001
330000000003	**RESULTADO DE LA OPERACIÓN**	6,806,203,961	7,850,257,457
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	131,321,878	167,795,604
330000000004	**RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD**	6,937,525,839	8,018,053,061
602400501012	Impuestos a la utilidad	1,967,433,285	2,502,571,612
330000000005	**RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS**	4,970,092,554	5,515,481,449
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	**RESULTADO NETO**	4,970,092,554	5,515,481,449
502800701014	Otros Resultados Integrales	1,788,356	-120,072,581
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-507,129,299	81,806,612
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	485,664,408	-206,599,679
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remedición de beneficios definidos a los empleados	23,253,247	4,720,486
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	9,266,202	178,180
330000000007	**RESULTADO INTEGRAL**	4,981,147,112	5,395,587,048
543200601016	**Resultado neto atribuible a:**	4,970,092,554	5,515,481,449
543201602158	Participación controladora	4,970,006,435	5,515,393,508
543201602159	Participación no controladora	86,119	87,941
543400701017	**Resultado integral atribuible a:**	4,981,147,112	5,395,587,048
543401702160	Participación controladora	4,981,147,112	5,395,587,048
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	**UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA**	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB** TRIMESTRE: **02** AÑO: **2024**

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
		Actividades de operación		
851000102001		**Resultado antes de impuestos a la utilidad**	6,937,525,839	8,018,053,061
851000102002		**Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:**	834,707,656	-1,399,420,669
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	543,297,216	528,554,049
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	430,258,388	408,466,187
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-7,295,104	24,508,936
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-131,321,878	-167,795,604
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-230,966	-2,193,154,237
	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	309,988,200	837,127,514
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	309,988,200	837,127,514
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	0
851000102004		**Cambios en partidas de operación**	-1,243,346,695	3,631,296,854
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-1,525,899,639	-14,827,663,047
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	98,767,888	954,327,933
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	3,109,434,323	-29,218,787,946
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-14,881,931,367	3,090,499,764
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-8,610,854,155	-958,450,978
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-5,243,411,531	8,516,671,299
	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)	-7,822,657,713	-798,627,377
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-213,598,814	-174,855,400
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	4,669,932,498	848,843,028
	851000403014	Cambio en captación tradicional	26,872,287,851	23,163,113,465
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-9,681,211,263	10,990,142,108
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	13,313	78,825
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-6,005,163,047	274,005,435
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	9,863,081,503	3,078,072,690
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	890,671,310	-2,664,634
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	150,191,544	152,147,434
	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	286,666,750	464,940,937
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	7,793,303,157	2,446,674,524
	851000403024	Cambio en otras provisiones	559,654,660	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,552,623,963	-4,367,171,206
851000001001		**Flujos netos de efectivo de actividades de operación**	6,838,875,000	11,087,056,760
		Actividades de inversión		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-251,036,053	-253,594,015
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	0
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	254,211,032	166,903,920
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-402,273,878	-341,990,625
	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: **2024**

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 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS) **Impresión Final**

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	**Flujos netos de efectivo de actividades de inversión**	-399,098,899	-428,680,720
		Actividades de financiamiento		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-363,437,922	-468,342,242
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-4,999,990,635	-2,849,994,662
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-1,203,324,136	-837,127,514
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	0
851000001003		**Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento**	-6,566,752,693	-4,155,464,418
	851000000000	**Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo**	-126,976,592	6,502,911,622
	851200000000	**Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo**	0	0
	851400000000	**Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo**	47,661,140,882	63,880,972,463
	100200001001	**Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo**	47,534,164,290	70,383,884,085

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remediciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversion	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
Saldo al inicio del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
Ajustes retrospectivos por cambios contables	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Ajustes retrospectivos por correcciones de errores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Saldo ajustado	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0
Total	0	0	0	0	0	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	1,127,897,600	-1,127,897,600	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	4,970,006,435	0	0	0	0	0	0	0	4,970,006,435	86,119	4,970,092,554
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-507,129,299	485,664,408	0	23,253,247	0	0	0	1,788,356	0	1,788,356
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-507,129,299	0	0	0	0	0	0	-507,129,299	0	-507,129,299
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	485,664,408	0	0	0	0	0	485,664,408	0	485,664,408
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	23,253,247	0	0	0	23,253,247	0	23,253,247
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	9,266,202	9,266,202	0	9,266,202
Total	0	0	0	0	0	4,970,006,435	-507,129,299	485,664,408	0	23,253,247	0	0	9,266,202	4,981,060,993	86,119	4,981,147,112
Saldo al final del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	10,239,561,781	59,958,702,616	-608,143,157	1,188,062,596	0	-587,578,725	0	0	7,787,648	83,666,728,320	1,271,388	83,667,999,708

Scotiabank Inverlat

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros T2 2023T3 2023T4 2023T1 2024T2 2024
ROE
(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)13.2%14.8%14.2%13.1%11.5%
ROA
(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.3%1.5%1.4%1.3%1.1%
MIN
(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)3.4%3.3%3.1%3.0%2.9%
Eficiencia Operativa
(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)2.2%2.1%2.2%2.0%2.1%
Índice de Morosidad
(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)4.0%4.0%3.3%3.4%3.6%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3
(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la
cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)82.2%79.8%77.4%76.9%76.8%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito21.94%22.60%21.47%22.01%22.44%1)
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales
(crédito, mercado y operacional)16.59%17.07%15.99%16.64%17.08%1)
Liquidez
(Activos líquidos / Pasivos líquidos)50.6%49.0%47.2%44.4%46.9%
1).Sujeto a aprobación de Banco Central

La utilidad neta al cierre del segundo trimestre alcanza $2,360 millones, una disminución de $160 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales, así como menores impuestos. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta mostró una disminución de $250 millones o 10%, debido principalmente a mayores gastos de administración y promoción; compensados parcialmente por mayores ingresos totales.
La utilidad neta acumulada al cierre de junio de 2024 se ubicó en $4,970 millones, una disminución de $545 millones o 10% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales, así como menores impuestos y gastos de administración y promoción. En el periodo el PTPP creció 11%, impulsado por mayores ingresos en el margen financiero, comisiones y tarifas (netas), así como una gestión eficiente del gasto.

3 meses6 meses
Scotiabank-Información Financiera30-jun
202331-mar
202430-jun
2024A/A
Δ%30-jun
202330-jun
2024A/A
Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)
Ingresos por intereses19,61820,840 21,043 7%38,010 41,883 10%
Gastos por intereses(13,118)(14,065)(14,079)7%(24,851)(28,144)13%
Margen Financiero6,5006,775 6,964 7%13,159 13,739 4%
Comisiones1,0241,114 1,301 27%2,223 2,415 9%
Resultado por Intermediación560756 467 -17%1,123 1,223 9%
Otros ingresos/egresos de la operación208212 87 -58%490 299 -39%
Ingresos no Financieros1,7922,082 1,855 4%3,836 3,937 3%
Total Ingresos8,2928,857 8,819 6%16,995 17,676 4%
Gastos de Administración y Promoción(4,280)(4,053)(4,467)4%(8,714)(8,520)-2%
PTPP 1).4,0124,804 4,352 8%8,281 9,156 11%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(287)(1,034)(1,316)> +100%(432)(2,350)> +100%
Resultado de la Operación3,7253,770 3,036 -18%7,849 6,806 -13%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora89(154) 285 > +100%168 131 -22%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad3,8143,616 3,321 -13%8,017 6,937 -13%
Impuestos a la Utilidad(1,294)(1,006)(961)-26%(2,502)(1,967)-21%
Resultado Neto2,5202,610 2,360 -6%5,515 4,970 -10%
Otros Resultados Integrales
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender30(254)(253)> -100%82(507)> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo(165) 125 361 > -100%(207) 486 > -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados419 4 0%5 23 > +100%
Participación en ORI de otras entidades-- 9 0%- 9 0%
Resultado Integral2,3892,500 2,481 4%5,395 4,981 -8%
1).PTPP: “Pre-Tax, Pre-Provision”, resultado antes de impuestos y reservas.

MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de $6,964 millones al cierre del segundo trimestre de 2024, un incremento de $464 millones o 7% respecto al mismo trimestre del año pasado, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria y automotriz; compensados parcialmente con mayores volúmenes en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de $189 millones o 3%; principalmente por mayores volúmenes de cartera hipotecaria y una mejora en la mezcla de depósitos.

El margen financiero acumulado al cierre de junio 2024 ascendió a $13,739 millones, un incremento de $580 millones o 4% respecto al mismo periodo de 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria y un día más de operación; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de $1,855 millones en el segundo trimestre de 2024, un incremento de $63 millones o 4% respecto al mismo periodo del año pasado, debido a mayores ingresos en comisiones por operaciones de crédito, avalúos, colocación de créditos y manejo de cuenta, así como una mayor utilidad en resultados por intermediación en el mercado cambiario; compensados parcialmente por una pérdida en resultados por intermediación en instrumentos financieros derivados y mayores quebrantos.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de $227 millones u 11%, debido a menores ingresos en resultados por intermediación, mayores gastos por quebrantos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación; compensados parcialmente por mayores ingresos por comisiones en operaciones de crédito. La variación en resultados por intermediación se debió principalmente a una pérdida en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de junio 2024 ascendió a $3,937 millones, un incremento de $101 millones o 3% respecto al año anterior. La variación se debe principalmente a mayores ingresos por comisiones en operaciones de crédito; así como a mayores ingresos en resultados por intermediación provenientes del mercado cambiario; compensado parcialmente por mayores quebrantos y aportaciones al IPAB.

3 meses6 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) 30-jun
202331-mar
202430-jun
2024A/A
Δ%30-jun
202430-jun
2024A/A
Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)
Aceptaciones por Cuenta de Terceros1- 1 0%2 1 -50%
Actividades Fiduciarias5357 57 8%113 114 1%
Apertura de Cuenta54 5 0%11 9 -18%
Cartas de Crédito6181 67 10%136 148 9%
Cheques Certificados-1 - 0%1 1 0%
Cheques de caja1- - -100%1 - -100%
Compraventa de instrumentos financieros31 1 -67%3 2 -33%
Manejo de Cuenta82106 106 29%165 212 28%
Operaciones de Crédito378395 512 35%778 907 17%
Otras Comisiones y Tarifas369297 373 1%864 670 -22%
Servicios de Banca Electrónica45149 154 > +100%96 303 > +100%
Transferencia de Fondos2623 25 -4%53 48 -9%

Total de Comisiones y Tarifas (netas)1,0241,114 1,301 27%2,223 2,415 9%

3 meses6 meses
Scotiabank-
Otros Ingresos/Egresos de la operación
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30-jun
202331-mar
202430-jun
2024A/A
Δ%30-jun
202330-jun
2024A/A
Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(23)14(5)-78%129-25%
Aportaciones al IPAB(542)(582)(603)11%(1,075)(1,185)10%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo966-33%4412-73%
Donativos--(1)0%-(1)0%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados308(13)>-100%36(5)>-100%
Ingresos por Arrendamiento191213-32%222514%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados51565916%9711519%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación7197517241%1,4811,4750%
Pérdida por venta de cartera de crédito--(2)0%-(2)0%
Quebrantos(66)(105)(159)>+100%(138)(264)91%
Recuperaciones11-3-73%113-73%
Utilidad por venta de cartera de crédito-220%-40%
Resultado por adjudicación de bienes-50630%-1130%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación20821287-58%490299-39%

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS
En el segundo trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en $1,316 millones, un incremento de $1,029 millones respecto al mismo periodo del año anterior; debido a mayores requerimientos de cartera comercial; vivienda, tarjeta de crédito, automotriz y menudeo.
Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra un incremento de $282 millones o 27%, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial, vivienda y automotriz.
La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de junio 2024 ascendió a $2,350 millones, un incremento de $1,918 millones respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias en cartera de tarjeta de crédito, comercial; así como por mayores requerimientos en cartera de vivienda, automotriz y consumo.

3 meses6 meses
Scotiabank – Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30-jun
202331-mar
202430-jun
2024A/A
Δ%30-jun
202330-jun
2024A/A
Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(287)(1,034)(1,316)> +100%(432)(2,350)> +100%

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en $4,467 millones en el segundo trimestre de 2024, un incremento de $187 millones o 4% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a mayores gastos por compensación variable, honorarios y gastos de promoción y publicidad.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, incrementaron $414 millones o 10%, debido principalmente por una mayor compensación variable.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de junio 2024 ascendieron a $8,520 millones, una disminución anual de $194 millones o 2%, debido principalmente a una menor compensación variable; parcialmente compensada por mayores honorarios, IVA, procesadores; así como gastos de promoción y publicidad.

3 meses6 meses

Scotiabank –

Gastos de Administración y Promoción

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30-jun

202331-mar

202430-jun

2024A/A

Δ%30-jun

202330-jun

2024A/A

Δ%

Gastos de Personal(2,001)(1,768)(2,097)5%(4,368)(3,865)-12%

Gastos de Operación(2,279)(2,285)(2,370)4%(4,346)(4,655)7%

Total de Gastos de Administración y Promoción(4,280)(4,053)(4,467)4%(8,714)(8,520)-2%

IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el segundo trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de $961 millones, una disminución de $333 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una menor utilidad gravable y una mayor inflación en el trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó $45 millones o 4%, principalmente por una menor utilidad gravable en el trimestre.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2024 ascendieron a $1,967 millones, una disminución anual de $535 millones o 21%, principalmente por una menor utilidad gravable y una mayor inflación del periodo.

3 meses6 meses

Scotiabank – Impuestos30-jun

202331-mar

202430-jun

2024A/A

Δ%30-jun

202330-jun

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Impuesto a la Utilidad Causado(979)(710)(1,654)69%(1,941)(2,364)22%

Impuesto a la Utilidad Diferido(315)(296)693>-100%(561)397>-100%

Total de Impuestos a la Utilidad(1,294)(1,006)(961)-26%(2,502)(1,967)-21%

BALANCE GENERAL

Al 30 de junio de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en $869,741 millones, un incremento de $93,748 millones o 12% respecto al cierre de junio de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental) y deudores por reporto.
Los activos totales incrementaron $47,615 millones o 6% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes de inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental), cartera de crédito total, mayores volúmenes en otros activos (deudores por liquidación de operaciones); así como en instrumentos financieros derivados.
El total del pasivo registró $778,074 millones al 30 de junio de 2024, un incremento de $87,906 millones o 13% respecto al cierre de junio de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (acreedores por liquidación de operaciones e instrumentos financieros derivados).
El pasivo total incrementó $45,134 millones o 6% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (acreedores por liquidación de operaciones, instrumentos financieros derivados, acreedores por reporto y valores asignados por liquidar); así como préstamos bancarios y de otros organismos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 jun
202331 mar
202430 jun
2024A/A
Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores266,608273,601 304,283 14%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2466,023492,728 500,968 7%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 319,26217,583 18,562 -4%
Partidas diferidas2,8613,303 3,429 20%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,837)(13,524)(14,252)-10%
Otros Activos37,07648,435 56,751 53%
Total Activo775,993822,126 869,741 12%
Depósitos508,629553,302 568,429 12%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos34,69033,035 35,278 2%
Obligaciones Subordinadas en Circulación9,0549,102 9,057 0%
Otros Pasivos145,795145,501 173,310 19%
Total Pasivo698,168740,940786,07413%
Capital77,82581,186 83,667 8%
Total Pasivo y Capital775,993822,126 869,741 12%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2
La cartera de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2024 alcanzó $266,557 millones, un incremento anual de $34,928 millones o 15% y de $7,693 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.
El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2024 se ubicó en $234,411 millones, un incremento anual de $17 millones y $547 millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual se debió a mayores créditos de entidades gubernamentales y financieras y el incremento trimestral se debió a mayores créditos de actividad empresarial o comercial.
Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 jun
202331 mar

202430 jun
2024A/A
Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales33,36839,526 41,858 25%
Créditos a la Vivienda198,261219,338 224,699 13%
Total Préstamos de Menudeo231,629258,864 266,557 15%
Actividad Empresarial o Comercial201,226196,171 196,584 -2%
Entidades Financieras15,90917,815 17,695 11%
Entidades Gubernamentales17,25919,878 20,132 17%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales234,394233,864 234,411 0%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2466,023492,728 500,968 7%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3
Al 30 de junio de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $18,562 millones, una disminución anual de $700 millones o 4% y un incremento trimestral de $979 millones o 6%.
Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 30 de junio de 2024 se ubicó en $14,252 millones, una disminución anual de $1,585 millones o 10% y un incremento trimestral de $728 millones o 5%.
El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 76.8% al 30 de junio de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 544pb y 14pb, respectivamente.
El índice de morosidad al 30 de junio de 2024 fue de 3.6%, una disminución de 40pb respecto del año anterior y un incremento de 12pb respecto al trimestre pasado.
Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 jun
202331 mar
202430 jun
2024A/A
Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 319,26217,583 18,562 -4%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(15,837)(13,524)(14,252)-10%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta3,4254,0594,31026%
Índice de morosidad3.97%3.45%3.6%-40 pb

DEPÓSITOS
El total de depósitos registró $568,429 millones al 30 de junio de 2024, un incremento anual de $59,800 millones o 12%, y de $15,127 millones o 3% respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral se debió principalmente a mayores depósitos de vista y ahorro y del público en general.
Scotiabank – Depósitos
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 jun
202331 mar
202430 jun
2024A/A
Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro257,433292,949 299,048 16%
Público en General204,187212,753 222,127 9%
Mercado de Dinero42,77025,168 25,282 -41%
Total Depósitos a Plazo246,957237,921 247,409 0%
Títulos de Crédito Emitidos3,00721,120 20,588 > +100%
Cuenta global de captación sin movimientos1,2321,312 1,384 12%
Total de Depósitos508,629553,302 568,429 12%

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN
Al 30 de junio de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en $9,057 millones, sin cambios significativos respecto al cierre de junio 2023 y marzo 2024.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros
(millones de pesos al 30 de junio de 2024 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	70,758	1,856	6	71	72,691
Sin restricción:	-	-	6	71	77
Restringidos:	70,758	1,856	-	-	72,614
En operaciones de reporto	57,886	1,856	-	-	59,742
Préstamos de valores	1,482	-	-	-	1,482
Otros	11,390	-	-	-	11,390
Instrumentos financieros para cobrar o vender	76,618	25,473	-	1,446	103,537
Sin restricción:	75,939	25,473	-	1,446	102,858
Restringidos:	679	-	-	-	679
En operaciones de reporto	105	-	-	-	105
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	574	-	-	-	574
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	5,018	-	-	-	5,018
Sin restricción	5,018	-	-	-	5,018
Total	152,394	27,329	61,517	181,246	

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BMORGAN_24	2755,000,000,000	11.02%	184,992	
I_BANSAN_24	27114,913,534,180	10.90%	214,909	

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados
(millones de pesos al 30 de junio de 2024 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva		
Negociación	5,363	5,199	-	-	1,572	1,316	266	370	34,487	34,565	-	-	41,688	41,450
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	10,443	8,240	-	-	10,443	8,240

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2024)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	6,598	6,911	----------									
Posición EUR	155	165	----------									
Posición CHF	----------											
Posición GBP	----------											
Posición CAD	----------											

Divisas CAD----------
Divisas USD----7171750750----
Divisas EUR------22----
Divisas MXN------7777----
Acciones MXN----1212826826----
Índices MXN----1872,4444,1591,870----
Tasa de interés
Pesos------27,20227,037558,825533,723--
Dólares------8118117,4587,620--
Euros--------8---
Pesos Colombianos--------177,500---
Con fines de cobertura
Tasa de interés
Pesos-------66,282580---
Dólares-------605764---
Euros ----------

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial144,81649,975-194,791
Créditos a entidades financieras17,058637-17,695
Créditos a entidades gubernamentales15,3564,776-20,132
Créditos al consumo40,753--40,753
Créditos a la vivienda220,921337220,961
Total438,90455,39137494,332

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial1,77914-1,793
Créditos al consumo1,105--1,105
Créditos a la vivienda3,731523,738
Total6,6151926,636

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de junio de 2024)PesosDólaresUdisTotal
Actividad empresarial o comercial5,2411,531-6,772
Créditos a entidades financieras56--56
Créditos al consumo1,014--1,014
Créditos a la vivienda10,68826610,720
Total16,9991,557618,562

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)
Saldo al 31 de marzo de 202417,583
Reestructuras75
Recuperaciones(378)
Castigos y quitas(881)
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 32,017
Fluctuación Tipo Cambio146
Saldo al 30 de junio de 202418,562

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)
Saldo al 31 de marzo de 202413,524
Más: Creación de reservas24
Calificación1,413

Menos: Adjudicaciones y otros119
Castigos y quitas762
Comercial3
Hipotecario138
Consumo621
Desliz cambiario (172)
Saldo al 30 de junio de 202414,252

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito30 jun
202331 mar
202430 jun
2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2
Metropolitano64.2%69.2%70.7%
Noroeste – Centro10.4%8.8%8.5%
Norte12.9%11.1%10.5%
Bajío7.1%6.3%5.9%
Sur5.4%4.6%4.4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3
Metropolitano53.4%58.0%58.8%
Noroeste – Centro15.9%13.8%13.6%
Norte5.8%5.7%5.5%
Bajío12.1%12.6%12.6%
Sur12.8%9.9%9.5%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Grado de Riesgo

Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias

Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas
No revolventesTarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes
Exceptuada calificada
Riesgo A1462,2459871344813331,935
Riesgo A248,9814374621617716
Riesgo B111,156129506817264
Riesgo B26,65910853748180
Riesgo B34,24239263938142
Riesgo C13,92940717852241
Riesgo C23,731143112254410
Riesgo D10,2401,235733731,5173,198
Riesgo E9,6823,6347082842,2626,888
Total560,8656,5121,2361,6884,53813,974
Exceso278
Reservas Constituidas 14,252
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 2024.
2).La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo

calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.
La institución de crédito utiliza metodología de la CNBV para créditos a cargo personas morales y físicas con actividad empresarial distintas a entidades federativas, municipios y entidades financieras, con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales mayores o iguales a 14 millones de UDIs.
Para los portafolios de créditos a cargo de empresas con ventas menores a 14 millones de UDIs, para créditos a cargo de Entidades Federativas y Municipios, créditos para proyectos de Inversión con fuente de pago propia, créditos a cargo de Entidades Financieras, así como para la cartera de crédito menudeo, se utiliza la metodología establecida por la CNBV.
Las instituciones de crédito utilizan los grados de riesgos A-1; A-2; B-1; B-2; B-3; C-1; C-2; D; y E, para efectos de agrupar las reservas preventivas de acuerdo con el tipo de cartera y el porcentaje que las reservas representen del saldo insoluto del crédito, que se establecen en la Sección Quinta "De la constitución de reservas y su clasificación por grado de riesgo", contenida en el Capítulo V del Título Segundo de las citadas disposiciones.
3).El exceso en las reservas preventivas constituidas se explica por lo siguiente:
-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida $
16
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)
40
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3 3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores 219
Total $ 278
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 2024 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:
Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)
TítulosImporteVencimiento
B4 27070111,209,6861,90701-jul-27
BV 2707016-01-jul-27
Total11,209,6921,907

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de junio de 2024)ISRPTU
Futuros castigos de crédito5,1061,201
Pagos anticipados(557)(130)
Comisiones cobradas por anticipado(292)(69)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo823185
Plan de pensiones1,093255
Provisiones y otros801140
Otros (433)12
Efecto Neto en Diferido6,5411,594

Al 30 de junio de 2024, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.
Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de junio de 2024)

VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal
Banca
MúltipleBanco de
MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos
Pesos
Inmediato - - - - - -
Mediano - - 11,867 2,185 - 14,052
Largo - - 8,500 3,954 - 12,454
Total - - 20,367 6,139 - 26,506
Tasa Promedio0.00%0.00%12.65%10.67%0.00%
Otros
Inmediato - - - - - -
Mediano 7,797 - 28 158 - 7,983
Largo - - - 789 - 789
Total 7,797 - 28 947 - 8,772
Tasa Promedio5.84%0.00%6.58%5.93%0.00%
Total Préstamos Interbancarios 7,797 - 20,395 7,086 - 35,278
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 2024.
Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la
Captación Tradicional 30 jun
202331 mar
202430 jun
2024
Depósitos a la Vista51.2%55.3%54.8%
Metropolitano24.8%29.3%29.7%
Noroeste – Centro9.1%9.3%7.8%
Norte6.9%6.8%7.3%
Bajío4.8%4.6%4.8%
Sur5.6%5.3%5.2%
Depósitos Ventanilla40.3%40.0%40.6%
Metropolitano16.3%15.1%15.4%
Noroeste – Centro4.0%4.2%4.6%
Norte7.3%8.0%8.2%
Bajío6.6%7.1%7.3%
Sur6.1%5.6%5.1%
Total de Captación del Público91.5%95.3%95.4%
Fondeo Profesional8.5%4.7%4.6%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional
Tasa Promedio
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)PesosDólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)6.33%3.27%
Depósitos a plazo10.22%0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación
(millones de pesos)30 jun
2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable(1,542)
Resultado por valuación de divisas706
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados1,120
Resultado por compraventa de divisas951
Costos de transacción(9)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos

financieros(3)
Total1,223
EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES
Al cierre de junio de 2024, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

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

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

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)
Fecha InicioFecha VencimientoISINPlazo Importe ($)Tasa (%)
18-diciembre-1405-diciembre-24MX0QSC1N00163,6402,093,000,0007.4
28-junio-1809-junio-33MX0QSC1N00245,4603,360,000,00012.3
11-septiembre-18PerpetuaMX0QSC1N0032-3,455,000,00011.3
Total de Obligaciones Subordinadas8,908,000,000

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados
A continuación, se detallan las emisiones de bonos bancarios estructurados con los que cuenta Scotiabank actualmente:
ClaveNúmero de títulosFecha de EmisiónVencimientoPlazo (días)SubyacenteMonto
99_SCOTIAB_9-213,753,20025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)375,320,000
99_SCOTIAB_10-213,719,25025-nov-2122-nov-241093Index (BNPIUIL5)371,925,000
99_SCOTIAB_1-22533,20028-feb-2225-feb-251093MSFDVTHY Index53,320,000
99_SCOTIAB_5-221,238,86015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)123,886,000
99_SCOTIAB_6-221,795,50015-jun-2213-jun-251094MSCI USA IMI (ENHAAGE5)179,550,000
99_SCOTIAB_7-22793,54016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)79,354,000
99_SCOTIAB_8-221,027,15016-jun-2213-jun-251093MSCI USA IMI (ENHAFOO5)102,715,000
99_SCOTIAB_11-225,528,25017-nov-2214-nov-251093US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 552,825,000
99_SCOTIAB_12-22457,55018-nov-2214-nov-251092US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5) 45,755,000
99_SCOTIAB_13-22104,50023-nov-2221-nov-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)

10,450,000
99_SCOTIAB_14-22803,80019-dic-2217-dic-251094US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)
75,380,000
99_SCOTIAB_1-23120,20003-mar-2303-sep-24550iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)
12,020,000
99_SCOTIAB_2-235,542,85027-jul-2327-ene-25550Dólar - Peso (USDMXN)554,285,000
99_SCOTIAB_3-23353,60031-ago-2328-feb-25547Dólar - Peso (USDMXN)35,360,000
83_SCOTIAB_4-23146,26721-nov-2315-nov-24360S&P 500 Index (SPX)14,626,700
99_SCOTIAB_5-232,536,05008-dic-2307-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)
253,605,000
99_SCOTIAB_6-231,576,60008-dic-2307-dic-261095S&P / BMV IPC (MEXBOL)157,660,000
99_SCOTIAB_7-23481,40015-dic-2314-dic-261095S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)48,140,000
83_SCOTIAB_1-241,661,85027-mar-2405-nov-24223Dólar - Peso (USDMXN)166,185,000
Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 20243,212,361,700

Criterios Contables Especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán OTIS
Mediante los oficios P-307/2023 de fecha 27 de octubre de 2023 y P-318/2023 de fecha 10 de noviembre de 2023, la Comisión emitió con carácter temporal, los criterios contables especiales (CCE) para las instituciones de crédito respecto de la cartera crediticia de consumo, vivienda y comercial, para los clientes que hayan sido afectados en las zonas indicadas por la autoridad competente en la Declaratoria de Emergencia, o bien, a las señaladas en la Declaratoria de Desastre Natural, y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 o Etapa 2 al 24 de octubre de 2023. El plazo para realizar los trámites de renovación o reestructuración finalizarán a más tardar el 30 de abril de 2024.
El programa de apoyo consiste en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses y será aplicable a los siguientes tipos de crédito y clientes:
a)Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.
b)Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
c)Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).
d)Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
e)Microcréditos individuales o grupales.
Los siguientes créditos no se consideraron como reestructuras y/o renovaciones y podrán permanecieron en la misma categoría de riesgo de crédito:
1).Créditos con “pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento”,
2).Créditos con “pagos periódicos de principal e intereses” y,
3).Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.
Los créditos que sean reestructurados o renovados al amparo de los CCE fueron reportados a las Sociedades de Información Crediticias (SIC) como sigue:
a)Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.
b)Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 2 al 24 de octubre de 2023, y que cuenten con días de atraso, presentaron la clave de observación RA en las SIC.
c)Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.
En el caso que las reestructuras o renovaciones incluyan quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados,

el Banco podrá diferir la constitución de estimaciones preventivas para riesgos crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una estimación por la diferencia en un período que no exceda de 12 meses.

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

realizado la afectación contable con motivo de la aplicación del criterio contable especial al 30 de junio de 2024.

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

Cartera comercial$ 232,618 - 232,618
Créditos de consumo 40,753 3 40,756
Créditos a la vivienda: 220,961 (13) 220,948

Etapa 1$ 494,332 (10) 494,322

Cartera comercial 1,793 - 1,793
Créditos de consumo 1,105 (8) 1,097
Créditos a la vivienda: 3,738 5 3,743

Etapa 2$ 6,636 (3) 6,633

Cartera comercial 6,828 - 6,828
Créditos de consumo 1,014 5 1,019
Créditos a la vivienda: 10,720 8 10,728

Etapa 3$ 18,562 13 18,575

Cartera de crédito$ 519,530 - 519,530
(+/-) Partidas diferidas$ 3,429 - 3,429
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios$(14,252)(5)(14,257)

Total cartera de crédito, neta$ 508,707 (5) 508,702

Total activos$ 869,741 (5) 869,736

Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)$(2,350)(5)(2,355)

Resultado neto$ 4,970 (5) 4,965

Total capital contable$ 83,667 (5) 83,662

Total pasivo y capital contable$ 869,741 (5) 869,736

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 2024)
ReferenciaCapital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservasMonto
1Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente13,468
2Resultados de ejercicios anteriores54,989
3Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)15,202
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 regulatorios83,659
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios
7Ajustes por valuación prudencialNo 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)1,917
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 razonableNo aplica
15Plan de pensiones por beneficios definidos-
16
conservadorInversiones en acciones propias-
17
conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario-
18
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)-
19
conservadorInversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -
20
conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)-
21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)449
22Monto que excede el umbral del 15%No aplica
23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financierasNo aplica
24 del cual: Derechos de servicios hipotecariosNo aplica
25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporalesNo aplica
26Ajustes regulatorios nacionales8,080
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 anticipados7,264
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 compensación816
27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deduciones-
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 110,446
29Capital común de nivel 1 (CET1)73,213
Capital adicional de nivel 1: instrumentos
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima3,582
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,582
32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicablesNo aplica
33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1-
34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)No aplica
35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradualNo aplica
36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios3,582
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios
37
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1No aplica
38
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1No aplica
39
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)No aplica
40
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitidoNo aplica
41Ajustes regulatorios nacionales-
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deduccionesNo aplica
43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1-
44Capital adicional de nivel 1 (AT1)3,582
45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)76,795
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas
46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima3,371
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

gradualNo aplica
50
conservadorReservas219
51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios3,590
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios
52
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2No aplica
53
conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2No aplica
54
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)No aplica
55
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitidoNo aplica
56Ajustes regulatorios nacionales-
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2-
58Capital de nivel 2 (T2)3,590
59Capital total (TC = T1 + T2)80,385
60Activos ponderados por riesgo totales470,684
Razones de capital y suplementos
61Capital Común de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.55%
62Capital de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.32%
63Capital Total
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)17.08%
64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)18.65%
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)8.55%
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 financierasNo aplica
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financierasNo 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) 219
77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada4,173
78Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite) -
79Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas-
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de emero de 2022)
80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradualNo 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 amortizaciones y vencimientos)-
84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual-
85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)-

Scotiabank-Notas al formato de revelación de la integración de capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios
ReferenciaDescripción
1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6
de las presentes disposiciones.
2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto
acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo,
resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediciones por beneficios definidos
a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos
representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté
representado por títulos representativos o acciones.
5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este
concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6Suma de los conceptos 1 a 5.
7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10*Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos

fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12*Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14No aplica.
15Inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos que corresponden a los recursos a los que la Institución no tiene acceso irrestricto e ilimitado. Estas inversiones se considerarán netas de los pasivos del plan y de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo que correspondan que no hayan sido aplicados en algún otro ajuste regulatorio.
16*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:
la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17*Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18*Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social

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

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

M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29Renglón 6 menos el renglón 28.
30El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social

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

50Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de

nivel 1.
55 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56Ajustes nacionales considerados:
Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57Suma de los renglones 52 a 56.
58Renglón 51, menos renglón 57.
59Renglón 45, más renglón 58.
60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.
65Reportar 2.5%
66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción
III, del Artículo 2 Bis 5.
67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68Renglón 61 menos 7%.
69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011.
72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
790.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el

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

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)
Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general
Activo
BG1Efectivo y equivalentes de efectivo46,675
BG2Cuentas de Margen1,273
BG3Inversiones en instrumentos financieros181,247
BG4Deudores por reporto22,871
BG5Préstamo de valores-
BG6Instrumentos financieros derivados52,131
BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(803)
BG8Total de cartera de crédito (neto)508,707
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización-
BG10Otras cuentas por cobrar (neto)34,296
BG11Bienes adjudicados (neto)799
BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)2,536
BG13Inversiones permanentes4,803
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta14
BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto)6,496
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)2,142
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)1,592
Activos Intangibles (neto)4,582
Pasivo
BG17Captación tradicional568,587
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos35,278
Valores Asignados por liquidar11,615
BG19Acreedores por reporto59,855
BG20Préstamo de valores-
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía2,379
BG22Instrumentos financieros derivados49,690
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros-
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización-
BG25Otras cuentas por pagar38,801
BG26Obligaciones subordinadas en circulación-
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad956
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados1,190
Pasivos por arrendamiento1,760
Instrumentos Financieros que califican como pasivo9,057
Pasivos por Beneficio a los Empleados6,527
Capital contable
BG29Capital contribuido13,468
BG30Capital ganado70,198
Cuentas de orden

BG31Avales otorgados-
BG32Activos y pasivos contingentes-
BG33Compromisos crediticios388,965
BG34Bienes en fideicomisos o mandato489,226
BG35Agente financiero del gobierno federal-
BG36Bienes en custodia o en administración80,902
BG37Colaterales recibidos por la entidad30,507
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad2,379
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)-
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 31,839
BG41Otras cuentas de registro2,559,746

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 2024)
IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
ACTIVO
1Crédito mercantil8 -
2Otros Intangibles9 -
3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales 10 1,917 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $1,917
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 449 BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) $449
13Reservas reconocidas como capital complementario50 219 BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $219
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 7,264 BG 16 Activos Intangibles $4,582 más Gastos de Instalación $2,682
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 816 BG 13 Inversiones Permanentes $ 816

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 3,582 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,582
30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental33 -
31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,371 BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $3,371
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 54,989 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $54,989
36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 1,188 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo $1,188
37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 14,014 BG 30 Reservas de Capital $10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta ($608) más Remedición por beneficios definidos a los empleados ($588) más Resultado Neto $4,970
38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R31 -
39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S46 -
40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable3, 11 -
41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -
42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A -
CUENTAS DE ORDEN
43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL
44Reservas pendientes de constituir12 -
45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C -
46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -
47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -
48Derogado

Scotiabank-Nota a los Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto
IdentificadorDescripción
1Crédito mercantil.
2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.
3Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales.
4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.
5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado.

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

19Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las

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

fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
47El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
48Derogado
Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgoImporte de posiciones equivalentesRequerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal50,9644,077
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,10688
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s2,587207
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 INPC353
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General--
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal8,377670
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio1,958157
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones242
Posiciones en Mercancía--
Requerimiento de capital por impacto Gamma--
Requerimiento de capital por impacto Vega2-
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%)494
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%)89972
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%)84467
Grupo III (ponderados al 11.5%)--
Grupo III (ponderados al 20%)3,431274
Grupo III (ponderados al 25%)6-
Grupo III (ponderados al 50%)1,403112
Grupo III (ponderados al 57.5%)--
Grupo III (ponderados al 100%)50440
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%)3,947316
Grupo V (ponderados al 10%)--
Grupo V (ponderados al 20%)20516
Grupo V (ponderados al 50%)817

Grupo V (ponderados al 115%)--
Grupo V (ponderados al 150%)94876
Grupo VI (ponderados al 20%)5,005400
Grupo VI (ponderados al 25%)3,383271
Grupo VI (ponderados al 30%)13,0261,042
Grupo VI (ponderados al 40%)12,7471,020
Grupo VI (ponderados al 50%)35,5202,842
Grupo VI (ponderados al 70%)383
Grupo VI (ponderados al 75%)29,7832,383
Grupo VI (ponderados al 85%)7,152572
Grupo VI (ponderados al 100%)43,3293,466
Grupo VI (ponderados al 120%)--
Grupo VI (ponderados al 150%)--
Grupo VI (ponderados al 172.5%)--
Grupo VII_A (ponderados al 10%)--
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)14912
Grupo VII_A (ponderados al 20%)16,1551,292
Grupo VII_A (ponderados al 23%)99079
Grupo VII_A (ponderados al 25%)--
Grupo VII_A (ponderados al 50%)7,547604
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)--
Grupo VII_A (ponderados al 100%)133,91110,713
Grupo VII_A (ponderados al 115%)--
Grupo VII_A (ponderados al 120%)69556
Grupo VII_A (ponderados al 138%)--
Grupo VII_A (ponderados al 150%)1,615129
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)--
Grupo VII_B (ponderados al 0%)--
Grupo VII_B (ponderados al 20%)--
Grupo VII_B (ponderados al 23%)--
Grupo VII_B (ponderados al 50%)--
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)--
Grupo VII_B (ponderados al 100%)--
Grupo VII_B (ponderados al 115%)--
Grupo VII_B (ponderados al 120%)--
Grupo VII_B (ponderados al 138%)--
Grupo VII_B (ponderados al 150%)--
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)--
Grupo VIII (ponderados al 115%)8,251660
Grupo VIII (ponderados al 150%)3,553284
Grupo IX (ponderados al 100%)20,6541,652
Grupo IX (ponderados al 115%)--
Grupo X (ponderados al 1250%)--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1--
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 Derivadas2,237179
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación171
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega1139

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional
Método empleadoActivos ponderados por riesgoRequerimiento de capital
Indicador de Negocio 47,4443,796
CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN
El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 17.08% al cierre de junio 2024, 242pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.66% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).
Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio
ReferenciaCaracterísticasOpciones
1EmisorScotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2Identificador ISIN, CUSIP o BloombergN.A.
3Marco legalLey de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio
4Nivel de capital con transitoriedadN.A.
5Nivel de capital sin transitoriedadFundamental
6Nivel del instrumentoInstitución de crédito sin consolidar subsidiarias
7Tipo de InstrumentoAcción series "F" y "B"
8Monto reconocido en el capital regulatorio13,468,335,561
9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos
10Clasificación contableCapital
11Fecha de emisión13-ene-01
12Plazo del instrumentoPerpetuidad
13Fecha de vencimientoSin vencimiento
14Cláusula de pago anticipadoNo
15Primera fecha de pago anticipadoN.A.
15A Eventos regulatorios o fiscalesNo
15B Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipadoN.A.
16Fechas subsecuentes de pago anticipadoN.A.
Rendimientos / dividendos
17Tipo de rendimiento / dividendoFijo o Variable
18Tasa de Interés /DividendoLa política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19Cláusula de cancelación de dividendosSujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20Discrecionalidad en el pago Parcialmente discrecional.
21Cláusula de aumento de interesesNo
22Rendimientos / dividendosNo Acumulable
23Convertibilidad del instrumentoN.A.
24Condiciones de convertibilidadN.A.
25Grado de convertibilidadN.A.
26Tasa de conversiónN.A.
27Tipo de convertibilidad del instrumentoN.A.
28Tipo de instrumento financiero de la convertibilidadN.A.
29Emisor del instrumento Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30Cláusula de disminución de valor
(Write-Down)No

31Condiciones para disminución de valorN.A.
32Grado de baja de valorN.A.
33Temporalidad de la baja de valorN.A.
34Mecanismos de disminución de valor temporalN.A.
35Posición de subordinación en caso de liquidaciónLos títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36Características de incumplimientoNO
37Descripción de características de incumplimientoNO

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

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto
(millones de pesos al 30 de junio de 2024)
Ref.RUBROJun-241)
TMar-24
T-1Dic-23
T-2Sep-23
T-3Jun-23
T-4
1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones16,76915,79216,2807,7997,585
1ªNo aplica
2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo470,684464,864471,664461,662456,829
3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)3.25%3.25%3.25%1.63%1.63%
3aNo aplica

4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones894,365842,238868,289831,882809,032
5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)1.88%1.88%1.88%0.94%0.94%
5aNo aplica
6aComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo
6bComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNoNo
6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?0%0%0%0%0%
1).El Banco al considerarse una institución de Importancia Sistémica Local debe de constituir el suplemento al capital neto en un plazo de cuatro años:

Scotiabank - Composición del Suplemento al Capital Neto

ReferenciaElementos de capital regulatorio de Suplemento al Capital Neto y ajustesMonto
1Capital Fundamental 73,213
2Capital Básico No Fundamental antes de los ajustes al Suplemento al Capital Neto 3,582
3Capital Básico No Fundamental no elegible, como Suplemento al Capital Neto, emitido por la institución en tenencia de terceros -
4Otros ajustes -
5Instrumentos elegibles de Capital Básico No Fundamental para el Suplemento al Capital Neto 3,582
6Capital Complementario, antes de los ajustes de Suplemento al Capital Neto 3,590
7Porción amortizada de instrumentos de capital complementario, donde el vencimiento remanente > 1 año -
8Capital complementario no elegible, como Suplemento al Capital Neto emitido por la institución en tenencia de terceros -
9Otros ajustes -
10Instrumentos elegibles de Capital Complementario, de acuerdo a las reglas para el Suplemento para Absorción de Pérdidas Totales 3,590
11Suplemento al Capital Neto surgido de capital regulatorio 80,385
Elementos de Suplemento al Capital Neto de capital no regulatorio
12Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco y subordinados a pasivos excluidos -
13Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos directamente por el banco los cuales no son subordinados a pasivos excluidos, pero que cumplen on todos los demás requisitos de la hoja de términos de Suplemento al Capital Neto -
14Del cual: Monto elegible de Suplemento al Capital Neto, después de aplicar los límites superiores. No aplica
15Instrumentos externos de Suplemento al Capital Neto emitidos por vehículos de financiación, antes del 1 de enero de 2022 No aplica
16Compromisos ex ante elegibles para recapitalizar a una Institución de importancia

sistémica local en resolución No aplica
17Suplemento al Capital Neto surgido de instrumentos de capital no regulatorio antes de ajustes -
Elementos de capital no regulatorio de Suplemento al Capital Neto: ajustes
18Suplemento al Capital Neto antes de deducciones 80,385
19Deducciones 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
20Deducciones de inversiones en otros pasivos elegibles de Suplemento al Capital Neto -
21Otros ajustes al Suplemento al Capital Neto -
22Suplemento al Capital Neto después de deducciones 80,385
Activos ponderados por riesgos (APR) y medida de exposición de apalancamiento para efectos
de Suplemento al Capital Neto
23Activos 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 470,684
24Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones894,365
Indicadores Suplemento al Capital Neto y suplementos
25Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)17.08%
26Suplemento al Capital Neto (como un porcentaje de APSRT ajustados como es permitido bajo el régimen de Suplemento al Capital Neto)8.99%
27Capital Fundamental (como un porcentaje de APSRT) disponible después de reunir el capital mínimo y los requerimientos de Suplementos al Capital Neto15.55%
28Requerimientos 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)4.16%
29Del cual: Requerimiento por suplemento de conservación de capital0.60%
30Del cual: Requerimiento por suplemento de capital contracíclico específico de banco 0.00%
31Del cual: Requerimiento por suplemento al capital neto3.56%

Scotiabank- Composición del Suplemento al Capital Neto
ReferenciaDescripción
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
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).
20Deducciones 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.
22El 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-O 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.
26Indicador 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.
29El monto en la línea 28 (expresado como porcentaje de APSRT) que se relacionan al suplemento por conservación de capital), de acuerdo con el 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 especifico 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 Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de $870,000,000.00 (Ochocientos setenta millones de pesos 00/100) M.N., suscrito y pagado en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por la cantidad de $8,053,500,000.00 (ocho mil cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.
Asimismo, mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 28 de julio del 2017 Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de $800,000,000.00 (Ochocientos millones de pesos 00/100, M.N.), suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por una cantidad igual a $8,853,500,000.00 (ocho mil ochocientos cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.
Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 29 de junio del 2018 Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad $150,000,000.00 (Ciento cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual queda un capital social suscrito y pagado por la cantidad de $9,003’500,000.00 (Nueve mil tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.
Mediante Asamblea General Extraordinaria de Accionistas de fecha 22 de noviembre del 2018 Scotiabank Inverlat Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad $150,000,000.00 (Ciento cincuenta millones de pesos 00/100) M.N., suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual queda un capital social suscrito y pagado por la cantidad de $9,153’500,000.00 (Nueve mil ciento cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.
Al 30 de junio de 2021, mediante asamblea extraordinaria de accionistas se aprobó como consecuencia de la fusión llevar a cabo un aumento en el capital social del Banco por

la cantidad de 53,523,304 acciones correspondientes a la serie "F"con valor nominal de un peso cada una, y el remanente del capital contable de SECOSA que excede a los valores nominales de las acciones que serán emitidas, es decir, la cantidad de $644, fue reconocido en un rubro denominado prima en emisión de acciones, y que respecto de esta partida, los accionistas de SECOSA no tendrán derecho preferencial, ya que todos los accionistas de la Sociedad, participan de ese importe en proporción a sus respectivos porcentajes de participación.

SCOTIABANK INVERLAT / ADMINISTRACIÓN INTEGRAL DE RIESGOS

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo de mercado

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

Las posiciones de riesgo del Banco incluyen instrumentos de mercado de dinero de tasa

fija y flotante, acciones, posiciones cambiarias y derivados tales como futuros de tasas de interés, contratos adelantados, opciones de divisas, swaps de tasas de interés, opciones de tasas de interés y swaps de moneda extranjera. Se tienen límites establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de junio de 2024 fue de $14.15 millones y su promedio durante el segundo trimestre de 2024 fue de $15.92 millones mismo que corresponde a un 0.019% del capital neto ($82,889 millones a mayo 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)Cierre
Junio 2024Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés
Derivados1,268,4831,219,886
Mercado de Dinero 59,03261,578
Tipo de cambio
Cash9,3145,703
Derivados295,607286,272
Capitales
Derivados7,9489,836

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre
Junio 2024Promedio
Factor de Riesgo
Tasas de interés14.2415.73
Tipo de cambio0.792.40
Capitales--
VaR Global14.1515.92

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 2024 muestra una pérdida máxima de $512.73 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 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de junio 2024 así como el promedio del segundo trimestre de 2024 se muestra a continuación:

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US70,77279,257
Liquidity Buffer
(bajo métrica CCL)149,058137,367

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 2024 de 157.59% y 115.64% respectivamente.

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

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

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

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

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

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Valor Económico (+100 pbs) (2,791)(2,448)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)(95)(144)

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 del cálculo de VaR.

Scotiabank
(millones de pesos)Posición
(Cierre)Posición
(Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender1).94,17293,678
Derivados de Cobertura86,94587,967
1).Incluye operaciones de venta en directo y en reporto.

BAJA DE CALIFICACIÓN

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto

de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de junio 2024 y el promedio del segundo trimestre del 2024 fueron $3,599 millones y $3,715 millones, respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que

permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y estimar sus reservas conforme a los modelos regulatorios de CNBV.
Se utilizan las siguientes Agencias Calificadoras en el método estándar: S&P, MOODY´S, FITCH, HR RATINGS, A.M. Best y DBRS, con base al Anexo 1-B de la CNBV "Mapeo de Calificaciones y Grados de Riesgo".
La calificación de agencias calificadoras es utilizada por el Banco para el cálculo de la Probabilidad de Incumplimiento en:
•Estados y Municipios.
•Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.
•Clientes con domicilio en el extranjero y que no cuenten con información de experiencia de pago dentro de las Sociedades de Información Crediticia nacionales, que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.
Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los deudores y su clasificación, en apego a la CUB (metodología estándar). Se exceptúa de calificar a la cartera garantizada o a cargo del Gobierno Federal, del Banco de México y del Instituto para la Protección al Ahorro Bancario, de acuerdo con las Reglas para la calificación de la Cartera Crediticia de las Instituciones de Banca Múltiple.
Proceso de administración y reconocimiento de la cobertura para el riesgo de crédito.
El Banco tiene implementadas políticas para la evaluación de las garantías, mismas que implican la revisión de cada uno de los elementos y riesgos relacionados dependiendo de su tipo, considerando tanto las políticas para garantías, como las correspondientes al análisis y evaluación de crédito. El Banco aplica controles en la evaluación de los garantes / obligados identificando el detalle de la estructura corporativa, así como cualquier aspecto de subordinación significativa que afecte el respaldo otorgado.
La calificación de crédito del garante u obligado se determina de forma continua y consistente durante la vigencia del crédito.
Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre corresponde a $11 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 2024, el Banco mantiene $212 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.
INFORMACIÓN METODOLÓGICA
La medición y el monitoreo del riesgo de crédito se basa en un modelo de pérdida esperada y pérdida no esperada, cuyo cálculo es realizado en una herramienta especializada interna, robusta y de uso institucional.
•La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los

próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

•La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias. Adicionalmente, se realizan pruebas bajo condiciones extremas para determinar su impacto sobre la pérdida esperada y no esperada del portafolio.

Métricas Riesgo de Crédito1).

(Cifras al 30 de junio 2024)Pérdida EsperadaPérdida no Esperada

Hipotecas0.28%2.83%

Consumo3.88%15.64%

Cartera Comercial0.58%4.04%

Total0.71%4.44%

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

Parámetros de Riesgo1).

(Cifras a millones al 30 de junio 2024)EI2).PISP

Hipotecas224,7001.57%16.95%

Consumo60,0484.81%72.22%

Cartera Comercial283,6391.71%43.48%

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

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

TÉCNICAS DE MITIGACIÓN DE RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO

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

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

•La garantía esté otorgada y constituida en la forma y términos establecidos en las disposiciones legales aplicables y las políticas internas del Banco.

•Cuando un crédito esté cubierto por garantías del tipo real y personal; y están otorgadas simultáneamente por el mismo garante personal, sólo una de ellas puede mejorar la calificación.

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

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS
Constantemente se evalúa la situación financiera de cada cliente, emisor y contraparte y al menos una vez al año se realiza una revisión exhaustiva y análisis del riesgo. Estas revisiones consideran el riesgo de crédito global, incluyendo operaciones con instrumentos financieros, derivados y cambios.
Al cierre de junio 2024 y en promedio durante el segundo trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.39% y 0.39% respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS
Adicionalmente a las medidas de riesgo mencionadas anteriormente y para operaciones con derivados, el Banco cuantifica sus exposiciones de crédito con la finalidad de controlar el uso de líneas otorgadas a sus contrapartes para la operación de instrumentos derivados. Este control es llevado a cabo mediante el cálculo de la exposición potencial futura (PFE) a nivel contraparte a través de herramientas especializadas, incorporando elementos mitigantes de riesgo tales como acuerdos de compensación, contratos de garantías y colaterales. Se cuenta con políticas de riesgo de contraparte y de monitoreo de límites establecidas que contemplan el proceso a seguir en caso de presentarse excesos en los mismos.
METODOLOGÍA PARA ESTABLECIMIENTO DE LÍMITES DE CRÉDITO PARA CONTRAPARTES Y ASIGNACIÓN DE CAPITAL
El Banco, mediante el establecimiento de políticas de operación, define la asignación de capital con base en criterios de negocio y apetito de riesgo, es decir, a través de políticas y una evaluación de crédito se definen los criterios de elegibilidad de clientes y el establecimiento de límites máximos de exposición considerando como principal parámetro de riesgo la exposición potencial futura de cada contraparte, estimada de acuerdo con la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.
Es importante destacar que previo a cualquier operación que implique riesgo de crédito, se tiene un proceso de revisión de los acreditados/contrapartes para evaluar su perfil de riesgo y definir el límite de exposición aceptado con cada uno.
Una vez aprobados los límites, son monitoreados por la UAIR y revisados de manera anual por el área de Crédito o con mayor frecuencia en caso de que se detecte algún riesgo potencial o bien la línea de negocio así lo solicite.
El requerimiento de capital para operaciones con derivados se calcula bajo metodología regulatoria, tal es el caso del valor ajustado por valuación crediticia o CVA por sus siglas en inglés.
Asimismo, se cuenta con lineamientos de BNS para identificar el riesgo de correlación adversa durante el proceso de autorización de crédito para operaciones con contrapartes.
RIESGO OPERACIONAL
El riesgo operacional es un riesgo no discrecional que se define como la pérdida potencial por fallas o deficiencias en los controles internos, por errores en el procesamiento y almacenamiento de las operaciones o en la transmisión de información, así como por resoluciones administrativas y judiciales adversas, fraudes o robos, eventos externos, y comprende, entre otros, al riesgo tecnológico y al riesgo legal.
METODOLOGÍA GENERAL
El Banco ha implementado políticas y procedimientos que le permiten tener un adecuado proceso de gestión del riesgo operacional, mismos que a continuación se detallan.
POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL
Tienen como propósito establecer los principios y el marco de gestión, para identificar, medir, monitorear, limitar, controlar, divulgar y gestionar los riesgos operacionales inherentes a sus actividades diarias, además de promover una cultura de administración de riesgos en todo el Banco.
EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL
El Banco cuenta con una metodología estructurada de evaluación de riesgo operacional,

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

MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL

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

NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL

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

INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)

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

RIESGO LEGAL

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

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de abril - junio 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $116.1 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $45.6 millones, donde $3.7 millones corresponden al Riesgo Operacional y $41.9 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO

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

Para gestionar el Riesgo Tecnológico, el Banco cuenta con el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos 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 2024 – junio 2024 (T2 2024)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T2 2024		Calculo Consolidado T2 2024	
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOSCOMPUTABLES				
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	143,115.48	No aplica	143,115.48
SALIDAS DE EFECTIVO				
2	Financiamiento minorista no garantizado	164,832	13,301	164,832	13,301
3	Financiamiento estable	96,583	6,476	96,583	6,476
4	Financiamiento menos estable	68,249	6,825	68,249	6,825
5	Financiamiento mayorista no garantizado	286,708	101,530	286,708	101,530
6	Depósitos operacionales	158,680	38,883	158,680	38,883
7	Depósitos no operacionales	124,545	59,164	124,545	59,164
8	Deuda no garantizada	3,483	3,483	3,483	3,483
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500	No aplica	500
10	Requerimientos adicionales:	261,201	19,068	261,201	19,068
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,254	5,959	7,254	5,959
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	253,947	13,109	253,947	13,109
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	40	40	40	40
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,857	2,857	2,857	2,857
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	137,296	No aplica	137,296
ENTRADAS DE EFECTIVO				
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	11,480	555	11,480	555
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,354	28,145	45,354	28,581
19	Otras entradas de efectivo	16,763	16,763	16,763	16,763
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	73,598	45,899	73,598	45,899
	Importe ajustado				
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	143,115	No aplica	143,115
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	91,397	No aplica	91,397
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]	No aplica	157.59	No aplica	157.59

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 2024, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):
Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $74,452 millones y depósitos a plazo tradicionales por $35,641 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,904 millones y $3,599 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $13,661 millones.
Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de $25,384 millones y por operaciones de call money de $3,440 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $19,901 millones.

Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de $151,687 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $106,455 millones en títulos de deuda de nivel 1, $34,310 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 $7,764 millones y $3,159 millones en títulos de nivel 2.
c) Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte;
Promedio del primer trimestre 2024: 152% – promedio del segundo trimestre 2024: 158%
El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 600 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:
•En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron $358 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN $5,091 millones.
•Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de $22,527 millones.
•Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en $11,535 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en $8,616, millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ;
Evolución de Activos Líquidos T2-2024AbrilMayoJunio
Efectivo 6%5%5%
Reservas en el Banco Central29%32%23%
Nivel 163%60%70%
Nivel 2ª2%2%2%
Nivel 2B0%0%0%
Total de Activos Líquidos Ponderados100%100%100%

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;
Concentración de fuentes de FinanciamientoAbrilMayoJunio
CAPTACION TRADICIONAL
Depósitos de exigibilidad inmediata48%49%50%
Depósitos a plazo
Del público en general39%38%37%
Mercado de dinero4%4%4%
Títulos de crédito emitidos4%3%3%
Cuenta global de captación sin movimientos0%0%0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS
De exigibilidad inmediata0%0%0%
De corto plazo3%4%4%
De largo plazo2%2%2%
Total100%100%100%

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

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

•Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
•Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.
Los derivados operados podrán ser clasificados como de negociación, cobertura o arbitraje.
El Banco cuenta con políticas y manuales, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y a la administración de derivados. Entre los procedimientos aplicables para el monitoreo y mitigación de los riesgos asociados a los derivados se calcula la exposición potencial futura, se monitorean el colateral asociado, posibles llamadas de margen y como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en calificación del Banco se calcula periódicamente el impacto potencial en aumento en colaterales.
Exposición Potencial Futura (junio 2024)
(Cifras en millones de pesos)
Con contrato de compensación3,412
Sin contrato de compensación9,103
Posibles llamadas de margen (junio 2024)
Colateral en Tránsito73
Downgrade (junio 2024)
Baja calificación 3 niveles3, 599

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de junio 2024 es la siguiente:
Scotiabank-Exposición en Derivados
(cifras en millones de pesos)Posición Cierre
Factor de Riesgo
Tasas de interés 1,268,483
Tipo de cambio 295,607
Capitales 7,948
Total1,572,038
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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 5% al cierre de junio del 2024 y en promedio durante segundo trimestre del 2024 fue de 7%.
Asimismo, las Instituciones deberán como mínimo revelar la información que corresponda al trimestre inmediato anterior que al que se revele, conforme a lo siguiente:

I. Información cuantitativa:
a)Los límites de concentración respecto de los distintos grupos de garantías recibidas y las fuentes principales de financiamiento;
Dentro de las políticas aprobadas por la institución en términos de liquidez, se encuentra establecido que la institución tendrá una baja dependencia del mercado mayorista, así como, mantener diversificadas las fuentes de fondeo y una baja concentración de recursos en depositantes específicos. Esta diversificación, no solo se realiza por fuentes de fondeo, sino por plazos y variedad de productos.
En adición, también se establece la calidad crediticia mínima de las garantías recibidas. Estas garantías no podrán ser inferiores a una calificación de crédito nivel A.
Adicionalmente, la institución establece límites de concentración de depósitos con la finalidad de asegurar la diversificación de sus fuentes de fondeo entre sus monedas relevantes.
Concentración de Depósitos Límite MM
Concepto
Concentración de Depósitos (MXN)9,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)175 USD
Por otro lado, la institución monitorea el potencial future exposure (PFE) a nivel contraparte para la operación de instrumentos financieros derivados y por otro lado cuenta con límites de crédito para monitorear la exposición al riesgo de crédito de contraparte.
La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento son monitoreadas teniendo en cuenta posibles limitaciones legales, regulatorias y operacionales; para esto el Banco asume una política prudente de riesgos de manejo de liquidez; adicionalmente se han establecido límites internos de brechas de liquidez y activos líquidos. Los descalces de liquidez se muestran en el siguiente inciso.
Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.
Actualmente el cálculo del CCL incorpora posiciones de la entidad legal banco y sus subsidiarias.
b)La exposición al riesgo liquidez y las necesidades de financiamiento a nivel de la Institución, teniendo en cuenta las limitaciones legales, regulatorias y operacionales a la transferibilidad de liquidez.
Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales

cuentan con las siguientes exposiciones a finales de junio 2024.

Descripción	Promedio T2 2024	Junio 2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	55,961	45,915
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	84,285	71,088
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	42
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	41	41
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	42
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	41	41

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 2024 y el promedio del segundo trimestre de 2024 son:

Scotiabank	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	70,772	79,257
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	149,058	137,367

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

II. Información cualitativa

a)La manera en la que se gestiona el riesgo de liquidez en la Institución, considerando para tal efecto la tolerancia a dicho riesgo; la estructura y responsabilidades para la administración del riesgo de liquidez; los informes de liquidez internos; la estrategia de riesgo de liquidez y las políticas y prácticas a través de las líneas de negocio y con el consejo de administración;
Uno de los principales objetivos de Scotiabank es la generación de valor para sus accionistas manteniendo la estabilidad y solvencia de la organización.
Los principios del proceso de Administración de Riesgo de Liquidez son:
•Asegurar un gobierno y supervisión del Riesgo de liquidez, incluyendo lineamientos claros de roles y responsabilidades para asegurar que el monitoreo, valuación, contabilización, medición de riesgo, y procesos de gestión de riesgo, sean conducidos y reportados independientemente.
•Identificar, medir y administrar la relación riesgo/rendimiento, dentro de los límites de tolerancia y apetito al riesgo establecidos por el Consejo de Administración, asegurando que estas actividades se realicen de manera prudente.

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

estructural de la institución.
En secciones posteriores se enuncian los informes internos de liquidez, así como las políticas puestas en marcha que tienen como finalidad la Administración Integral del Riesgo de Liquidez.
b)La estrategia de financiamiento, incluyendo las políticas de diversificación, y si la estrategia de financiamiento es centralizada o descentralizada;
La estrategia de fondeo es determinada por Tesorería Grupo de la institución, pero consensada y autorizada por el Comité de Activos y Pasivos. Donde participan diversas áreas del banco incluyendo áreas de negocio.
c)Las técnicas de mitigación del riesgo de liquidez utilizadas por la Institución;
La institución monitorea el riesgo de liquidez a través de distintas métricas e informes alineados con el apetito del riesgo las cuales contemplan:
•Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)
•Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)
•Cómputo de Activos Líquidos
•Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)
•Monitoreo de la concentración de fondeo profesional
•Monitoreo de Brechas de Liquidez
•Monitoreo de Concentración de Depósitos
•Monitoreo de Depósitos con Bancos
•Monitoreo del Portafolio de Inversión
•Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo
•Pruebas de Estrés de Liquidez
•Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez
•Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución
•Reportes periódicos al Comité de Riesgos
•Reportes al Consejo de Administración
•Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez
•Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez

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

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

El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.
d)Una explicación de cómo se utilizan las pruebas de estrés; y
De acuerdo con la norma vigente estipulada en el anexo 12-B de la Circular Única para Bancos, que requiere la realización de ejercicios de liquidez en escenarios de estrés, el banco realiza pruebas de forma periódica esto con la finalidad de cerciorarse de su

capacidad para afrontar escenarios adversos y ser capaz de honrar sus obligaciones de corto plazo basados en un horizonte de supervivencia de 30 días.
Estos escenarios de estrés contemplan entre otros, los siguientes supuestos:
•Aumento en la pérdida esperada de las carteras de crédito
•Aumento en retiro de los depósitos
•Disposición de líneas de crédito
•Aumento en las obligaciones del Banco por degradación de la calificación de la institución.
•Salida de los principales depositantes del Banco
•Pérdida de Valor de Mercado de los Activos Líquidos de la Institución
Las pruebas de estrés de liquidez de la institución contemplan distintos escenarios (i.e. idiosincrático, sistémico y combinado) con 3 niveles de severidad cada uno. Los resultados de las pruebas de estrés son presentados de manera periódica a los órganos colegiados de la institución.
Los escenarios de estrés indican una visión sobre las brechas de liquidez, los activos líquidos y el horizonte de supervivencia de la institución, esta información es fundamental para la toma de decisiones con el fin de mantener una posición sólida en torno a activos líquidos, así como sus obligaciones a corto plazo en escenarios adversos. Es relevante apuntar que la institución cuenta con el Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez el cual incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.
e)Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.
Periódicamente, el Grupo Financiero Scotiabank Inverlat revisa todos los aspectos de liquidez para la administración de los riesgos potenciales. El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez es un componente integral de dicha revisión y proporciona un marco de referencia para determinar las acciones a realizar en evento de crisis y poder reestablecer la situación financiera del Grupo.
Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:
•Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
•Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
•Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
•Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
•Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
•Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.
•En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de estás: (i) operaciones de crédito simple garantizado con depósitos de regulación monetaria o depósitos en dólares que el Grupo Financiero mantenga en el Banco de México, o (ii) reportos sobre títulos elegibles. Dicho financiamiento está sujeto al procedimiento que señala la circular 10/2015 de Banxico.
•Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el segundo trimestre de 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del segundo trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: segundo trimestre del 2024

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos)Cifras IndividualesCifras Consolidadas
Importe sin ponderar por plazo residualImporte ponderadoImporte sin ponderar por plazo residualImporte ponderado
Sin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 añoSin vencimiento< 6 mesesDe 6 meses a < 1 año>1 año
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE
1Capital:86,482.770.000.000.0086,482.7786,482.770.000.000.0086,482.77
2Capital fundamental y capital básico no fundamental.86,482.770.000.000.0086,482.77
86,482.770.000.000.0086,482.77
3Otros instrumentos de capital.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
4Depósitos minoristas:0.00206,122.712,168.728.10192,035.250.00206,122.712,168.728.10
192,035.25
5Depósitos estables.0.0090,471.58825.585.7286,738.020.0090,471.58825.585.7286,738.02
6Depósitos menos estables.0.00115,651.131,343.142.39105,297.230.00115,651.131,343.14
2.39105,297.23
7Financiamiento mayorista:0.00383,818.1630,652.5032,036.32193,294.370.00383,818.16
30,652.5032,036.32193,294.37
8Depósitos operacionales.0.0040,300.180.000.0020,150.090.0040,300.180.000.0020,150.09
9Otro financiamiento mayorista.0.00343,517.9830,652.5032,036.32173,144.280.00343,517.98
30,652.5032,036.32173,144.28
10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
11Otros pasivos: 0.0045,866.442,103.765,673.086,724.960.0045,866.442,103.765,673.08
6,724.96
12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto0.00
0.000.000.000.000.000.000.000.00
13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.00
45,866.442,103.765,673.086,724.960.0045,866.442,103.765,673.086,724.96
14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible86,482.77635,807.3234,924.98
37,717.51478,537.3586,482.77635,807.3234,924.9837,717.51478,537.35

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO
15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica8,048.82No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica8,048.82
16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.00
0.000.000.000.000.000.000.00
17Préstamos al corriente y valores:0.00128,796.6539,871.54295,807.59354,229.290.00
128,796.6539,871.54295,807.59354,229.29
18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.0.008,328.470.000.00832.850.008,328.470.000.00832.85
19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.0.009,340.684,619.804,691.868,402.860.009,340.684,619.80
4,691.868,402.86
20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:0.0091,638.7832,103.93129,726.08166,313.480.0091,638.78
32,103.93129,726.08166,313.48
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.003,934.864,182.54240,868.41
168,347.190.003,934.864,182.54240,868.41168,347.19
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.0.001,013.101,101.4181,850.6354,260.160.00

1,013.101,101.4181,850.6354,260.16
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).0.0016,566.9666.692,371.8710,332.910.0016,566.9666.692,371.8710,332.91
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.00
26Otros Activos:0.0061,828.063,781.158,112.0738,769.560.0061,828.063,781.158,112.0738,769.56
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 Aplica1,228.090.000.001,043.88No Aplica1,228.090.000.001,043.88
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No Aplica0.000.000.003,574.55No Aplica0.000.000.003,574.55
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.001,119.58No Aplica0.000.000.001,119.58
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 60,599.973,781.158,112.0733,031.550.0060,599.973,781.158,112.0733,031.55
32Operaciones fuera de balance.No Aplica255,393.970.000.0012,769.70No Aplica255,393.970.000.0012,769.70
33Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica413,817.37No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica413,817.37
34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica115.64No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica115.64
a)Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto y la evolución de sus principales componentes.
Durante junio 2024, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:
•Fondeo Estable Disponible:
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $193,079 millones y depósitos a plazo tradicionales por $146,023 millones, Capital (fundamental y complementario) por $91,664 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $19,583 millones y $25,011 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $3,430 millones.
•Fondeo Estable Requerido:
Fondeo Requerido ponderado por carteras de $351,462 millones y por operaciones mercado de dinero de $22,860 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $16,037 millones, deducciones de capital por $10,499 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $4,343 millones.
b)Los cambios de las principales componentes dentro del trimestre que se reporte.
Promedio del primer trimestre del 2024: 112.65% – Promedio del segundo trimestre del 2024: 115.64%
El coeficiente de financiamiento neto incrementó 299pb respecto al primer trimestre del 2024, esto debido principalmente a:
a.El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 11,429 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 490 millones.
b.El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron $5,415 millones.
c)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 Disponible475,699478,925480,988
Financiamiento Estable Requerido412,170413,598415,684
Coeficiente de Fondeo Estable Neto115.41%115.79%115.71%
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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $6.06 millones de pesos, con una plusvalía de $0.55 millones de pesos.

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/ Minusvalía
ScotiabankPública1A_BABA_N 1,500 1.97 1.93 0.04
ScotiabankPública1I_MCHI_* 2,698 2.07 1.74 0.33
ScotiabankPública1I_SHV_* 1,000 2.02 1.84 0.18
Total 5,198.00 6.06 5.51 0.55

Al cierre del segundo trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $1.35 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:
InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosUtilidadPérdidaUtilidad/ Pérdida
ScotiabankPública1_AMX_B 177,084 0.04 (0.04) -
ScotiabankPública1_LASITE_B-1 62,776 - - -
ScotiabankPública1_NEMAK_A 329,166 0.01 (0.01) -
ScotiabankPública1A_BABA_N 504 - (0.01)(0.01)
ScotiabankPública1E_FRES_* 2,988 0.04 - 0.04
ScotiabankPública1I_MCHI_* 4,000 - (0.23)(0.23)
ScotiabankPública1I_PSQ_* 4,400 0.10 - 0.10
ScotiabankPública1_PE&OLES_* 32,526 0.08 (0.04) 0.04
ScotiabankPública1I_EWZ_* 500 - - -
ScotiabankPública1_CUERVO_* 17,940 - - -
ScotiabankPública1I_SHV_* 444 - - -
ScotiabankPública1_AMX_B 170,000 0.22 - 0.22
ScotiabankPública1_LASITE_B-1 5,512 - - -
ScotiabankPública1_NEMAK_A 320,720 0.06 - 0.06
ScotiabankPública1A_BABA_N 1,530 0.29 - 0.29
ScotiabankPública1I_MCHI_* 525 0.05 - 0.05
ScotiabankPública1I_EWZ_* 500 - - -
ScotiabankPública1_CUERVO_* 30,000 0.07 - 0.07
ScotiabankPública1_ARA_* 17,944 - - -
ScotiabankPública1I_IB01_N 90 0.01 - 0.01
ScotiabankPública1A_BABA_N 470 0.07 - 0.07
ScotiabankPública1I_MCHI_* 1,775 0.24 - 0.24
ScotiabankPública1I_EWZ_* 1,300 - (0.02)(0.02)
ScotiabankPública1I_SHV_* 2,800 0.35 - 0.35
ScotiabankPública1_ARA_* 11,445 - - -
ScotiabankPública1I_IB01_N 550 0.03 - 0.03
ScotiabankPública1_WALMEX_* 45,000 0.04 (0.02) 0.02
ScotiabankPública1_ALPEK_A 90,663 0.02 - 0.02
Total 1,333,152 1.72 (0.37) 1.35
La posición accionaria de títulos por cobrar o vender asciende $0 millones de pesos,

con una plusvalía de $0 millones de pesos.
InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/ Minusvalía
ScotiabankSin cotizaciónEMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.1,222---
ScotiabankSin cotizaciónBLADEX COM8,095---
Total9,317---

Al 30 de junio, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de $1.95 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $1.43 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $0.51 millones de pesos.
Requerimientos de CapitalizaciónTotal LargaTotal CortaValor Absoluto de la posición
Coeficiente de Riesgo de mercadoRequerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado6.450.006.4522.23%1.43
Por riesgo específico
Canasta de acciones, 6.060.006.068.00%0.49
Índices accionarios0.390.000.394.00%0.02
Requerimiento por riesgos específico0.390.000.394.00%0.02
Total Requerimiento de capital1.95

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

ReferenciaRubromar-24jun-24
1Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)760,478794,359
2(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)(11,132)(10,446)
3Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)749,346783,912
Exposiciones a instrumentos financieros derivados
4Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)6,3116,553
5Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados6,0326,289
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)(2,207)(1,932)
8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)
9Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos
10(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)
11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)10,13610,910

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores
12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas17,08322,871
13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)(17,083)(21,870)
14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT911
15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros--
16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)91,012
Otras exposiciones fuera de balance
17Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)336,181388,965
18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)(253,435)(290,435)
19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)82,74798,530
Capital y exposiciones totales
20Capital de Nivel 173,53876,795
21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)842,238894,365
Coeficiente de apalancamiento
22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III8.73%8.59%

TABLA II.1
COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS
ReferenciaDESCRIPCIONmar-24jun-24
1Activos totales 822,459869,361
2Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria(797)(816)
3Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento
4Ajuste por instrumentos financieros derivados(34,762)(41,221)
5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(17,074)(21,859)
6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden82,74798,530
7Otros ajustes(10,335)(9,631)
8Exposición del coeficiente de apalancamiento842,238894,365

TABLA III.1
CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE
ReferenciaDESCRIPCIONmar-24jun-24
1Activos totales822,459869,361
2Operaciones en instrumentos financieros derivados(44,897)(52,131)
3Operaciones en reporto y préstamos de valores(17,083)(22,871)
4Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento
5Exposiciones dentro del Balance760,478794,359

TABLA IV.1
PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS (NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO
CONCEPTO/PERIODOmar-24jun-24Variación
Capital Básico 1)73,53876,7953,257
Activos Ajustados2)842,238894,36552,127
Razón de Apalancamiento 3)8.73%8.59%-14pb
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 2024.
El indicador se ubicó en 8.59%, 14pb menor respecto el trimestre anterior, debido al incremento en los activos ajustados por $52,127 millones o -53pb; principalmente por las exposiciones dentro del balance y partidas fuera del balance; compensado parcialmente por la mejora del capital nivel 1 de $3,257 millones o +39 pb debido principalmente al resultado neto del periodo.

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

operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11Suma de las líneas 4 a 10
12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)
13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:
a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.
b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.
c) Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.
d) Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.
El monto se debe registrar con signo negativo.
14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.
15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.
Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.
16Suma de las líneas 12 a 15
17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.
18Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.
El monto se debe registrar con signo negativo.
19Suma de las líneas 17 y 18
20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19
22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

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

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

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

AGENCIAS CALIFICADORAS
Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva
Fitch RatingsAAA(mex)F1+(mex)Estable
Standard & Poor’smxAAAmxA-1+Estable
La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las Agencias Calificadoras (Fitch Ratings y Standard & Poor’s), en su calidad de emisor a escala nacional y están sujetas a modificaciones sin previo aviso por parte de las Agencias Calificadoras.
DIVIDENDOS
Mediante sesión del Consejo de Administración del 26 de febrero del 2013, se acordó proponer a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de un dividendo en efectivo por la cantidad de $164’795,248.00 (Ciento sesenta y cuatro millones setecientos noventa y cinco mil doscientos cuarenta y ocho pesos 00/100 M.N).
En Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 12 de abril del 2013, se aprobó

decretar un dividendo en efectivo hasta por la cantidad de $164’795,248.

Fecha de pago Importe

23 de abril de 2013 $ 165 millones

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 20 de diciembre del 2013,

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

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

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

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

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

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

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

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

FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ
Al 30 de junio de 2024, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:
•Instrumentos de Mercado por un valor de MXN$128,387 millones de pesos.
•Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$46,675 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 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital

Instrumentos
Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA
A) DISCUSIÓN SOBRE LAS POLÍTICAS DE USO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.
Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados

(Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.
Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.
Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.
El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo a las políticas establecidas.
Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:
1)Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
2)Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
3)Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
4)Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.
Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:
1)Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.
2)Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.
3)Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.
La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.
1)Manual de Operación de Derivados.
2)Política de Administracion de Riesgo de Mercado y Estructural.
3)Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).
4)Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas
5)Política de Riesgo de Contraparte
6)Política de Sobregiros
Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.
Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:
Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de Mercado Derivado
1.Flujos de EfectivoPagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
3.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera ActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de Mercado Derivado
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Casa se encuentran:
SubyacenteFuturosOpcionesSwaps
MRMRMRMEMRME
Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.
Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de

deuda e índices con base en dichas tasas
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.
Moneda nacional, Divisas y UDIS;
Oro y Plata
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.
1).Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.
2).(MR) Mercados reconocidos
3).(ME) Mercados extrabursátiles
Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.
El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.
Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.
Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:
•El modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
•El modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
•El modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados).
•El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.
Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.
Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.
Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que

estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.
Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:
•Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.
•Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.
•Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.
•Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.
•Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.
Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:
•Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.
•Diversificar fuentes de fondeo.
•Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
•Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo
Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de junio 2024 y en promedio para el segundo trimestre de 2024 es de:
Scotiabank-
Brechas de liquidez acumuladas
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)70,77279,257
Liquidity Buffer149,058137,367

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS
Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration – Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2/Peak & Wall Street).
INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Cross Currency Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
FX RateVALMER
Interest Rate Swap(All Interest Rate)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY,GBP SwapInterest Rate CurveVALMER
Interest Rate Cap/Floor(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate Curve VALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest Rate CurveVALMER
SurfaceBloomberg/Reuters
IRS FuturesTIIE FondeoMXNPricePriceVALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER
OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread OptionMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark

Correlation
Dividend
OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index whith Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER
FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,
MXN,PEN,AUD,EUR,
JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER
FX Rate
Surface
Price
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,
BRL,CLP,COP,PEN,

AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,
EUR,JPY PricePriceVALMER

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO
Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:
TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO
a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
•Necesidades de tesorería del Banco
•Relación de corresponsalía
•Límites recíprocos
b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
•Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
•Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.
PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO
1)Tesorería: Call Money
2)Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores
3)Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
4)Cambios: FOREX
5)Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
6)Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
7)Metales
SUJETOS DE CRÉDITO
Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:
•Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
•Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
•Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
•Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público
REGLAS PARTICULARES
Metodología utilizada para el consumo de Líneas:
•La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".
•La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
•Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.
•La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.
IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

•El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

•Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

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

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B)DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS

SWAPS DE TASA DE INTERÉS

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

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

FUTUROS DE TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

FUTUROS DE BONO M

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

FUTUROS DE CETE

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

EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos). Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

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

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

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la

posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:

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

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

COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:

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

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

En adición, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia o 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 2024 y promedio del segundo trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank–
(millones de pesos)Posición
(Cierre) Posición
(Promedio)
Liquidity Buffer149,058137,367

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:
ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market
En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.
Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:
Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario
PosibleEscenario
ProbableEscenario
Estrés
Gap 30d Gap Acum70,77267,14867,09867,048
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,624)(3,674)(3,724)

D)ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y CAMBIOS EN EL VALOR RAZONABLE.
Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.
El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.
DELTA
La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.
Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.
Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.
Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

GAMMA

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

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

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

VEGA

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

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

RHO

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

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

THETA

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

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

DIVIDEND RISK

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

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

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

Cifras expresadas en pesos

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Junio 28, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(29,848.00)	(75,696.00)	267,578.00	270,359.00	71,752.00	(13,169.00)	490,976.00
CCS	1,884.00	30.00	(94.00)	346.00	593.00	(17.00)	2,742.00
Caps&Floors	320.00	(75.00)	(2,489.00)	1,396.00	(14.00)	(1.00)	(863.00)
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-

TIIE Futures-------
Total DERIVATIVES(27,644.00)(75,741.00)264,995.00272,101.0072,331.00(13,187.00)
492,855.00

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD
SUPUESTOS DE CÁLCULO.
Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.
Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.
Los impactos en los estados de resultados son:
a)Bajo el escenario probable una pérdida de (30.49) Millones de pesos.
b)Con escenario poco probable un P&L de (61.01) Millones de pesos.
c)Y finalmente con el escenario muy poco probable (127.88) Millones de pesos.
Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.
Tipo SensibilidadInstrumentoSensibilidadMTMProbable
Shock
(+/-)P&LStress 1
Shock
(+/-)P&LStress 2
Shock
(+/-)P&L
- 1pb a la tasaFuturos de TIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-
- 1pb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps0.49578.4350.00(24.64)100.00(49.29)200.00(98.57)
Volatilidad al 1%Caps &Floors(0.12)3.580.10(0.01)0.40(0.05)1.00(0.12)
a FX %Forwards3.1958.380.10(5.84)0.20(11.67)0.50(29.19)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total (30.49) (61.01) (127.88)

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 28 de junio de 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).
OpcionesDeltaVegaGamma
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX89,149.002,632.0021,224.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---

Options VLO.N---
Total89,149.002,632.0021,224.00

Análisis de Stress
Los escenarios de stress a la baja; probable (10%), poco probable (30%) y muy poco probable (50%) son los siguientes:
Escenarios a la baja(0.1)(0.3)(0.5)
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX(8,914.90)(26,744.70)(44,574.50)
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total(8,914.90)(26,744.70)(44,574.50)

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:
Escenarios al alza0.050.150.2
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX4,457.4513,372.3517,829.80
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total4,457.4513,372.3517,829.80

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5%, 15% y 20% de escenarios al alza.
Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:
EscenarioMonto
Probable(8,914.90)
Poco Probable(26,744.70)
Muy poco Probable(44,574.50)

DESCRIBIR Y NUMERAR LAS LLAMADAS DE MARGEN QUE SE HAYAN PRESENTADO DURANTE EL TRIMESTRE
Respecto a las llamadas de margen, al 28 de junio de 2024 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USDColateral Enviado USD
CLIENTE 1--11,595,000(6,240,000)
CLIENTE 2672,000,000(355,000,000)--
CLIENTE 3---(1,895,000)
CLIENTE 4--6,220,000(605,000)
CLIENTE 54,500,000(16,400,000)--
CLIENTE 63,116,600,545(218,900,000)69,150,000(55,825,000)
CLIENTE 7--34,640,000(19,030,000)
CLIENTE 8--40,900,000(91,210,000)
CLIENTE 9--207,300,000(175,200,000)
CLIENTE 10--260,000-
SUBTOTAL3,793,100,545(590,300,000)370,065,000(350,005,000)

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USDColateral Enviado USD
CLIENTE 11--15,460,000(3,320,000)
CLIENTE 12---(100,000)
CLIENTE 13--12,530,000(31,030,000)
CLIENTE 14---(560,000)
CLIENTE 1541,500,000(68,300,000)--
CLIENTE 16709,600,000(432,500,000)--
CLIENTE 17155,200,000(260,900,000)71,190,000(123,460,000)
CLIENTE 18658,308,922(276,525,535)--
CLIENTE 191,200,000---
CLIENTE 205,100,000(43,300,000)--
CLIENTE 21--2,440,000(3,320,000)
CLIENTE 22--580,000(1,710,000)
CLIENTE 23--500,000(1,270,000)
CLIENTE 24--15,570,000(30,280,000)
TOTAL5,364,009,467(1,671,825,535)488,335,000(545,055,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS
ProductoFechaClienteDivisaMontoMotivo del incumplimiento
Interest Rate Swap01/04/2024Cliente 1MXN(1,269,343)En espera de Instrucción
Interest Rate Swap01/04/2024Cliente 2MXN(853,895)En espera de Instrucción
Forward01/04/2024Cliente 3MXN129,182En espera de Instrucción
Forward01/04/2024Cliente 4MXN135,607En espera de Instrucción
Forward03/04/2024Cliente 5MXN3,937,537No fondeo su cuenta
Opcion EQ15/04/2024Cliente 6MXN254,100No reconoce la operación
Opcion EQ16/04/2024Cliente 7MXN241,088No reconoce la operación
Forward19/04/2024Cliente 8MXN3,392,080No fondeo su cuenta
Forward19/04/2024Cliente 9MXN6,161,930No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap29/04/2024Cliente 10MXN(1,026,414)En espera de Instrucción
Forward17/05/2024Cliente 11USD31,200Banco Corresponsal no envío los fondos
Forward17/05/2024Cliente 12USD31,200Banco Corresponsal no envío los fondos
CAP17/05/2024Cliente 13MXN11,322No envio los fondos
Interest Rate Swap27/05/2024Cliente 14MXN439,519No envio los fondos
Interest Rate Swap29/05/2024Cliente 15MXN(1,089,826)En espera de Instrucción
Interest Rate Swap12/06/2024Cliente 16MXN406,000No envio los fondos
Opcion FX13/06/2024Cliente 17USD(50,000)Pago fuera de horario
Opcion FX13/06/2024Cliente 18USD(250,000)Pago fuera de horario
Forward18/06/2024Cliente 19MXN52,691,300No recibimos los fondos
Opcion FX21/06/2024Cliente 20EUR873No envio los fondos
Interest Rate Swap26/06/2024Cliente 21MXN273,583No envio los fondos

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

Cifras expresadas en pesos

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
Cifras expresadas en pesos

"VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF"

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 19 de julio de 2024, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Javier Antonio Serebrisky (Director General Adjunto de Finanzas), Fernando Rodríguez Antuña (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.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2023 y 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2024 adjuntos, se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 “Estructura de las normas de información financiera”, considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A “Marco conceptual”, así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 “Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad”. Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros consolidados y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 “Supletoriedad”, y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable,

debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP por sus siglas en inglés) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.
(Continúa)
Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

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

Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).
Nota 9 – Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.
Nota 10 y 11 – Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).
Nota 14 – Activos por derecho de uso: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.
Nota 17 – Inversiones en asociadas y otras inversiones permanentes: determinación si el Banco tiene influencia significativa (inversiones en asociadas) y determinación de si el Banco tiene control de facto sobre una participada.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

-Nota 3j – Valuación de instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.
-Nota 4 – Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.
-Nota 7 – Inversiones en instrumentos financieros.
-Nota 10 y 11 – Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.
-Nota 18 – Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.
-Nota 21 – Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

(Continúa)
El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios).

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la

medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.
(Continúa)
Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.
Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones l y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Banco que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante los años terminados al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2023 y 2022.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

–Nota 4 – Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.
- Nota 7 – Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 – Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

Moneda funcional y de informe

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

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o “$”, se trata de millones de pesos mexicanos, y

cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

(Continúa)
Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

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

Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se adjuntan.

Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

		Inflación	
31 de diciembre de	UDI	Del año	Acumulada
2023	7.9816	4.38%	20.83%
2022	7.6468	7.58%	19.50%
2021	7.1082	7.61%	14.16%

Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las entidades al 31 de diciembre de 2023 y 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2023 y 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria ParticipaciónUbicaciónActividad

Inmobiliaria 99.99%Ciudad de MéxicoAdministración de activo fijo
Scotia Servicios 99.99%Ciudad de MéxicoApoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados100%Ciudad de MéxicoOperador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(Continúa)
Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el período en que se originan dentro del rubro “Resultado por intermediación”, según sea el caso.

Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de “Call Money”), las compras de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo (divisas a entregar). Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

(Continúa)

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los depósitos en el Banco Central sobre las cuales no pueda disponer el Banco, se reconocen como equivalentes de efectivo restringidos.

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, y corresponden al margen inicial, aportaciones y retiros posteriores efectuados en la vigencia de los contratos correspondientes. En las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

Inversiones en instrumentos financieros

i.Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten

en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii.Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como se muestra en la hoja siguiente.
(Continúa)
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro.

Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Banco deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Banco.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados conforme se describe en la hoja siguiente.

(Continúa)
el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados:

—el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

—las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio –

El Banco determina su modelo de negocio para la administración de sus inversiones en instrumentos financieros y para clasificarlos adecuadamente. El modelo de negocio se basa en la forma en que los instrumentos financieros se administran para generar flujos de efectivo para el negocio y no en una intención particular de tenencia del instrumento. Se requiere de juicio para determinar el modelo de negocio, ya que este no se basa en un solo factor o actividad, por lo que se considera toda la evidencia disponible al momento de realizar la evaluación. De forma enunciativa mas no limitativa, la evidencia relevante a evaluar es la siguiente:

las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en períodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras. (Continúa)

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal y los intereses (SPPI).

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal"' se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

términos que pudieran generar apalancamiento;

términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

características de pago anticipado y prórroga; y

términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

(Continúa)
Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas –

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

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de “Ingresos por intereses”. No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura.
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI)Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.
Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV)Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de “Resultado por intermediación”.
Inversiones en acciones a través de ORIEstos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

iii.Baja en cuentas

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

(Continúa)
El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera consolidado, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

iv.Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el período en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del período, como una reversión de PCE previamente reconocida.

Operaciones fecha valor-

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

presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

(Continúa)
Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora ("colateral otorgado") se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada (inicialmente al precio pactado), la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio, en adición, se lleva en cuentas de orden el control de dicho colateral vendido o dado en garantía siguiendo para su valuación el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

Asimismo, en el caso en que la reportadora se convierta a su vez en reportada por la concertación de otra operación de reporto con el mismo colateral recibido en garantía de la operación inicial, el interés por reporto pactado en la segunda operación se deberá reconocer en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo, afectando la cuenta por pagar valuada a costo amortizado mencionada anteriormente.

(Continúa)
Las cuentas de orden reconocidas por colaterales recibidos o colaterales recibidos que a su vez hayan sido vendidos o dados en garantía por la reportadora, se cancelan cuando la operación de reporto llega a su vencimiento o exista incumplimiento por parte de la reportada.

Estimación de perdidas crediticias esperadas –

La estimación para pérdidas crediticias esperadas se determina conforme a lo establecido en la NIF C-16 “Deterioro de instrumentos financieros”, lo cual implica que se determina inicialmente una etapa de riesgo a cada posición, y posteriormente calcular la estimación de pérdidas crediticia esperada asociada a cada etapa.

El Banco ha desarrollado el procedimiento para determinar las pérdidas crediticias esperadas para los instrumentos financieros, con el objeto de determinar el deterioro de los deudores por reporto para su posterior reconocimiento contable.

Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro “Ingresos por intereses”.

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 “Custodia y administración de bienes”.

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

En la fecha en que el Banco venda el valor objeto de la operación, deberá reconocer la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir dicho valor al prestamista (medida inicialmente al precio pactado) que se valuará a valor razonable.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses" y en el estado de situación financiera consolidado dentro del rubro de "Acreedores y otras cuentas por pagar".

(Continúa)
Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

Para la determinación del valor razonable, se consideran los datos e insumos provistos por un proveedor de precios autorizado por la Comisión, siempre y cuando no sean instrumentos financieros derivados que coticen en bolsas nacionales o que no sean intercambiados en mercados reconocidos por el Banco Central.

Operaciones con fines de negociación-

Contratos adelantados forwards:

El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados

organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

(Continúa)
En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

Futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria.

Swaps:

Es un IFD mediante el cual se establece la obligación bilateral de intercambiar flujos de efectivo en fechas futuras preestablecidas, sobre un valor nominal o de referencia durante un periodo determinado.

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se trasforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Banco, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera consolidado, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable

de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

(Continúa)

Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe descontinuarse prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Banco.

Derivados implícitos-

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

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que, por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 15).

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

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados Over the Counter (OTC) por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

(Continúa)

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados Credit Default Swaps (CDS) a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de “Otras cuentas por cobrar, neto” y “Acreedores por liquidación de operaciones”, respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, provengan de la misma naturaleza de la operación, se celebren con la misma contraparte y se liquiden en la misma fecha de vencimiento o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)
Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación:

Créditos comerciales:

los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como “estructurados” en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;
los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos

otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

(Continúa)
La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina, de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten con garantía de inmuebles.

Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las

cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

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

Los créditos otorgados en garantía se reconocen como créditos restringidos.

Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

(Continúa)
El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3s.

Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen, en la hoja siguiente.

(Continúa)
Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, Veces Salario Mínimo (VSM), Unidad de Medida y Actualización (UMA) o Unidades de Inversión (UDI);
concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo para la Atención de Emergencias por Amenazas Naturales “OTIS”;
prórroga del plazo del crédito;
modificación al esquema de pagos pactado, o
ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por

lo que da de baja el crédito original.

(Continúa)
Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.
Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.
En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3p).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.
En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de

uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.

(Continúa)
Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a
Etapa 1.

Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.
Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.
Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de “Efectivo y equivalentes de efectivo”, al momento en que no han sido cobrados.

(Continúa)
Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o

pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

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

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago
contractualEquivalencia
30 días90 días

Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas
Decenal3 decenasMás de 9 decenas
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses.
Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho período no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses.
Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, son reclasificados a Etapa 1, excepto los créditos reestructurados y/o renovados.

(Continúa)
Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven

no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen con lo siguiente:

el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación ó reestructuración, y
el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y
Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen con lo que se muestra en la hoja siguiente.
(Continúa)
se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración;
se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la

renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto, y se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueve y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del período de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección “Etapa 3” de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de “Etapa 3”.

Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

(Continúa)
Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total

exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.
Para créditos con períodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
En el caso de créditos con amortizaciones que cubran períodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los períodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de períodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a períodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

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

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

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

El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura ó renovación, o bien,
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;

(Continúa)
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y
La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de

que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los períodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha etapa hasta acreditar pago sostenido. Se deberá de acreditar el pago sostenido en cada etapa de riesgo de crédito y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

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

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

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de “Ingresos por intereses”, así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de “Gastos por intereses”.

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.

(Continúa)
Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.
Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados, lo que sucede en la mayoría de las circunstancias; sin embargo, en aquellos casos en los que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, previa autorización del Comité de Crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de “Comisiones y tarifas cobradas”.

Programa de lealtad de tarjetas de crédito

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

(Continúa)
Criterios contables especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán “OTIS”.

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

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

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

Microcréditos individuales o grupales.

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

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

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

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

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

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

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

Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones:

El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación

crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).
Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

(Continúa)
En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

origen de las estimaciones;
metodología para su determinación;
monto de estimaciones por constituir, y
tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

Entidades federativas y municipios.

Proyectos con fuente de pago propia.

Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como “estructurados”.

Entidades financieras.

Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

Con ingresos netos o ventas netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Con ingresos netos o ventas netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

(Continúa)
Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación de la SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA y ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

(Continúa)
La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con otras instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación.

Rangos de porcentaje de estimación preventiva para riesgos crediticios
Consumo
Grado de riesgoNo revolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial
DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%0.90%
A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%
B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%
B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%
B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos, eliminaciones y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo con plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se

han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

El Banco podrá optar por eliminar de su activo aquellos créditos con riesgo de crédito etapa 3 que se encuentren provisionados al 100% aun cuando no cumplan con las condiciones para ser castigados. Para tales efectos, el Banco deberá cancelar el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)
Cualquier recuperación derivada de créditos previamente, castigados o eliminados es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3s.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva para riesgos crediticios sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

Otras cuentas por cobrar, neto

Las cuentas por cobrar reconocidas en este rubro no tienen interés ya sea explícito o implícito: por lo tanto, incluyen:

cuentas por cobrar de corto plazo; y
otras cuentas por cobrar de corto plazo

No deberán incluirse las cuentas por cobrar derivadas de las operaciones a que se refieren:

los criterios B-3 "Reportos", B-4 "Préstamos de Valores" y B-6 "Cartera de Crédito" emitidos por la Comisión;
las correspondientes a los derechos de cobro definidos en el criterio "B-6"; y
las cuentas por cobrar en el rubro de otras cuentas por cobrar provenientes de operaciones de arrendamiento operativo.

Las otras cuentas por cobrar se integran de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias,

partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Las cuentas por cobrar se deben valuar en su reconocimiento inicial al precio de la transacción (la contraprestación a la que el Banco considera tener derecho de cobro a cambio de transferir el control sobre los bienes o servicios a un cliente) en el momento de considerarse devengada la operación que le dio origen, lo cual ocurre cuando, se transfiera el control sobre los bienes o servicios acordados con el cliente a cambio de una contraprestación, en acuerdo con los términos del contrato celebrado.

(Continúa)
Las cuentas por cobrar deben incluir los impuestos y derechos trasladables al cliente y cualquier otro cobro al cliente por cuenta de terceros. El Banco debe reconocer un pasivo por el monto de cobro por cuenta de terceros incluidos en las cuentas por cobrar.

Las cuentas por cobrar denominadas en moneda extranjera se deben reconocer inicialmente en la moneda funcional, utilizando el tipo de cambio histórico; que es aquél con el cual el Banco pudo haber realizado las cuentas por cobrar a la fecha de la transacción.

Las cuentas por cobrar deben valuarse en su reconocimiento posterior al precio de la transacción pendiente de cobro.

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La estimación de pérdidas crediticias esperadas se debe reconocer desde su inicio en las cuentas por cobrar, afectando resultados del ejercicio dentro del rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

En su reconocimiento posterior, se deben reconocer los cambios requeridos en la estimación para pérdidas crediticias esperadas por las modificaciones en las expectativas de las pérdidas crediticias esperadas que surjan en cada periodo en los resultados del ejercicio dentro del rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

La estimación para pérdida crediticias esperadas se debe determinar a través del juicio profesional del Banco, considerando la evaluación de las pérdidas esperadas por el deterioro de las cuentas por cobrar, utilizando factores como la experiencia histórica de las pérdidas crediticias, condiciones actuales y pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el flujo de efectivo futuro por recuperar de las cuentas por cobrar.

La estimación para incobrabilidad para cuentas por cobrar comerciales se reconoce desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas.

Desde el reconocimiento inicial, deberá considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que, si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, deberá ajustarse con base en dicho valor presente.

Por lo anterior la Administración del Banco ha desarrollado el procedimiento para el cálculo de pérdida crediticia esperada para constituir dicha estimación basado en la siguiente ecuación:

PE=∑_(i=1)^n▒EI_ij*TP_j

(Continúa)
En donde:

PE:Pérdida esperada;
EI_ij:Exposición al incumplimiento de la operación i en el grupo de atraso j;
TP_j:Tasa de pérdida del grupo de atraso j;
j:j-ésimo grupo de atraso;
n:El número de operaciones.

La tasa de pérdida se calcula con ayuda del análisis de la proporción de saldo que se ha pagado en cada bucket de atraso, de esta manera, se analiza la concentración del saldo por bucket de atraso y con ello, definir el umbral de deterioro y la asignación del 100% de pérdida.

El Banco puede determinar la pérdida esperada de manera individual para deudores que tienen características particulares, en caso de que sea impráctico, éstos se califican agrupándolos por características homogéneas o comunes.

En este sentido, el Banco ha desarrollado una metodología en donde se determinó impráctico realizar una evaluación individual de las cuentas por cobrar, por lo cual se derivaron de modelos estadísticos desarrollados con datos históricos de las cuentas por cobrar en donde se calificaron y agruparon por características comunes y homogéneas en términos de riesgo en donde basados en elementos clave para la medición de la pérdida esperada crediticia se determinaron las siguientes variables: Tasa de pérdida (TP) y Exposición al incumplimiento (EI).

Para estimar los parámetros y aplicarlos de forma colectiva, los activos que integran las cuentas por cobrar fueron agrupados de acuerdo con los días de atraso que poseen al momento de la estimación del deterioro, asignándoles un grupo de morosidad para lo cual se identificó en el caso particular del Banco, dicho período es de 120 días, conforme al proceso de cobro.

Cuando el Banco considere nula la probabilidad de cobro de una cuenta por cobrar, debe dar de baja el valor neto en libros de la cuenta por cobrar, aplicando la cuenta por cobrar a la estimación para pérdidas crediticias esperadas. Si la estimación fuera insuficiente, debe ajustarse de inmediato afectando los resultados del ejercicio en el rubro “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

Las cuentas por cobrar, en su caso, se presentan deducidas de la estimación para pérdidas crediticias esperadas dentro del estado de situación financiera consolidado en el rubro “Otras cuentas por cobrar (neto)".

Otras consideraciones de la estimación de pérdidas crediticias esperadas para otras cuentas por cobrar:

Los sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro, se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

(Continúa)

El Banco no constituye estimación de pérdidas crediticias esperadas por:

Saldos a favor de impuestos,
Impuesto al valor agregado acreditable y

Cobros a clientes por cuenta de terceros.

No es objeto de este inciso las cuentas por cobrar con riesgo operacional, que su eliminación se reconoce en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para desmantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

(Continúa)

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Banco determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;
pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;
importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y
el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar bajo las siguientes condiciones:

hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa;
hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o
hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro “Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo”, y los pasivos por arrendamiento en el rubro “Pasivo por arrendamiento”, ambos en el estado de situación financiera consolidado.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(Continúa)

Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva para riesgos crediticios que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como “Otros ingresos (egresos) de la operación”.

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como “Otros ingresos (egresos) de la operación”. La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra en la tabla de la hoja siguiente.

(Continúa)

Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago	Porcentaje de reserva Bienes inmuebles	Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores
Hasta 6 meses	0%	0%
Más de 6 y hasta 12	0%	10%
Más de 12 y hasta 18	10%	20%
Más de 18 y hasta 24	10%	45%
Más de 24 y hasta 30	15%	60%
Más de 30 y hasta 36	25%	100%
Más de 36 y hasta 42	30%	100%
Más de 42 y hasta 48	35%	100%
Más de 48 y hasta 54	40%	100%
Más de 54 y hasta 60	50%	100%
Más de 60	100%	100%

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce

directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

Propiedades, mobiliario y equipo, neto

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

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

El monto a depreciar de las propiedades, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.
(Continúa)
El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de las propiedades, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo período que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

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

Activos de larga duración disponibles para su venta

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

El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.
Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

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

(Continúa)

Deterioro de activos de larga duración

El Banco evalúa periódicamente el valor neto en libros de los activos de larga duración para determinar la existencia de indicios de que dicho valor excede su valor de recuperación. El valor de recuperación representa el monto de los ingresos netos potenciales que se espera razonablemente obtener como consecuencia de la utilización o realización de dichos activos.

Si se determina que el valor neto en libros excede el valor de recuperación, el Banco registra las estimaciones necesarias. Cuando se tiene la intención de vender los activos, éstos se presentan en los estados financieros consolidados a su valor neto en libros o de realización, el menor. Los activos y pasivos de un grupo clasificado como disponible para la venta se presentan por separado en el estado de situación financiera consolidado.

Pagos anticipados y otros activos, neto

Los pagos anticipados representan aquellas erogaciones efectuadas por el Banco en donde no han sido transferidos los beneficios y riesgos inherentes a los bienes que está por adquirir o a los servicios que está por recibir. Los pagos anticipados se reconocen como un activo por el monto pagado, siempre que sea probable que los beneficios económicos futuros que estén asociados con tales pagos fluyan hacia el Banco.

Una vez recibidos los bienes y/o servicios, relativos a los pagos anticipados, estos se reconocen como un activo o como un gasto en el estado consolidado de resultado

integral, según sea la naturaleza respectiva.

Los pagos anticipados y otros activos incluyen erogaciones realizadas principalmente por gastos de licencias y anticipo de PTU. Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, el monto asciende a $2,568 y $2,973, respectivamente.

Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

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

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

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de “Pagos anticipados y otros activos, neto”, en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de “Pasivo por beneficios a los empleados” en el estado de situación financiera consolidado.

(Continúa)

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

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de “Gastos de administración y promoción” en el estado consolidado de resultado integral.

Activos intangibles

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

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

Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del

público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una pérdida crediticia esperada por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

(Continúa)
Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por Pagar (IFP)" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como parte del pasivo que le dio origen, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en

proporción al vencimiento de los títulos.

Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación que reúnen las características establecidas por la NIF
C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

Préstamos interbancarios y de otros organismos

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

(Continúa)
Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una

obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

(Continúa)
Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (y) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediciones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocen directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de “Gastos de administración y promoción”. Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 21).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

(Continúa)
El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de “Créditos diferidos y cobros anticipados” y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un

crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

(Continúa)
Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en

tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Banco que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitido (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la administración de cada fideicomiso.

Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Banco.

(Continúa)
Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el período en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio fideicomitido.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Banco existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Banco.

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen

directamente en los resultados del ejercicio.

Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

(Continúa)
Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3.

Otras cuentas de registro:

Se registran principalmente por garantías recibidas por el Banco, entre otros.

Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados.

Los ingresos o activos contingentes se deben reconocer en los estados financieros consolidados cuando la incorporación de beneficios económicos se convierta en probable, esto es, hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Cuando se determine que los activos y pasivos contingentes no se tiene certeza razonable de la incorporación de beneficios económicos o de la existencia de una obligación presente, respectivamente, estos no se deben reconocer en los estados financieros consolidados, debido a que su existencia es posible mas no probable. En este caso, se busca revelar estimaciones de los posibles efectos financieros en las notas a los estados financieros.

Mientras los activos y pasivos mantengan el carácter de contingentes, su control se debe llevar en cuentas de orden.

Reclasificaciones-

Al 31 de diciembre de 2022, el Banco agrupaba en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto" dentro del activo, los gastos de emisión y el descuento por colocación de depósitos a plazo de mercado de dinero y de títulos de crédito emitidos para efectos de presentación del estado de situación financiera consolidado. La Administración del Banco decidió reclasificarlas debido a su importancia y naturaleza al rubro de "Captación tradicional". Los efectos de estas reclasificaciones se aplicaron retrospectivamente en el estado de situación financiera consolidado al 31 de diciembre de 2022, de acuerdo con la NIF B-1, Cambios contables y correcciones de errores. Los efectos de las reclasificaciones antes mencionadas, en los rubros del estado de situación financiera consolidado, son como se muestran en la hoja siguiente.

(Continúa)

Concepto	Originalmente reportadas	Reclasificadas retrospectivamente	Cifras después de reclasificaciones
Activo			
Pagos anticipados y otros activos, neto	$ 3,116	(143)	2,973
Pasivo			
Depósitos a plazo:			
Mercado de dinero	31,238	(63)	31,175
Títulos de crédito emitidos	11,845	(80)	11,765

Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2024

Durante diciembre de 2023, el CINIF ha promulgado las siguientes Mejoras a las NIF 2024, que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes.

NIF A-1 Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada a partir de 2024 si se adoptan anticipadamente las revelaciones de las NIF particulares aplicables al tipo de entidad que corresponda. Incluye la definición de entidades de interés público y requiere que se revele si la entidad se considera una entidad de interés público o una entidad que no es de interés público. Divide los requerimientos de revelación de las NIF en: i) revelaciones aplicables a todas las entidades en general (entidades de interés público y entidades que no lo son), y ii) revelaciones adicionales obligatorias solo para las entidades de interés público. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-6, Propiedades, planta y equipo - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF B-2, Estado de flujos de efectivo/NIF B-6, Estado de situación financiera/ NIF B-17, Determinación del valor razonable/ NIF C-2, Inversión en instrumentos financieros/ NIF C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar/ NIF C-20, Instrumentos

financieros para cobrar principal e interés/ INIF 24, Reconocimiento del efecto de la aplicación de las nuevas tasas de interés de referencia - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cambia el término instrumentos financieros para cobrar o vender por instrumentos financieros para cobrar y vender. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Incluye el tratamiento contable de una cobertura de instrumentos financieros de capital cuya valuación a valor razonable se reconoce en el ORI. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

(Continúa)
NIF D-4, Impuestos a la utilidad - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1°. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Esta Mejora aclara cuál es la tasa aplicable que debe utilizarse para reconocer los activos y pasivos por impuestos a la utilidad causados y diferidos cuando hubo beneficios en tasas de impuestos del periodo para incentivar la capitalización de utilidades (utilidades no distribuidas). En estas circunstancias, los activos y pasivos por impuestos causados y diferidos deben determinarse con la tasa que será aplicable a las utilidades no distribuidas en el periodo, cuando se paguen como dividendos en periodos futuros. Cualquier cambio contable que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

La Administración se encuentra en proceso de evaluación para determinar los efectos de adopción de las mejoras a las NIF en los estados financieros consolidados.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditosMoneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Acumulado Actual
(Cifras en pesos)
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Tipo de Crédito / InstituciónAño actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Desglose de créditos [partidas]
Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - -
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Banca comercial
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si30/11/202330/08/20245.34734 + 0.44 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,378,299,754.50
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 22/12/202322/11/20245.34746 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,830,692,040.81
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 29/05/202429/05/20255.34288 + 0.37 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 2,757,294,194.11
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL)Si 22/12/202323/12/20245.34746 + 0.48 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,830,692,040.00
TOTAL - - - - - - 5,039,683,835.31 2,757,294,194.11 - - - -
Otros bancarios
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/11/202411.245 + 0.35 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,524,961,111.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202411.245 + 0.35 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,524,961,111.11
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0 SPREAD/FIJA MXN FIXED 1,005,888,888.89
SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0 SPREAD/FIJA MXN FIXED 1,017,988,055.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.245 +0.37 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,525,004,166.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/11/202331/08/202411.245 + 0.37 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,525,004,166.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202431/01/202611.245 + 0.44 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,525,154,861.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202431/01/202811.245 + 0.55SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,525,391,666.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202430/05/202911.245 + 0.5 SPREAD/VARIABLE MXN TIIE 28D EOM 2,525,270,440.00
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20258.23 Tasa Fija 1,797,848.29
FONDO DE OPERACIÓN Y FINANCIAMIENTO BANCARIO A LA VIVIENDANo31/05/202201/01/20268.23 Tasa Fija 489,983.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa Fija 42,963,164.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 55,890,673.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 10,031,470.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 24,799,426.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 5,903,826.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 49,986,846.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa Fija 22,200,621.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.6226 Tasa Fija 15,163,041.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.5165 Tasa Variable 12,107,487.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.475 Tasa Variable 28,559,114.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.515

Tasa Variable 15,544,877.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.97393 Tasa Variable 7,537,664.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.97393 Tasa Variable 8,342,658.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.515 Tasa Variable 117,755,745.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.515 Tasa Variable 4,587,886.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.515 Tasa Variable 91,757,723.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.5175 Tasa Variable 133,383,115.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.495 Tasa Variable 18,413,588.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.79523 Tasa Variable 53,231,925.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 5,130,813.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 17,695,578.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 48,417,799.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.495 Tasa Variable 7,526,342.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.445 Tasa Variable 10,098,554.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.445 Tasa Variable 14,137,975.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.445 Tasa Variable 10,098,554.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202331/03/20286.1792 Tasa Variable 67,729,923.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/05/202314/05/202711.4975 Tasa Variable 878,912.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202331/05/20285.8492 Tasa Variable 13,247,963.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202325/05/20275.85523 Tasa Variable 56,303,878.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202330/03/20285.96822 Tasa Variable 111,113,780.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202315/06/202711.4975 Tasa Variable 5,436,198.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202315/06/202811.5175 Tasa Variable 32,119,414.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202320/06/202511.445 Tasa Variable 16,050,866.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202306/07/202810.1 Tasa Fija 4,486,958.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202322/06/20275.64523 Tasa Variable 36,349,556.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/202316/06/202811.495 Tasa Variable 111,308,294.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202329/06/202811.495 Tasa Variable 140,423,978.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202301/07/202711.4765

Tasa Variable 3,971,305.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202325/08/20285.74523 Tasa Variable 87,151,283.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202315/01/202511.3975 Tasa Variable 391,185.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202331/08/20285.6292 Tasa Variable 10,933,029.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202312/09/202411.345 Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/09/202315/09/202711.4975 Tasa Variable 1,462,459.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202331/07/202411.345 Tasa Variable 9,179,720.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/09/202329/09/202711.495 Tasa Variable 8,421,142.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202329/09/202810.74 Tasa Fija 28,396,423.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/10/202302/10/202810.83 Tasa Fija 7,699,648.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/10/202327/08/202711.345 Tasa Variable 35,593,912.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202305/10/202611.475 Tasa Variable 11,761,472.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.513 Tasa Variable 69,599,411.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/10/202319/10/202811.513 Tasa Variable 6,675,520.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202317/02/202711.3475 Tasa Variable 34,825,350.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/11/202331/10/202811.515 Tasa Variable 25,870,668.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/11/202319/10/202811.493 Tasa Variable 88,688,468.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/202306/08/202411.345 Tasa Variable 11,198,649.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202331/07/202411.345 Tasa Variable 3,858,510.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202331/07/202411.345 Tasa Variable 1,743,666.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/202330/11/20276.3592 Tasa Variable 13,820,394.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202316/07/202411.3475 Tasa Variable 50,220,645.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202317/07/202411.3475 Tasa Variable 41,180,929.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/12/202327/12/20289.73 Tasa Fija 278,872,595.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/01/202401/07/202413.4822 Tasa Fija 9,885.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 84,942.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202403/07/202411.3465 Tasa Variable 10,088,250.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 1,295,911.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/01/202405/07/202411.345 Tasa Variable 10,081,936.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/01/202408/07/202413.4825 Tasa Fija 2,347.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202403/07/202413.4825 Tasa Fija 223,164.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202408/07/202413.4825 Tasa Fija 80,555.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202401/07/202413.4825 Tasa Fija 53,723.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/01/202405/07/202411.345 Tasa Variable 3,006,617.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/01/202405/07/202413.4825 Tasa Fija 1,123,173.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/01/202408/07/202411.347 Tasa Variable 8,052,952.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/01/202405/07/202413.4775 Tasa Fija 2,078,289.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202410/07/202411.347 Tasa Variable 8,052,952.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202408/07/202413.4802 Tasa Fija 258,797.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/01/202409/07/202413.4802 Tasa Fija 1,307,836.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/01/202412/07/202411.345 Tasa Variable 2,011,975.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/01/202412/07/202413.4788 Tasa Fija 8,807,913.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202412/07/202413.4806 Tasa Fija 844,196.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202412/07/202413.4806 Tasa Fija 1,950,523.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202415/07/202413.4806 Tasa Fija 2,943.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202412/07/202413.001 Tasa Fija 1,069,072.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202404/07/202413.001 Tasa Fija 1,383,002.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/01/202417/01/202511.345 Tasa Variable 4,826,697.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202419/07/202413.4802 Tasa Fija 1,325,153.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/01/202422/07/202413.4802 Tasa Fija 1,954.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202415/07/202411.3475 Tasa Variable 6,026,477.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/01/202417/07/202411.3475 Tasa Variable 6,026,477.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202422/07/202413.4815 Tasa Fija 8,781,436.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/01/202419/07/202411.343 Tasa Variable 6,022,686.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202422/07/202413.4795 Tasa Fija 3,074.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/01/202418/07/202413.4795 Tasa Fija 9,041,291.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/01/202422/07/202411.345 Tasa Variable 6,013,235.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202424/07/202411.345 Tasa Variable 6,013,235.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202426/07/202413.48 Tasa Fija 1,077,819.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202429/07/202413.48 Tasa Fija 39,719.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/02/202418/07/202413.4812 Tasa Fija 285,228.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202425/07/202413.4793 Tasa Fija 7,192,231.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202429/07/202411.345 Tasa Variable 6,062,397.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/02/202402/08/202411.3465 Tasa Variable 6,052,950.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/02/202405/07/202413.478 Tasa Fija 77,164.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/02/202402/08/202411.3465 Tasa Variable 6,052,950.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202405/08/202411.345 Tasa Variable 6,049,161.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202422/07/202413.479 Tasa Fija 74,075.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202415/07/202413.479 Tasa Fija 1,204,280.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/02/202406/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202405/07/202413.479 Tasa Fija 267,082.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202405/07/202413.479 Tasa Fija 107,909.89

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202407/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202407/08/202411.345 Tasa Variable 6,045,380.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202405/07/202413.4782 Tasa Fija 63,351.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202420/01/202511.345 Tasa Variable 4,622,866.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/02/202421/01/202511.345 Tasa Variable 3,019,764.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202418/07/202413.4782 Tasa Fija 252,877.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202401/08/202413.4782 Tasa Fija 8,585,615.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/02/202409/08/202411.347 Tasa Variable 6,039,714.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/02/202425/07/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202405/07/202413.4795 Tasa Fija 337,010.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202402/08/202413.4795 Tasa Fija 553,512.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/02/202405/07/202413.4795 Tasa Fija 166,725.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/02/202426/07/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/02/202405/07/202413.4807 Tasa Fija 78,424.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202412/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202405/08/202413.4766 Tasa Fija 5,294.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202415/07/202413.4766 Tasa Fija 643,858.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/02/202413/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202405/07/202413.4783 Tasa Fija 66,291.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202425/07/202413.4783 Tasa Fija 1,928,306.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202414/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202425/07/202413.4754 Tasa Fija 423,875.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202405/07/202413.4754 Tasa Fija 1,812.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202405/07/202413.4754 Tasa Fija 478,214.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/02/202412/08/202413.4754 Tasa Fija 597.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202405/07/202413.475 Tasa Fija 73,270.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202412/08/202413.475 Tasa Fija 4,019.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/02/202405/07/202413.475 Tasa Fija 24,959.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202431/07/202411.345 Tasa Variable 2,365,241.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202431/07/202411.345 Tasa Variable 4,481,509.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.3465 Tasa Variable 8,982,422.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202402/08/202411.3465 Tasa Variable 8,982,422.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/02/202413/02/202611.4475 Tasa Variable 2,511,129.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202419/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/02/202420/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202419/08/202413.4762 Tasa Fija 5,711.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202412/08/202413.4762 Tasa Fija 22,377.88

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202415/08/202413.4762 Tasa Fija 8,822,572.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202405/07/202413.4762 Tasa Fija 1,951,039.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202408/08/202413.4762 Tasa Fija 288,116.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202405/07/202412.4762 Tasa Fija 1,780,866.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202405/07/202413.4725 Tasa Fija 189,027.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202419/08/202413.4725 Tasa Fija 3,610.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202408/08/202413.4725 Tasa Fija 1,431,950.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202421/08/202411.345 Tasa Variable 5,048,846.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202409/08/202411.347 Tasa Variable 4,745,770.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202421/08/202411.345 Tasa Variable 8,583,039.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/02/202412/08/202413.4725 Tasa Fija 304,086.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/08/202411.345 Tasa Variable 4,008,823.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202419/11/20246.18574 Tasa Variable 28,082,453.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/02/20299.9 Tasa Fija 97,620,113.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/02/202423/08/202411.345 Tasa Variable 15,146,539.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202405/07/202413.4691 Tasa Fija 80,817.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202422/08/202411.345 Tasa Variable 11,612,347.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/02/202412/08/202413.4691 Tasa Fija 663,120.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202421/02/202511.345 Tasa Variable 4,988,331.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202421/02/202511.345 Tasa Variable 5,123,607.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202405/07/202413.47 Tasa Fija 203,959.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/08/202413.4675 Tasa Fija 27,712.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202422/08/202413.4675 Tasa Fija 2,281,734.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202422/08/202413.4675 Tasa Fija 6,075,411.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/02/202426/08/202413.4675 Tasa Fija 4,498.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202422/08/202413.4737 Tasa Fija 2,823,534.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 660,705.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202412.4737 Tasa Fija 2,620.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 178,804.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202405/07/202413.4737 Tasa Fija 48,550.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/03/202423/01/202511.345 Tasa Variable 4,630,248.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202426/08/202413.465 Tasa Fija 8,481.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.3465 Tasa Variable 1,008,825.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202418/07/202413.465 Tasa Fija 3,760,566.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 273,287.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.3465 Tasa Variable 1,008,825.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202402/07/202411.3465 Tasa Variable 1,008,825.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 1,527,059.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 120,629.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/03/202405/07/202413.4575 Tasa Fija 16,379.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202426/08/202413.465 Tasa Fija 1,268,742.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 260,306.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 1,225,167.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 666.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/03/202405/07/202413.465 Tasa Fija 1,038.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/07/202412.735 Tasa Fija 266,648.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/09/202413.465 Tasa Fija 38,061.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202403/07/202412.735 Tasa Fija 89,334.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 37,591.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202411.485 Tasa Fija 14,596.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 4,837.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 8,559.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202405/07/202412.735 Tasa Fija 13,424.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202402/09/202413.465 Tasa Fija 32,877.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202416/08/202413.4659 Tasa Fija 306,188.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202401/07/202412.7359 Tasa Fija 1,185,050.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202405/07/202412.7359 Tasa Fija 4,031.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202415/08/202413.4659 Tasa Fija 532,981.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202405/07/202412.7359 Tasa Fija 296,381.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202404/07/202412.7325 Tasa Fija 216,624.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202405/07/202412.7325 Tasa Fija 50,316.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202401/07/202412.7325 Tasa Fija 216,411.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202402/09/202413.4625 Tasa Fija 151,297.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202411/03/20295.42 Tasa Fija 108,201,027.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202409/07/202412.7325 Tasa Fija 2,079,224.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202405/07/202411.4825 Tasa Fija 4,489.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202402/09/202413.4625 Tasa Fija 6,803.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202406/03/20256.17752 Tasa Variable 20,652,397.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202402/07/202412.7224 Tasa Fija 35,463.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202405/07/202412.7224 Tasa Fija 40,617.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202402/09/202413.4524 Tasa Fija 1,571,575.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/03/202405/08/202413.4524 Tasa Fija 187,862.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 64,156.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202404/07/202412.7248 Tasa Fija 157,489.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 28,520.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 63,053.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 47,850.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 18,061.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/03/202405/07/202412.7248 Tasa Fija 24,532.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202410/09/202411.347 Tasa Variable 35,231,667.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202410/07/202412.72 Tasa Fija 513,668.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 259,718.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202403/09/202413.45 Tasa Fija 238,182.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/09/202413.45 Tasa Fija 1,692,957.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 298,245.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 259,925.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202407/03/20256.13791 Tasa Variable 24,150,130.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/07/202412.72 Tasa Fija 15,845.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202405/08/202413.45 Tasa Fija 40,015.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202405/12/20246.13995 Tasa Variable 8,729,696.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202404/07/202412.725 Tasa Fija 25,348.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 3,399,744.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 38,211.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 387,973.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/09/202413.455 Tasa Fija 2,058,518.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 20,066.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202412/07/202412.725 Tasa Fija 29,500,586.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202409/09/202413.455 Tasa Fija 156,154.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202429/08/202413.455 Tasa Fija 679,774.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 51,700.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 14,521.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 20,283.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202409/09/202413.455 Tasa Fija 113,172.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202429/08/202413.455 Tasa Fija 334,217.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 154,967.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/07/202412.725 Tasa Fija 389,171.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202405/08/202413.455 Tasa Fija 247,508.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202410/07/202412.7275 Tasa Fija 83,099.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202408/07/202412.7275 Tasa Fija 1,871,304.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 86,939.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202408/07/202412.7275 Tasa Fija 180,707.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 59,344.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202409/09/202413.4575 Tasa Fija 5,047.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 74,080.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 190,171.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 127,509.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202408/07/20246.67514 Tasa Fija 64,986.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 26,108.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 451,297.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202412/09/202413.4575 Tasa Fija 3,586,169.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/03/202405/07/202412.7275 Tasa Fija 47,523.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 70,877.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202412/07/202412.73 Tasa Fija 485,678.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202417/07/202412.73 Tasa Fija 91,591.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202413/09/202413.46 Tasa Fija 22,596.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202401/07/202412.73 Tasa Fija 22,030.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 92,179.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 324,551.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/03/202405/07/202412.73 Tasa Fija 336,093.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202411/03/202611.395 Tasa Variable 10,098,123.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202419/03/202710.69 Tasa Fija 12,871,441.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/03/202416/12/20246.01922 Tasa Variable 16,862,684.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 371,912.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 78,947.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202415/07/202412.7299 Tasa Fija 944,697.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 70,387.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202415/07/202412.7299 Tasa Fija 804,570.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 15,403.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/07/202412.7299 Tasa Fija 2,665.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202413/09/202413.4599 Tasa Fija 216,468.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/09/202413.4599 Tasa Fija 5,280,027.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202405/08/202413.4599 Tasa Fija 203,413.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202418/09/202411.345 Tasa Variable 14,057,355.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202413/09/202411.345 Tasa Variable 6,034,035.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202409/09/202411.347
Tasa Variable 5,033,095.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202429/08/202411.345
Tasa Variable 3,443,994.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/03/202429/08/202411.345
Tasa Variable 3,443,994.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202408/07/20246.64578 Tasa Variable 179,655.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 126,453.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 46,098.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 201,603.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 6,845.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202412/07/202412.495 Tasa Variable 1,204,158.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202401/07/202412.495 Tasa Variable 35,910.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 151,438.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 875,939.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/07/202412.495 Tasa Variable 2,565.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Variable 28,836.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Variable 23,625.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202405/08/202413.225 Tasa Variable 2,307.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202408/07/202412.497 Tasa Variable 345,344.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Variable 138,861.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Variable 7,469.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Variable 601,438.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Variable 2,084,713.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202412/07/202412.497 Tasa Variable 94,133.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/07/202412.497 Tasa Variable 99,475.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202420/09/202413.227 Tasa Variable 1,180,061.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202413/09/202413.227 Tasa Variable 325,519.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Variable 484,687.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/03/202405/08/202413.227 Tasa Variable 24,519.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202420/12/20245.97357
Tasa Variable 15,324,326.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202427/02/202511.345
Tasa Variable 4,244,308.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202417/07/202412.4975 Tasa Variable 49,135.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 407,197.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 2,901,692.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 20,604.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 7,126.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202422/07/202412.4975 Tasa Variable 1,216,160.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 13,463.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202423/09/202413.2275 Tasa Variable 5,030.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 22,069.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 22,971.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/03/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 10,239.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/03/202423/09/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202422/07/202412.4985 Tasa Variable 647,431.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 96,727.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 330,311.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202423/09/202413.2285 Tasa Variable 9,469.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202419/07/202412.4985 Tasa Variable 15,518.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202422/07/202412.4985 Tasa Variable 964,754.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 169,346.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 138,445.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 703,533.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 9,310.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 36,504.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 127,244.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202408/07/202412.4985 Tasa Variable 3,160.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 30,215.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 268,878.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 112,999.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 92,508.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 178,277.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 20,077.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 51,714.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202408/07/202412.499 Tasa Variable 59,399.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 318,457.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202422/07/202412.499 Tasa Variable 565,549.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202427/09/202413.229 Tasa Variable 1,084,800.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 353,158.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202425/07/202412.499 Tasa Variable 37,998.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 160,883.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 638,891.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/08/202413.229 Tasa Variable 6,469.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/08/202413.229 Tasa Variable 45,606.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 38,771.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202423/09/202413.229 Tasa Variable 28,668.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/08/202413.229 Tasa Variable 9,126.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/08/202413.229 Tasa Variable 31,486.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/04/202405/09/202413.229 Tasa Variable 605,045.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/04/202427/03/20255.97939 Tasa Variable 32,937,028.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202422/07/20246.63164 Tasa Variable 38,545.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 18,548.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 229,656.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 6,699.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202422/07/202412.4975 Tasa Variable 201,351.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 101,623.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202422/07/202412.4975 Tasa Variable 6,858.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 1,526,535.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 90,984.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202424/07/202412.4975 Tasa Variable 119,594.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 724,982.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 808,669.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/04/202405/08/202413.2275 Tasa Variable 241,401.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/04/202413/09/202411.345 Tasa Variable 2,878,667.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/04/202430/08/202411.345 Tasa Variable 20,195,386.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202419/07/202412.4975 Tasa Variable 98,522.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202425/07/202412.4975 Tasa Variable 206,946.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 213,205.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202431/07/202412.4975 Tasa Variable 337,404.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202405/07/202412.4975 Tasa Variable 154,549.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202430/09/202413.2275 Tasa Variable 212,808.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202430/09/202413.2275 Tasa Variable 29,024.20

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202401/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202401/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202401/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202430/08/202411.345 Tasa Variable 20,195,386.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202418/07/202412.4985 Tasa Variable 127,418.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 519,707.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 35,190.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202426/09/202413.2285 Tasa Variable 6,966,366.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202404/07/202411.345 Tasa Variable 252,127.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202402/08/202412.4985 Tasa Variable 1,545,452.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202429/07/202412.4985 Tasa Variable 3,937,546.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 736,569.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202401/07/202412.4985 Tasa Variable 1,827.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 422,846.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 25,854.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202401/07/202412.4985 Tasa Variable 24,726.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202416/08/202413.2285 Tasa Variable 19,114.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202419/09/202413.2285 Tasa Variable 283,302.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202405/08/202413.2285 Tasa Variable 220,164.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202404/07/202411.345 Tasa Variable 201,701.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202430/08/202411.345 Tasa Variable 15,146,539.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202429/07/202412.4985 Tasa Variable 919,345.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202422/07/20246.63892 Tasa Variable 56,385.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202403/10/202411.345 Tasa Variable 9,087,923.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202401/07/202412.4985 Tasa Variable 37,539.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/08/202412.4985 Tasa Variable 56,050.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 20,081.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 13,209.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202429/07/202412.4985 Tasa Variable 400,423.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 326,002.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 792,973.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202405/07/202412.4985 Tasa Variable 42,107.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202404/10/202413.2285 Tasa Variable 317,031.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202404/10/202411.345 Tasa Variable 968,168.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/04/202404/10/202411.345 Tasa Variable 10,097,693.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202426/07/202412.499 Tasa Variable 18,835.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 6,841.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202430/09/202413.229 Tasa Variable 2,720.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/04/202408/07/202411.347 Tasa Variable 402,647.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202429/07/202412.499 Tasa Variable 651,387.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 459,948.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 246,971.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202429/07/202412.499 Tasa Variable 202,524.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202420/09/202413.229 Tasa Variable 1,089,201.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/04/202419/09/202413.229 Tasa Variable 166,450.70

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/04/202404/10/202411.345 Tasa Variable 2,218,719.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202407/10/202411.345 Tasa Variable 10,097,693.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202425/07/202412.4992 Tasa Variable 4,056.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202401/07/202412.4992 Tasa Variable 94,824.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202405/08/202412.4992 Tasa Variable 150,857.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202404/10/202413.2292 Tasa Variable 3,350,395.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202407/10/202411.345 Tasa Variable 2,216,639.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202422/07/202412.4992 Tasa Variable 155,965.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/04/202404/09/202413.2292 Tasa Variable 19,843.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202431/03/202611.395 Tasa Variable 9,088,311.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202407/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202407/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202407/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/04/202416/01/202511.345 Tasa Variable 5,400,941.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202409/08/202411.347 Tasa Variable 2,013,238.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202408/10/202411.347 Tasa Variable 2,204,495.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202410/07/202411.345 Tasa Variable 4,543,961.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202408/10/202411.345 Tasa Variable 6,739,415.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202401/04/202611.395 Tasa Variable 9,088,311.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202419/07/202412.499 Tasa Variable 687,848.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202418/07/202412.499 Tasa Variable 42,393.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 23,865.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 79,814.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202406/08/202412.499 Tasa Variable 2,056,245.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 374,809.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 23,125.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/08/202412.499 Tasa Variable 257,976.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202407/10/202413.229 Tasa Variable 40,757.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202419/07/202412.499 Tasa Variable 78,950.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202407/08/202412.499 Tasa Variable 137,803.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202405/07/202412.499 Tasa Variable 438,173.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202409/08/202411.347 Tasa Variable 2,013,238.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202409/08/202411.347 Tasa Variable 1,006,619.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202409/08/202411.347 Tasa Variable 2,013,238.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202406/08/202412.5002 Tasa Variable 787,194.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202425/07/202412.5002 Tasa Variable 533,994.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202405/08/202412.5002 Tasa Variable 203,776.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202403/10/202413.2302 Tasa Variable 9,423,568.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202404/09/202413.2302 Tasa Variable 84,568.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202411/07/202411.345

Tasa Variable 402,521.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202409/10/202411.345
Tasa Variable 4,039,077.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202402/04/202611.395
Tasa Variable 10,098,123.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202405/08/202412.5002 Tasa Variable 2,366,995.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202408/07/202412.5002 Tasa Variable 490.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202405/08/202412.5002 Tasa Variable 43,710.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202407/10/202413.2302 Tasa Variable 155,761.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202408/07/202412.5002 Tasa Variable 81,515.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202405/08/202412.5002 Tasa Variable 19,953.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202401/04/202611.395
Tasa Variable 10,098,123.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/04/202408/08/202412.4988 Tasa Variable 2,053,467.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202429/08/202411.345
Tasa Variable 3,420,677.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202406/04/202611.395
Tasa Variable 10,098,123.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202402/08/202412.4907 Tasa Variable 332,701.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202429/07/202412.4907 Tasa Variable 70,357.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 597,569.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 2,329,174.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/07/202412.4907 Tasa Variable 61,516.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202408/07/202412.4907 Tasa Variable 99,993.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202410/10/202413.2207 Tasa Variable 3,347,864.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202404/09/202413.2207 Tasa Variable 7,217.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202422/07/202412.4907 Tasa Variable 298,723.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202404/09/202413.2207 Tasa Variable 78,948.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202403/07/202412.4907 Tasa Variable 9,574.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 397,681.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 71,246.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/07/202412.4907 Tasa Variable 8,580.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 2,007.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 4,015.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202407/10/202413.2207 Tasa Variable 1,154,690.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/04/202405/08/202412.4907 Tasa Variable 93,533.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/04/202414/10/202411.345
Tasa Variable 804,285.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/04/202407/04/202611.395
Tasa Variable 14,137,373.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202408/07/202412.4945 Tasa Variable 21,664.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202415/08/202412.4945 Tasa Variable 655,331.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/08/202412.4945 Tasa Variable 30,919.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202408/07/202412.4945 Tasa Variable 35,073.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/08/202412.4945 Tasa Variable 114,186.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202401/07/202412.4945 Tasa Variable 1,860.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/08/202412.4945 Tasa Variable 422,815.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/07/202412.4945 Tasa Variable 127,363.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/08/202412.4945 Tasa Variable 1,663,704.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202408/07/202412.4945 Tasa Variable 25,937.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202405/08/202412.4945 Tasa Variable 82,545.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202404/09/202413.2245 Tasa Variable 135,886.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/04/202416/07/202411.3475
Tasa Variable 401,765.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/04/202415/10/202411.3475
Tasa Variable 1,155,074.85

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/04/202408/04/202611.395 Tasa Variable 11,107,935.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 271,685.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 14,869.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 533,970.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202414/10/202413.225 Tasa Variable 13,396.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 26,939.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 506,192.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,202,188.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/07/202412.495 Tasa Variable 1,478.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/04/202416/08/202411.3475 Tasa Variable 2,008,825.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202414/08/202412.495 Tasa Variable 150,041.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202412/08/202412.495 Tasa Variable 14,139.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 20,054.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 16,346.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 71,458.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202407/10/202413.225 Tasa Variable 136,874.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202418/07/202411.345 Tasa Variable 451,843.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202413/08/202412.4965 Tasa Variable 579,500.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 209,823.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202411/10/202413.2265 Tasa Variable 2,222,500.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/07/202412.4965 Tasa Variable 48,174.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 147,865.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 290,106.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 491,422.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202410/10/202413.2265 Tasa Variable 1,081,241.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202404/09/202413.2265 Tasa Variable 65,670.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202412/08/202412.4965 Tasa Variable 1,514,695.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 96,567.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 292,406.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 92,915.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202409/08/202412.4965 Tasa Variable 1,268,164.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202415/07/202412.4965 Tasa Variable 6,349.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202414/10/202413.2265 Tasa Variable 3,906.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202410/10/202413.2265 Tasa Variable 2,567,928.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202412/07/202412.495 Tasa Variable 29,551.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202415/08/202412.495 Tasa Variable 3,687,477.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 51,962.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202412/08/202412.495 Tasa Variable 776,712.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 177,703.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202415/07/202412.495 Tasa Variable 95,452.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202419/09/202413.225 Tasa Variable 2,845,302.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 1,956,892.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202412/07/20246.52456 Tasa Variable 56,523.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202412/08/202412.495 Tasa Variable 807,231.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 18,170.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 15,689.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 581.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202404/10/202413.225 Tasa Variable 1,054,504.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202414/10/202413.225 Tasa Variable 850,109.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 10,717.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202404/10/202411.345 Tasa Variable 14,527,077.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 323,026.37

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,058,742.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 143,033.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 17,619.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 4,792.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202422/07/202411.345 Tasa Variable 450,992.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202412/08/20246.7029 Tasa Variable 96,480.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 710,763.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 31,665.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 576,987.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,885.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202415/07/202412.495 Tasa Variable 19,408.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 46,489.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/04/202414/10/202413.225 Tasa Variable 993,870.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202409/08/202412.495 Tasa Variable 128,329.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 82,100.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202408/07/202412.495 Tasa Variable 475,889.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202401/07/202412.495 Tasa Variable 186,631.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,892,677.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,521.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202421/10/202413.225 Tasa Variable 63,433.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202421/10/202413.225 Tasa Variable 203,970.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202415/07/202412.495 Tasa Variable 4,322.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 37,023.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202415/07/202412.495 Tasa Variable 62,963.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202421/10/202413.225 Tasa Variable 41,901.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/04/202420/11/202411.345 Tasa Variable 50,173,326.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202422/10/202411.345 Tasa Variable 851,875.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202415/08/202412.495 Tasa Variable 68,719.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 874,356.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 6,391.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202421/10/202413.225 Tasa Variable 43,567.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202423/08/202411.345 Tasa Variable 1,002,205.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202423/08/202411.345 Tasa Variable 2,004,411.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202423/08/202411.345 Tasa Variable 1,002,205.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202421/08/202412.495 Tasa Variable 207,473.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202412/08/202412.495 Tasa Variable 205,231.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 7,131.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 1,315,984.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 6,025.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202418/10/202413.225 Tasa Variable 1,547,973.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 582,663.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 1,304.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 140,332.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 2,638.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202422/10/202413.225 Tasa Variable 9,772,766.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/04/202425/07/202411.345 Tasa Variable 400,756.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202423/08/202412.495 Tasa Variable 78,038.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202412/08/202412.495 Tasa Variable 157,885.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 212,594.63

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202421/10/202413.225 Tasa Variable 289,861.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202417/10/202413.225 Tasa Variable 3,316,544.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 398,329.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 80,052.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 28,459.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 32,948.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 1,428,909.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 822,766.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 284,587.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/04/202420/01/20255.93445 Tasa Variable 3,697,030.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202412/08/20246.69366 Tasa Variable 236,644.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 1,343,584.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/07/202412.495 Tasa Variable 26,517.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202422/07/202412.495 Tasa Variable 64,819.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 506,863.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 31,733.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 257,009.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 64,270.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202422/07/202412.495 Tasa Variable 263,785.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202418/10/202413.225 Tasa Variable 565,453.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202411/07/202412.495 Tasa Variable 2,143,359.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 424,203.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 117,395.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202405/07/202412.495 Tasa Variable 4,956.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 3,949.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202402/08/202412.495 Tasa Variable 1,112,373.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 4,739.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 4,739.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202419/08/20246.71384 Tasa Variable 12,123.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 4,464.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 22,322.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 13,393.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202417/10/202413.225 Tasa Variable 5,113,984.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202404/09/202413.225 Tasa Variable 4,739.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202419/07/202412.495 Tasa Variable 155,086.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 50,797.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 7,340.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202425/10/202413.225 Tasa Variable 1,557,787.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202416/08/202412.495 Tasa Variable 353,351.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202405/08/202412.495 Tasa Variable 4,912.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202423/08/202412.495 Tasa Variable 17,322.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/04/202419/08/202412.495 Tasa Variable 191,619.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202429/07/202411.3465 Tasa Variable 5,004,727.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202428/08/202411.34 Tasa Variable 10,009,450.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202416/08/202412.49 Tasa Variable 653,358.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202422/07/202412.49 Tasa Variable 2,234.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 3,194,010.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 523,574.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 1,153,966.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 124,052.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202429/10/202413.22 Tasa Variable 1,295.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 21,478.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 137,400.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 209,392.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 1,359,748.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 10,046.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 1,914,583.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 40,694.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 336,987.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 26,907.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/05/202429/01/20275.93151 Tasa Variable 36,933,949.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/05/202428/10/202411.34 Tasa Variable 11,010,395.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202401/08/202411.3465 Tasa Variable 453,971.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202419/07/202412.49 Tasa Variable 600,689.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202423/08/202412.49 Tasa Variable 24,491.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 141,175.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202417/10/202413.22 Tasa Variable 3,065,825.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202419/08/202412.49 Tasa Variable 3,042.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 78,709.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202424/10/202413.22 Tasa Variable 1,685,595.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202404/09/202413.22 Tasa Variable 116,765.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202429/10/202411.345 Tasa Variable 57,409,067.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 677,904.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 8,405.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202423/08/202412.49 Tasa Variable 1,203,646.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202426/08/202412.49 Tasa Variable 573,484.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202429/07/202412.49 Tasa Variable 16,562.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 25,309.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202429/07/202412.49 Tasa Variable 116,563.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202424/10/202413.22 Tasa Variable 1,372,818.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202430/08/202411.3465 Tasa Variable 1,010,085.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202429/04/202911.515 Tasa Variable 172,253,764.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 530,355.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202428/08/202412.49 Tasa Variable 53,144.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202426/08/202412.49 Tasa Variable 451,231.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202426/07/202412.49 Tasa Variable 75,599.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202426/08/202412.49 Tasa Variable 10,747.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202429/10/202411.345 Tasa Variable 15,155,993.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202430/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202430/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/05/202430/10/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202401/07/20246.53593 Tasa Variable 2,888.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202419/08/20246.72846 Tasa Variable 5,513.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202430/10/202411.3465 Tasa Variable 15,151,286.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202402/07/202412.3866 Tasa Variable 77,745.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202401/07/202412.3866 Tasa Variable 732,562.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/07/202412.3866 Tasa Variable 258,178.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202401/07/202412.3866 Tasa Variable 2,181,999.66

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202423/08/202412.4866 Tasa Variable 265,334.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202426/08/202412.4866 Tasa Variable 5,586,401.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 492,080.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202426/08/202412.4866 Tasa Variable 721,560.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 36,379.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 47,443.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 452,352.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 223,365.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202425/10/202413.2166 Tasa Variable 1,105,564.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/07/202412.3866 Tasa Variable 144,199.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202401/07/202412.3866 Tasa Variable 54,556.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202423/08/202412.4866 Tasa Variable 132,849.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202426/08/202412.4866 Tasa Variable 1,788,925.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202429/07/202412.4866 Tasa Variable 2,460.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202429/10/202413.2166 Tasa Variable 120,860.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202419/07/20246.53593 Tasa Variable 75,208.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202401/07/202412.3866 Tasa Variable 1,695.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202405/08/202412.4866 Tasa Variable 48,559.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202405/05/202811.495 Tasa Variable 9,266,857.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 100,976,930.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202401/07/20246.52755 Tasa Variable 411,214.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 11,073.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202430/08/202412.49 Tasa Variable 326,610.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 680,198.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202408/07/202412.49 Tasa Variable 12,860.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202421/10/202413.22 Tasa Variable 300,598.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 806,628.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 2,573.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 15,175.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 32,327.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202431/10/202411.345 Tasa Variable 15,146,539.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202401/11/202411.345 Tasa Variable 504,884.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202410/07/202412.49 Tasa Variable 97,098.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 10,578.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202429/07/202412.49 Tasa Variable 51,202.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/05/202428/10/202413.22 Tasa Variable 1,266,500.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202405/08/202411.345 Tasa Variable 504,096.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202401/07/20246.5212 Tasa Variable 11,787.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 65,863.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 149,228.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 66,676.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202430/08/202412.49 Tasa Variable 704,026.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 70,323.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 800,850.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 94,686.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202401/11/202413.22 Tasa Variable 924,804.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202404/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 351,617.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 474,053.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 222,095.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202429/10/202413.22 Tasa Variable 912.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202404/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202406/08/202411.347
Tasa Variable 50,330,954.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202404/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202401/11/202411.3465
Tasa Variable 5,044,125.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 741,931.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 1,832,222.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 93,061.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202421/10/202413.22 Tasa Variable 10,718.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202408/10/202413.22 Tasa Variable 173,371.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202406/08/202411.347
Tasa Variable 20,132,381.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202405/11/202411.345
Tasa Variable 2,016,387.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 676,081.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 246,883.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202423/08/202412.49 Tasa Variable 1,681,856.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202422/07/202412.49 Tasa Variable 573,696.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 264,164.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202422/07/202412.49 Tasa Variable 337,018.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 20,432.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 11,124.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202405/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202405/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202405/11/202411.345
Tasa Variable 504,884.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202404/11/202411.345
Tasa Variable 15,127,631.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 66,547.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202429/07/202412.49 Tasa Variable 10,805.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 1,707,756.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 173,997.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 1,672,245.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 43,316.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 26,132.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 780,642.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 141,471.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202406/11/202411.345
Tasa Variable 2,015,756.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202402/07/202412.39 Tasa Variable 3,241.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 566,797.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202415/08/202412.49 Tasa Variable 3,718.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202413/08/202411.99 Tasa Variable 7,119,366.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 174,003.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 259,869.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202408/08/202411.347
Tasa Variable 452,978.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202405/11/202411.345
Tasa Variable 15,122,904.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202431/10/202411.345
Tasa Variable 2,358,821.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 65,498.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 71,127.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 9,131.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202430/08/202412.49 Tasa Variable 1,631,283.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202402/09/202412.49 Tasa Variable 1,594,601.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 10,720.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 3,354.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 79,802.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202431/10/202413.22 Tasa Variable 4,394,798.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 817,413.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 88,589.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 10,684.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 501,729.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 140.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202408/07/20246.52353 Tasa Variable 417,584.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202408/07/202412.39 Tasa Variable 1,295,950.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202422/07/202412.49 Tasa Variable 13,066.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202402/09/202412.49 Tasa Variable 112,468.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 475,974.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202406/11/202411.345
Tasa Variable 9,070,906.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202405/07/202412.39 Tasa Variable 188,604.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202423/08/202412.49 Tasa Variable 309,414.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 38,944.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202426/08/202412.49 Tasa Variable 275,424.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202402/09/202412.49 Tasa Variable 654,344.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 348,394.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 4,026,476.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 4,700,911.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 2,013,238.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 10,066,190.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202408/07/20246.52198 Tasa Variable 72,911.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 5,033,095.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 31,962.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202412/08/202411.345
Tasa Variable 60,321,441.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202406/09/202412.49 Tasa Variable 88,397.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 58,708.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 1,572,247.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 8,846.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 350,848.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 73,408.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202412/08/202411.345
Tasa Variable 20,107,147.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202402/09/202412.49 Tasa Variable 32,778.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 36,902.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 17,181.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 5,769.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 713,276.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202411/11/202411.345
Tasa Variable 2,012,605.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 5,033,095.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202408/08/202412.49 Tasa Variable 18,701.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202402/09/202412.49 Tasa Variable 34,042.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 4,127,646.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 774,231.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 200,400.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202402/08/202412.49 Tasa Variable 340,491.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202405/08/202412.49 Tasa Variable 548,646.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 21,674.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202404/11/202411.345
Tasa Variable 3,025,526.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202401/07/202412.39 Tasa Variable 12,463.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 17,884.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 27,304.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/09/202412.49 Tasa Variable 13,016.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 215,284.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202422/01/202511.345
Tasa Variable 10,309,896.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202431/01/202511.345
Tasa Variable 38,441,306.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202406/11/202411.345
Tasa Variable 3,023,635.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202412/11/202411.345
Tasa Variable 2,011,975.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202402/07/202412.3899 Tasa Variable 1,469,340.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202415/07/202412.3899 Tasa Variable 154,625.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202401/08/202412.4899 Tasa Variable 8,178.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202405/08/202412.4899 Tasa Variable 2,821,538.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202419/08/202412.4899 Tasa Variable 1,031,258.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202411/11/202413.2199 Tasa Variable 12,113.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202412/11/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202405/07/202412.3899 Tasa Variable 127,685.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202405/07/202412.3899 Tasa Variable 254,309.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202408/07/202412.3899 Tasa Variable 156,877.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202411/09/202412.4899 Tasa Variable 148,059.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202422/07/202412.4899 Tasa Variable 6,207.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 1,202,318.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 164,202.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202411/11/202413.2199 Tasa Variable 71,006.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 62,102.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202405/08/202412.4899 Tasa Variable 11,165.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202404/10/202413.2199 Tasa Variable 179,411.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202412/11/202411.345

Tasa Variable 502,993.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202415/08/202411.3475
Tasa Variable 301,323.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202408/11/202411.347
Tasa Variable 3,019,857.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202413/11/202411.345
Tasa Variable 5,028,362.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202410/07/202412.385 Tasa Variable 297,678.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202404/07/202412.385 Tasa Variable 531,284.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202406/09/202412.485 Tasa Variable 1,121,082.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202430/08/202412.485 Tasa Variable 27,653.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202402/09/202412.485 Tasa Variable 114,673.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202405/08/202412.485 Tasa Variable 74,266.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202407/11/202413.215 Tasa Variable 3,095,634.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 4,907.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202415/07/202412.385 Tasa Variable 11,956.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202431/07/202412.485 Tasa Variable 35,167.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202409/09/202412.485 Tasa Variable 2,313,546.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 106,114.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 609,146.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 228,112.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202431/10/202413.215 Tasa Variable 2,166,261.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202415/07/202412.385 Tasa Variable 846,862.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202431/07/202412.485 Tasa Variable 5,425.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 150,949.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 12,117.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202414/11/202411.345
Tasa Variable 1,005,357.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202411/11/202411.345
Tasa Variable 3,018,908.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202415/07/20246.52574 Tasa Variable 32,242.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202415/07/20246.52574 Tasa Variable 24,094.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202410/07/202412.3899 Tasa Variable 153,087.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202405/07/202412.3899 Tasa Variable 129,782.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202415/07/202412.3899 Tasa Variable 255,527.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202413/09/202412.4899 Tasa Variable 811,396.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 63,840.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202409/09/202412.4899 Tasa Variable 588,848.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 71,913.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202413/09/202412.4899 Tasa Variable 442,432.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 17,491.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202416/08/202411.345
Tasa Variable 50,173,326.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202405/07/202412.3899 Tasa Variable 220,503.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202409/09/202412.4899 Tasa Variable 462,420.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202426/08/202412.4899 Tasa Variable 16,652.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 11,952.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 1,115,565.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202409/08/20246.52574 Tasa Variable 977,731.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202406/09/202412.4899 Tasa Variable 89,289.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 178,028.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 222,583.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 86,719.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202404/09/202412.4899 Tasa Variable 5,963.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202409/09/20246.68321 Tasa Variable 53,465.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 6,460.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202401/07/202412.385 Tasa Variable 41,189.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 116,564.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 117,251.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202417/09/202412.485 Tasa Variable 945,196.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 586,208.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 1,114.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 74,096.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202402/09/202412.485 Tasa Variable 60,051.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 891,567.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/08/202412.485 Tasa Variable 1,092,913.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 65,507.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 23,436.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202418/09/202411.345
Tasa Variable 1,004,096.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 45,838.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 402,711.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202420/04/20296.02867
Tasa Variable 181,672,855.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202415/07/20246.52672 Tasa Variable 89,101.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202410/07/202412.385 Tasa Variable 17,931.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 51,923.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202401/07/202412.385 Tasa Variable 12,709.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 11,278.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 167,458.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 182,389.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202412/08/202412.485 Tasa Variable 44,810.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 250,757.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 137,027.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202415/11/202411.3475
Tasa Variable 3,515,445.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202415/11/202411.3475
Tasa Variable 3,515,445.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 630,563.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 39,396.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 66,833.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 128,328.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 91,320.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202424/10/202413.215 Tasa Variable 471,260.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 21,763.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202420/08/202411.345
Tasa Variable 50,110,298.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202415/11/202411.3475
Tasa Variable 1,457,448.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202413/08/202412.485 Tasa Variable 13,082.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202419/11/202411.343
Tasa Variable 2,810,586.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202419/11/202411.343
Tasa Variable 3,713,989.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202415/11/202413.215 Tasa Variable 3,983,600.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 155,761.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 329,032.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 30,481.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 293,256.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 8,835.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202415/11/202413.215 Tasa Variable 2,046.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202415/07/20246.52946 Tasa Variable 3,656,880.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202419/08/20246.52946 Tasa Variable 658,193.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202426/08/20246.69466 Tasa Variable 101,181.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 63,617.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202408/11/202413.215 Tasa Variable 1,027,074.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202430/04/203111.5165 Tasa Variable 101,023,688.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202411/07/202412.3915 Tasa Variable 464,930.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202405/07/202412.3915 Tasa Variable 164,826.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202401/07/202412.3915 Tasa Variable 74,020.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202416/08/202412.4915 Tasa Variable 407,086.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202423/08/202412.4915 Tasa Variable 76,310.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202425/07/202412.4915 Tasa Variable 47,152.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202409/09/202412.4915 Tasa Variable 241,827.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202404/09/202412.4915 Tasa Variable 39,384.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202414/11/202413.2215 Tasa Variable 5,340,984.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202410/07/202412.3915 Tasa Variable 81,339.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202422/07/202412.3915 Tasa Variable 690,926.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202410/09/202412.4915 Tasa Variable 28,227.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202417/09/202412.4915 Tasa Variable 1,193,890.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202404/09/202412.4915 Tasa Variable 101,647.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202417/09/202412.4915 Tasa Variable 702,407.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202420/11/202411.345 Tasa Variable 12,543,331.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202415/11/202411.3475 Tasa Variable 5,022,064.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202422/07/202412.385 Tasa Variable 426,484.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202417/09/202412.485 Tasa Variable 6,004.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202417/09/202412.485 Tasa Variable 2,395,642.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 53,081.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202419/08/202412.485 Tasa Variable 19,366.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202419/08/202412.485 Tasa Variable 63,872.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 55,128.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 310,441.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 221,358.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202405/07/202412.385 Tasa Variable 13,930.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202430/08/202412.485 Tasa Variable 177,736.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202419/08/202412.485 Tasa Variable 145,650.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 142,500.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202417/09/202412.485 Tasa Variable 6,010.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 221,217.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 255,943.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 717,727.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 16,797.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202405/08/202412.485 Tasa Variable 6,955.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/05/202404/09/202412.485 Tasa Variable 164,107.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202425/07/202412.3925 Tasa Variable 38,472.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202419/07/202412.3925 Tasa Variable 3,139,305.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202405/07/202412.3925 Tasa Variable 88,571.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202417/09/202412.4925 Tasa Variable 157,586.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/09/202412.4925 Tasa Variable 78,554.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/09/202412.4925 Tasa Variable 111,520.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/09/202412.4925 Tasa Variable 95,266.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/10/202413.2225 Tasa Variable 138,947.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202410/09/202412.4925 Tasa Variable 270,725.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/09/202412.4925 Tasa Variable 500,475.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/09/202412.4925 Tasa Variable 124,279.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202404/10/202413.2225 Tasa Variable 188,478.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202413/11/202411.345 Tasa Variable 5,028,362.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202426/08/202411.34 Tasa Variable 20,018,900.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/05/202408/07/202412.3925 Tasa Variable 318,754.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202426/08/202411.345 Tasa Variable 350,551.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202422/07/20246.54288 Tasa Variable 282,749.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202426/08/20246.54288 Tasa Variable 10,955.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202422/07/20246.54288 Tasa Variable 41,152.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202417/09/20246.71634 Tasa Variable 135,041.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202422/07/202412.395 Tasa Variable 20,639.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202405/09/202412.495 Tasa Variable 4,975.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202419/08/202412.495 Tasa Variable 50,702.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202404/09/202412.495 Tasa Variable 428,941.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202405/08/202412.495 Tasa Variable 6,493.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202412/11/202413.225 Tasa Variable 1,186,396.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202405/07/202412.395 Tasa Variable 25,081.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202420/09/202412.495 Tasa Variable 345,650.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202422/11/202413.225 Tasa Variable 2,088,886.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202419/07/202412.395 Tasa Variable 3,064,149.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202405/07/202412.395 Tasa Variable 175,553.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/05/202416/08/202412.495 Tasa Variable 2,118,199.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/05/202420/11/202411.345 Tasa Variable 5,017,332.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/05/202422/11/202411.345 Tasa Variable 5,011,029.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 108,037.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202410/07/202412.3965 Tasa Variable 13,153.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202420/09/202412.4965 Tasa Variable 221,072.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202424/09/202412.4965 Tasa Variable 432,234.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202409/09/202412.4965 Tasa Variable 125,738.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202422/11/202413.2265 Tasa Variable 720,381.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202425/11/202413.2265 Tasa Variable 25,024.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202429/07/202412.3965 Tasa Variable 61,526.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 487,852.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202422/07/202412.3965 Tasa Variable 44,115.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202412/08/202412.4965 Tasa Variable 33,449.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 120,408.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202417/09/202412.4965 Tasa Variable 72,045.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 523,902.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 6,000.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 9,049.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 70,409.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202425/07/202412.3965 Tasa Variable 125,639.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 90,986.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202425/09/202412.4965 Tasa Variable 214,869.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202425/11/202413.2265 Tasa Variable 18,843.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/05/202430/05/202910.42 Tasa Fija 40,370,488.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/202427/11/202411.3449 Tasa Variable 5,657,122.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/202429/08/202411.345 Tasa Variable 302,930.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202410/07/202412.395 Tasa Variable 216,871.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202405/07/202412.395 Tasa Variable 42,289.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202421/11/202413.225 Tasa Variable 6,830,192.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/10/202413.225 Tasa Variable 1,299,854.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/10/202413.225 Tasa Variable 82,895.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202411/07/202412.395 Tasa Variable 75,445.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202418/07/202412.395 Tasa Variable 480,764.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202405/07/202412.395 Tasa Variable 851,422.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202423/08/202412.495 Tasa Variable 549,454.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202423/09/202412.495 Tasa Variable 1,014,223.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/09/202412.495 Tasa Variable 637,450.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/09/202412.495 Tasa Variable 1,322,779.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202429/07/202412.395 Tasa Variable 260,095.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202419/07/202412.395 Tasa Variable 66,324.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202419/09/202412.495 Tasa Variable 81,503.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202423/09/202412.495 Tasa Variable 2,768,307.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/09/202412.495 Tasa Variable 27,510.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202426/08/202412.495 Tasa Variable 178,422.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202404/09/202412.495 Tasa Variable 159,479.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/202425/11/202411.345 Tasa Variable 5,009,454.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202422/07/202412.3965 Tasa Variable 88,955.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202408/07/202412.3965 Tasa Variable 164,131.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202429/07/202412.3965 Tasa Variable 985,782.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202429/07/202412.3965 Tasa Variable 69,746.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202420/08/202412.4965 Tasa Variable 16,065.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202409/09/202412.4965 Tasa Variable 204,140.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202423/09/202412.4965 Tasa Variable 365,719.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202426/08/202412.4965 Tasa Variable 74,549.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202429/07/20246.54608 Tasa Variable 161,008.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202409/09/20246.72565 Tasa Variable 57,766.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202426/07/202412.3965 Tasa Variable 60,093.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 70,075.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 49,060.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 6,360.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202430/08/202412.4965 Tasa Variable 114,336.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202423/09/202412.4965 Tasa Variable 317,657.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 894,931.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 1,953,721.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 55,690.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 879,212.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202426/08/202412.4965 Tasa Variable 62,053.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/10/202413.2265 Tasa Variable 16,748.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202425/07/202412.3965 Tasa Variable 8,147.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202410/07/202412.3965 Tasa Variable 141,425.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 770,971.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/07/202412.3965 Tasa Variable 80,805.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202430/08/202412.4965 Tasa Variable 19,748.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202424/09/202412.4965 Tasa Variable 106,289.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202419/08/202412.4965 Tasa Variable 782,782.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202404/09/202412.4965 Tasa Variable 95,780.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202405/08/202412.4965 Tasa Variable 57,376.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202417/10/202413.2265 Tasa Variable 22,687.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202401/07/20246.52981 Tasa Variable 17,104.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202422/07/20246.54284 Tasa Variable 615,357.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202402/09/202411.345 Tasa Variable 403,403.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202422/07/202412.395 Tasa Variable 37,246.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202415/07/202412.395 Tasa Variable 49,835.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202401/07/202412.395 Tasa Variable 430,370.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202430/08/202412.495 Tasa Variable 17,438.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 179,040.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 133,373.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 661,092.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 404,104.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 553,005.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202430/08/202411.345
Tasa Variable 4,034,035.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 76,703.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 5,085.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable 104,738.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable 20,322.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202429/04/202911.495
Tasa Variable 46,610,527.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202429/11/202411.345
Tasa Variable 2,722,973.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202429/11/202411.345
Tasa Variable 2,722,973.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202429/11/202411.345
Tasa Variable 2,722,973.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202429/11/202411.345
Tasa Variable 2,722,973.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/202402/12/202411.345
Tasa Variable 5,040,968.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202429/07/20246.53995 Tasa Variable 95,700.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 690,936.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202406/09/202412.495 Tasa Variable 6,445.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202426/08/202412.495 Tasa Variable 44,030.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 944,662.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 314,822.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/202402/12/202411.345
Tasa Variable 3,528,677.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202419/09/202412.495 Tasa Variable 219,680.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202426/08/202412.495 Tasa Variable 15,234.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 91,927.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable 1,803,907.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable 5,359.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 1,676,944.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/202431/01/202511.345
Tasa Variable 1,965,977.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/202424/03/202811.475
Tasa Variable 7,254,278.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202402/08/202412.395 Tasa Variable 721,457.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 59,579.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202427/09/202412.495 Tasa Variable 643,148.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202425/09/202412.495 Tasa Variable 71,959.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 21,894.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 263,946.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable 165,922.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202417/07/202412.395 Tasa Variable 540.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202405/07/202412.395 Tasa Variable 995,730.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202401/07/202412.395 Tasa Variable 864.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable 111,427.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 21,559.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202405/07/202412.395 Tasa Variable 53,234.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable 160,368.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 19,268.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable 3,867.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202425/11/202413.225 Tasa Variable 1,006,368.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202425/07/202412.395 Tasa Variable 31,040.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202427/09/202412.495 Tasa Variable 34,395.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202424/09/202412.495 Tasa Variable 75,608.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202423/09/202412.495 Tasa Variable 175,342.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 792,966.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 98,198.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 94,172.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202429/11/202413.225 Tasa Variable 1,873,527.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202405/09/202411.345 Tasa Variable 403,025.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202423/07/202412.395 Tasa Variable 319,353.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 217,247.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 621,567.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202427/09/202412.495 Tasa Variable 1,206,184.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 170,763.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 720,754.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 112,001.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 464,004.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202425/07/202412.395 Tasa Variable 542,729.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 59,980.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202430/09/202412.495 Tasa Variable 1,244,335.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202415/08/202412.495 Tasa Variable 317,599.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202402/09/202412.495 Tasa Variable 3,262.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 428,919.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202402/09/202412.495 Tasa Variable 2,030.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202428/11/202413.225 Tasa Variable 1,385,176.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 111,053.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202411/11/202411.345 Tasa Variable 6,037,816.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202412/11/202411.345 Tasa Variable 6,035,925.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202413/11/202411.345 Tasa Variable 6,034,035.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202404/12/202411.345 Tasa Variable 6,045,380.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202403/12/202411.345 Tasa Variable 6,045,380.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202402/12/202411.345 Tasa Variable 6,045,380.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202429/11/202411.345 Tasa Variable 6,045,380.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202428/11/202411.34 Tasa Variable 6,005,670.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202427/11/202411.3449 Tasa Variable 6,007,563.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202426/11/202411.345 Tasa Variable 6,009,454.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202425/11/202411.345 Tasa Variable 6,011,345.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202414/11/202411.345

Tasa Variable 6,032,144.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202415/11/202411.3475
Tasa Variable 6,026,477.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202419/11/202411.343
Tasa Variable 6,022,686.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202420/11/202411.345
Tasa Variable 6,020,799.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202421/11/202411.345
Tasa Variable 6,018,908.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202422/11/202411.345
Tasa Variable 6,013,235.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202405/08/20246.53444 Tasa Variable 142,651.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202405/08/202412.397 Tasa Variable 3,396,045.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202427/09/202412.497 Tasa Variable 353,624.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202430/09/202412.497 Tasa Variable 803,734.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202430/09/202412.497 Tasa Variable 602,231.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202404/09/202412.497 Tasa Variable 351,746.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202429/11/202413.227 Tasa Variable 1,903,438.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202402/12/202413.227 Tasa Variable 1,061.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202423/09/202412.497 Tasa Variable 218,458.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202404/10/202412.497 Tasa Variable 2,132,215.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202404/09/202412.497 Tasa Variable 39,075.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202426/07/202412.397 Tasa Variable 77,697.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202404/10/202412.497 Tasa Variable 157,564.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202425/10/202810.58 Tasa Fija 103,300,023.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202422/07/20246.53399 Tasa Variable 8,718,810.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable 469,767.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202430/09/202412.495 Tasa Variable 12,380.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 32,398.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202427/08/202412.495 Tasa Variable 50,139.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 265,647.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 316,534.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202421/11/202413.225 Tasa Variable 163,826.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 61,437.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202420/09/202412.495 Tasa Variable 28,476.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable 1,220,778.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202429/07/20246.54321 Tasa Variable 35,299.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202423/09/20246.70144 Tasa Variable 9,371,558.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 7,020,190.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 74,318.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202408/10/202412.495 Tasa Variable 534,921.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202402/09/202412.495 Tasa Variable 25,504.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 15,786.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202425/07/202412.395 Tasa Variable 4,035.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202427/09/202412.495 Tasa Variable 270,383.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202418/09/202412.495 Tasa Variable 79,839.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202412/08/202412.495 Tasa Variable 143,870.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 45,496.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 299,727.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 70,154.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 28,078.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 11,813.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 25,156.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202410/09/202411.345
Tasa Variable 4,023,950.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202412/06/202811.495
Tasa Variable 14,423,034.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,024,908.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,024,908.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,024,908.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202409/12/202411.345
Tasa Variable 5,029,938.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202411/09/202411.345
Tasa Variable 1,810,210.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202415/07/202412.395 Tasa Variable 123,583.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 19,222.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202423/08/202412.495 Tasa Variable 115,023.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202402/09/202412.495 Tasa Variable 89,657.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 329,227.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202406/12/202413.225 Tasa Variable 577,938.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 748,094.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 628,893.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 78,440.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 175,354.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202411/09/20240 Tasa Fija 3,000,000.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202409/12/202413.225 Tasa Variable 7,480.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 75,543.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202409/10/202412.495 Tasa Variable 145,398.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 175,728.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202409/12/202413.225 Tasa Variable 868.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202411/09/202411.345
Tasa Variable 20,113,450.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/06/202412/09/202411.345
Tasa Variable 452,410.81

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/06/202412/09/202411.345 Tasa Variable 1,809,643.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 136,020.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202425/07/202412.395 Tasa Variable 341,486.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/10/202412.495 Tasa Variable 750,251.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202410/10/202412.495 Tasa Variable 844,956.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 2,218,192.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 1,138,806.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202421/11/202413.225 Tasa Variable 5,557,413.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202408/07/202412.395 Tasa Variable 4,978.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 106,098.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 673.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/07/202412.395 Tasa Variable 403,996.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/08/202412.395 Tasa Variable 75,528.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 349,825.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 637,868.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 245,066.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202419/07/202412.395 Tasa Variable 380,855.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 80,645.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202407/10/202412.495 Tasa Variable 4,501,923.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/07/202412.395 Tasa Variable 54,965.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 155,857.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 1,559,037.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 135,701.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 1,551,641.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 56,993.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 21,582.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202427/09/202412.495 Tasa Variable 555,090.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 600,349.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202407/10/202412.495 Tasa Variable 163,988.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 34,003.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 289,873.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 91,825.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 136,150.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/06/202414/06/202911.515 Tasa Variable 4,563,118.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/06/202431/01/202511.345 Tasa Variable 1,115,946.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202415/07/20246.52884 Tasa Variable 81,823.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202412/08/20246.53922 Tasa Variable 301,340.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202430/09/20246.66988 Tasa Variable 176,910.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202409/08/202412.3975 Tasa Variable 30,803.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202402/08/202412.3975 Tasa Variable 55,469.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202412/08/202412.3975 Tasa Variable 17,547.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202406/09/202412.4975 Tasa Variable 97,565.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202411/10/202412.4975 Tasa Variable 334,482.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202407/10/202412.4975 Tasa Variable 347,353.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/09/202412.4975 Tasa Variable 1,363.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/10/202412.4975 Tasa Variable 187,657.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202413/12/202411.3475 Tasa Variable 20,088,258.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202412/08/202412.3975 Tasa Variable 129,902.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202423/07/202412.3975 Tasa Variable 255,638.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202412/08/202412.3975 Tasa Variable 243,427.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202427/09/202412.4975 Tasa Variable 73,324.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202407/10/202412.4975 Tasa Variable 187,426.88

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/10/202412.4975 Tasa Variable 477,450.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/10/202412.4975 Tasa Variable 122,553.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/11/202413.2275 Tasa Variable 110,920.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/10/202412.4975 Tasa Variable 21,197.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202404/09/202412.4975 Tasa Variable 79,612.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202418/07/202412.395 Tasa Variable 8,960.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 2,693.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202405/07/202412.395 Tasa Variable 10,193.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202411/10/202412.495 Tasa Variable 757,657.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 4,080,212.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/06/202413/09/202411.345 Tasa Variable 1,807,374.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/06/202413/12/202411.345 Tasa Variable 80,327,744.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/06/202413/09/202411.345 Tasa Variable 401,638.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 153,481.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202407/10/202412.495 Tasa Variable 202,653.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 437,413.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202402/09/202412.495 Tasa Variable 15,840.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 33,927.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 287,802.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 11,069.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202409/12/202413.225 Tasa Variable 321,630.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 406,119.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/06/202411/12/202413.225 Tasa Variable 1,879,906.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/06/202403/12/202411.345 Tasa Variable 12,551,210.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202409/08/202412.393 Tasa Variable 61,773.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202411/10/202412.493 Tasa Variable 249,242.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202409/09/202412.493 Tasa Variable 21,909.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202404/09/202412.493 Tasa Variable 40,760.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202417/09/202411.343 Tasa Variable 1,806,805.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202429/07/202412.393 Tasa Variable 112,741.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202408/07/202412.393 Tasa Variable 12,999.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202405/08/202412.393 Tasa Variable 164.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202419/08/202412.493 Tasa Variable 435.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202417/09/202411.343 Tasa Variable 20,075,620.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202404/10/202412.493 Tasa Variable 245,075.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202404/10/202412.493 Tasa Variable 23,473.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/06/202404/11/202413.223 Tasa Variable 8,827.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202404/12/202411.343 Tasa Variable 12,547,262.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202417/09/202411.343 Tasa Variable 3,011,343.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202418/09/202411.345 Tasa Variable 1,806,239.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202405/07/202412.395 Tasa Variable 166,195.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 36,913.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 356,704.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202413/12/202413.225 Tasa Variable 1,008,372.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202416/12/202413.225 Tasa Variable 5,998.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 51,046.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 517,238.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202415/07/202412.395 Tasa Variable 42,513.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 2,963,061.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 28,665.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 1,397,550.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202416/12/202413.225 Tasa Variable 4,397.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202402/12/202411.345
Tasa Variable 7,024,265.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 22,698.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202406/08/202412.395 Tasa Variable 1,130,842.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202416/10/202412.495 Tasa Variable 217,705.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 1,592.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 144,962.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 323.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202405/12/202411.345
Tasa Variable 15,051,997.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202409/06/202511.345
Tasa Variable 10,034,665.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202410/06/202511.345
Tasa Variable 10,034,665.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202411/06/202511.345
Tasa Variable 10,034,665.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202419/09/202411.345
Tasa Variable 401,260.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202419/09/202411.345
Tasa Variable 902,836.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202404/12/202411.345
Tasa Variable 7,022,059.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 440,954.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202401/07/202412.395 Tasa Variable 55,852.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 411,516.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202419/07/202412.395 Tasa Variable 401,683.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 229,829.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202425/07/202412.395 Tasa Variable 619,775.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 233,640.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202401/07/202412.395 Tasa Variable 18,916.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202417/10/202412.495 Tasa Variable 285,770.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202426/08/202412.495 Tasa Variable 4,175.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 188,406.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 1,110,251.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 46,995.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 64,860.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202428/11/202413.225 Tasa Variable 5,660,210.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202406/12/202411.345
Tasa Variable 12,539,392.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 446,277.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 792,520.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 94,934.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202414/10/202412.495 Tasa Variable 5,279,765.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 501,440.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202417/09/202412.495 Tasa Variable 48,063.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202414/10/202412.495 Tasa Variable 624,998.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 235,367.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 74,412.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202417/09/202412.495 Tasa Variable 194,708.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202416/12/202413.225 Tasa Variable 88,044.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 88,000.51

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202418/10/202411.345 Tasa Variable 1,003,151.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/202404/12/202411.345 Tasa Variable 3,009,454.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/06/202420/12/202411.345 Tasa Variable 20,044,119.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/06/202406/12/202411.345 Tasa Variable 10,022,059.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202419/08/20246.54746 Tasa Variable 201,993.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202412/08/20246.54746 Tasa Variable 117,075.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 19,569.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 22,610.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 181,492.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 54,656.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 59,866.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 324,671.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 2,727.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202422/07/202412.395 Tasa Variable 7,885.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202427/08/202412.495 Tasa Variable 1,808.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202426/08/202412.495 Tasa Variable 160,843.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 89,663.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 836,415.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 179,780.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 159,901.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 59,375.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202423/08/202412.395 Tasa Variable 35,313.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202412/07/202412.395 Tasa Variable 5,866,615.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202430/08/202412.495 Tasa Variable 11,464.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 22,423.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 1,853,360.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 279,947.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202420/09/202411.345 Tasa Variable 20,037,816.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202419/08/20246.54455 Tasa Variable 385,732.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202414/10/20246.67558 Tasa Variable 104,081.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 5,574.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 34,427.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202417/10/202412.495 Tasa Variable 75,641.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202425/09/202412.495 Tasa Variable 673,997.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 111,169.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 79,402.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 431,308.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202423/09/202411.345 Tasa Variable 450,850.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202412/08/202412.395 Tasa Variable 7,724.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202416/08/202412.395 Tasa Variable 78,574.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 512,464.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202415/07/202412.395 Tasa Variable 8,952.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202430/09/202412.495 Tasa Variable 46,681.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 145,206.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 31,652.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202409/12/202413.225 Tasa Variable 833,833.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable 32,115.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202423/09/202411.345 Tasa Variable 1,001,890.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202405/07/202412.395 Tasa Variable 21,319.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 1,434,047.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202409/12/202411.345 Tasa Variable 10,018,908.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202429/07/202412.395 Tasa Variable 13,715.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202418/10/202412.495 Tasa Variable 305,869.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202417/09/202412.495 Tasa Variable 18,322.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 134,418.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 1,115,687.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202423/08/202412.395 Tasa Variable 814,463.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202430/08/202412.495 Tasa Variable 199,191.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/09/202412.495 Tasa Variable 78,394.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 291,557.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 348,734.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202409/09/202412.495 Tasa Variable 3,507.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202426/07/202412.395 Tasa Variable 12,587.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202419/08/202412.395 Tasa Variable 135,935.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202405/08/202412.395 Tasa Variable 169,327.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202411/10/202412.495 Tasa Variable 604,274.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202414/10/202412.495 Tasa Variable 5,026,371.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 336,867.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 11,724.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable 462,454.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202424/12/202411.3449 Tasa Variable 24,030,253.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202405/08/202412.3949 Tasa Variable 222,604.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202405/08/202412.3949 Tasa Variable 440,647.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202405/08/202412.3949 Tasa Variable 532,647.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202423/10/202412.4949 Tasa Variable 260,661.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202417/09/202412.4949 Tasa Variable 3,132.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 198,783.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 2,005,865.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 1,129.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202417/09/202412.4949 Tasa Variable 17,415.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202423/12/202413.2249 Tasa Variable 41,867.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202415/07/20246.54594 Tasa Variable 20,690.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202422/07/20246.54594 Tasa Variable 8,848.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202423/09/202411.3449 Tasa Variable 20,025,210.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202406/09/20246.53939 Tasa Variable 51,963.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202412/07/202412.3949 Tasa Variable 98,810.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202426/08/202412.3949 Tasa Variable 23,359.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202405/08/202412.3949 Tasa Variable 42,215.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202423/09/202412.4949 Tasa Variable 1,530,145.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 93,547.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 791,548.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202413/12/202413.2249 Tasa Variable 525,035.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202423/12/202413.2249 Tasa Variable 715.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/11/202413.2249 Tasa Variable 25,937.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202405/08/202412.3949 Tasa Variable 19,562.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202408/10/202412.4949 Tasa Variable 36,009.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 222,217.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 25,739.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 125,892.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202404/10/202412.4949 Tasa Variable 9,392.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/202425/09/202411.3449 Tasa Variable 2,002,521.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202423/08/202412.39 Tasa Fija 12,404.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202426/08/202412.39 Tasa Fija 536,670.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202419/08/202412.39 Tasa Fija 402,158.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202406/09/202412.49 Tasa Fija 2,438.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202424/10/202412.49 Tasa Fija 378,953.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202414/10/202412.49 Tasa Fija 1,238,325.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202429/07/202412.39 Tasa Fija 18,470.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202416/08/202412.39 Tasa Fija 1,585,338.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202426/08/202412.39 Tasa Fija 1,162,411.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202405/08/202412.39 Tasa Fija 786,056.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202405/08/202412.39 Tasa Fija 12,718.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202405/08/202412.39 Tasa Fija 18,081.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202406/09/202412.49 Tasa Fija 406.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202423/09/202412.49 Tasa Fija 127,174.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202421/10/202412.49 Tasa Fija 3,611,598.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 1,312,035.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 1,213,304.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 114,361.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 1,653.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202423/09/202412.49 Tasa Fija 23,008.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202408/08/202412.39 Tasa Fija 545,712.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202412/09/202412.49 Tasa Fija 3,378,000.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202419/12/202413.22 Tasa Fija 4,233,032.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202426/08/202412.39 Tasa Fija 56,819.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202426/08/202412.39 Tasa Fija 1,635,935.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202411/10/202412.49 Tasa Fija 1,083,595.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202425/10/202412.49 Tasa Fija 84,938.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202421/10/202412.49 Tasa Fija 446,379.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 94,208.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 25,176.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202404/10/202412.49 Tasa Fija 112,422.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 8,807,825.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 2,911,602.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.3475 Tasa Variable 884,588.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.345 Tasa Variable 1,251,969.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.3475 Tasa Variable 611,041.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.3475 Tasa Variable 8,332,907.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.3475 Tasa Variable 552,943.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.345 Tasa Variable 1,423,291.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.345 Tasa Variable 72,191.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.78129 Tasa Variable 3,620,836.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa Fija 1,035,879.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.345 Tasa Variable 2,519,696.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.3475

Tasa Variable 2,693,333.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.3475 Tasa Variable 2,377,763.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.3449 Tasa Variable 750,945.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 779,736.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 2,264,380.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 1,830,673.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.345 Tasa Variable 1,385,399.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.345 Tasa Variable 345,998.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66 Tasa Fija 2,447,018.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.345 Tasa Variable 35,795.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.345 Tasa Variable 2,004,411.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.345 Tasa Variable 4,006,302.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3449 Tasa Variable 8,861,155.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3465 Tasa Variable 10,100,857.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3449 Tasa Variable 9,011,344.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.3449 Tasa Variable 9,011,344.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 74,563.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 577,201.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.345 Tasa Variable 58,979.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77 Tasa Fija 9,348,292.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.345 Tasa Variable 4,532,363.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 708,445.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 911,634.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.345 Tasa Variable 2,507,878.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 370,559.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.345 Tasa Variable 2,507,878.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.345 Tasa Variable 6,551,209.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.345 Tasa Variable 56,612.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.345

Tasa Variable 215,927.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.3465
Tasa Variable 49,301,805.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.345
Tasa Variable 39,975,033.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.345
Tasa Variable 524,305.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.345
Tasa Variable 52,163,872.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.3465
Tasa Variable 6,725,500.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.345
Tasa Variable 392,085.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.345
Tasa Variable 87,179.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.347
Tasa Variable 130,881,600.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.347
Tasa Variable 50,029,068.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.347
Tasa Variable 8,236,121.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.345
Tasa Variable 3,887,611.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.345
Tasa Variable 51,753,938.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 1,077,991.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 8,831,098.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.3475
Tasa Variable 470,818.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa
Fija 241,059.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.345
Tasa Variable 6,474,918.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.34 Tasa
Variable 986,584.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.3475
Tasa Variable 1,150,889.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.345
Tasa Variable 115,398,650.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 5,794,260.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.6498
Tasa Variable 1,040,514.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 5,456,731.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 86,871,962.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 95,366,647.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 107,424,864.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.3475
Tasa Variable 460,355.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.347

Tasa Variable 1,822,151.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 2,040,482.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.3465 Tasa Variable 61,817,249.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.345 Tasa Variable 228,942,470.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.345 Tasa Variable 77,171,619.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202611.345 Tasa Variable 7,881,116.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202611.345 Tasa Variable 937,062.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa Fija 6,294,063.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202611.3475 Tasa Variable 222,075,444.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202611.347 Tasa Variable 139,999,449.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 3,323,528.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 25,159,090.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa Fija 25,159,090.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202611.345 Tasa Variable 8,295,912.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 830,315.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa Fija 1,280,117.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 9,664,660.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa Fija 25,970,876.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202411.345 Tasa Variable 629,199.17

TOTAL 12,634,242,581.76 1,795,735,189.20 3,632,401,898.19 1,763,719,633.13 3,692,524,070.15 2,987,712,141.80 97,466,122.96 85,057,422.71 53,231,925.30 159,288,102.43 290,175,979.87 289,873,883.07
Total bancarios 12,634,242,581.76 1,795,735,189.20 3,632,401,898.19 1,763,719,633.13 3,692,524,070.15 2,987,712,141.80 5,137,149,958.27 2,842,351,616.82 53,231,925.30 159,288,102.43 290,175,979.87 289,873,883.07
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]

Bursátiles listadas en bolsa (quirografarios)
CEBUR_94_SCOTIAB_23No18/08/202302/03/202611.297,125,499,300
CEBUR_94_SCOTIAB_24No26/02/202425/02/202711.575,189,390,200
CEBUR_94_SCOTIAB_24-2No26/02/202417/02/20319.741,008,708,700
CEBUR_94_SCOTIAB_24-2No23/02/202417/02/20319.743,801,901,100
PRLV_I_BSCTIA_24271No06/07/202301/07/202411.47 46,653,082
PRLV_I_BSCTIA_24272No04/01/202402/07/202411.52 1,558,337
PRLV_I_BSCTIA_24272No04/01/202402/07/202411.52 103,355,711
PRLV_I_BSCTIA_24281No12/10/202308/07/202411.75 54,312,508
PRLV_I_BSCTIA_24291No20/07/202315/07/202411.36 29,637,768
PRLV_I_BSCTIA_24291No16/01/202415/07/202411.55 528,658,302
PRLV_I_BSCTIA_24292No18/01/202416/07/202411.43 72,555,677
PRLV_I_BSCTIA_24301No26/10/202322/07/202411.82 54,406,253
PRLV_I_BSCTIA_24302No25/01/202423/07/202411.46 11,994,582
PRLV_I_BSCTIA_24302No25/01/202423/07/202411.46 116,474,644
PRLV_I_BSCTIA_24311No03/08/202329/07/202411.45 55,730,850
PRLV_I_BSCTIA_24311No30/01/202429/07/202411.43 83,796,077
PRLV_I_BSCTIA_24322No08/02/202406/08/202411.52 29,907,979
PRLV_I_BSCTIA_24322No08/02/202406/08/202411.52 163,354,891
PRLV_I_BSCTIA_24324No13/03/202408/08/202411.35 313,875,014
PRLV_I_BSCTIA_24331No13/02/202412/08/202411.46 137,744,131
PRLV_I_BSCTIA_24332No15/02/202413/08/202411.46 3,537,600
PRLV_I_BSCTIA_24332No15/02/202413/08/202411.46 49,315,723
PRLV_I_BSCTIA_24343No23/02/202421/08/202411.49 62,433,965
PRLV_I_BSCTIA_24351No31/08/202326/08/202411.55 55,775,985
PRLV_I_BSCTIA_24351No30/11/202326/08/202411.56 266,522,972
PRLV_I_BSCTIA_24352No29/02/202427/08/202411.40 5,807,500
PRLV_I_BSCTIA_24352No29/02/202427/08/202411.40 64,297,738
PRLV_I_BSCTIA_24372No14/03/202410/09/202411.36 143,994,691
PRLV_I_BSCTIA_24382No21/03/202417/09/202411.32 22,038,835
PRLV_I_BSCTIA_24412No11/04/202408/10/202411.30 4,804,697
PRLV_I_BSCTIA_24412No11/04/202408/10/202411.30 207,703,168
PRLV_I_BSCTIA_24414No12/10/202310/10/202411.80 55,839,164
PRLV_I_BSCTIA_24434No26/10/202324/10/202411.85 55,955,424
PRLV_I_BSCTIA_24452No09/05/202405/11/202411.27 527,674
PRLV_I_BSCTIA_24452No09/05/202405/11/202411.27 86,487,449
PRLV_I_BSCTIA_24472No22/05/202419/11/202411.30 3,804,529
PRLV_I_BSCTIA_24472No23/02/202419/11/202411.46 54,222,480
PRLV_I_BSCTIA_24472No22/05/202419/11/202411.30 107,400,975
PRLV_I_BSCTIA_24475No27/02/202422/11/202411.40 57,380,230
PRLV_I_BSCTIA_24482No30/05/202426/11/202411.30 45,386,489
PRLV_I_BSCTIA_24482No30/05/202426/11/202411.30 113,019,644
PRLV_I_BSCTIA_24512No20/06/202417/12/202411.40 18,649,465
PRLV_I_BSCTIA_24512No20/06/202417/12/202411.40 166,156,236
PRLV_I_BSCTIA_24515No21/12/202320/12/202411.45 90,981,604
PRLV_I_BSCTIA_24522No26/12/202324/12/202411.45 468,935,725
PRLV_I_BSCTIA_25075No27/05/202421/02/202511.32 58,927,630
PRLV_I_BSCTIA_25075No23/02/202421/02/202511.35 222,755,007
PRLV_I_BSCTIA_25145No12/04/202411/04/202511.35 11,127,385
PRLV_I_BSCTIA_25162No23/04/202422/04/202511.42 177,061,082
PRLV_I_BSCTIA_25171No29/04/202428/04/202511.50 60,621,031

TOTAL 4,014,995,768.00 530,492,135.00 7,125,499,300.00 5,189,390,200.00 - 4,810,609,800.00 - - - - - -
Bursátiles listadas en bolsa (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Colocaciones privadas (quirografarios)
CEDES_F_BSCTIA_23019No24/11/202311/11/202411.27 2,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_23020No29/11/202331/10/202411.27 2,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_23021No30/11/202331/10/202411.27 600,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_23022No30/11/202331/10/202411.27 1,500,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_23025No14/12/202315/11/202411.26 1,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_23026No15/12/202302/12/202411.27 2,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24001No30/04/202429/04/202511.27 4,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24002No23/05/202422/05/202511.26 500,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24003No24/05/202412/05/202511.26 2,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24004No27/05/202429/04/202511.26 500,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24005No27/05/202404/02/202511.25 700,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24006No27/05/202429/04/202511.26 1,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24007No31/05/202407/02/202511.26 1,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24008No31/05/202402/05/202511.26 1,000,000,000.00
CEDES_F_BSCTIA_24009No31/05/202402/05/202511.26 1,000,000,000.00
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_14No18/12/201405/12/20247.40 2,093,000,000.00
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18No28/06/201809/06/203312.30 3,360,000,000.00
Obligaciones SubordinadasQ_SCOTIAS_18-2No11/09/2018PERPETUO11.32 3,455,000,000.00
TOTAL 11,193,000,000.00 11,700,000,000.00 - - - 6,815,000,000.00 - - - - - -
Colocaciones privadas (con garantía)

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas 15,207,995,768.00 12,230,492,135.00 7,125,499,300.00 5,189,390,200.00 - 11,625,609,800.00 - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Proveedores [sinopsis]
Proveedores

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total proveedores - - - - - - - - - - - -
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - - - - - - - - -
Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - - - - - - - - -
Total de créditos27,842,238,349.7614,026,227,324.2010,757,901,198.196,953,109,833.133,692,524,070.1514,613,321,941.805,137,149,958.272,842,351,616.8253,231,925.30159,288,102.43290,175,979.87289,873,883.07

Comentarios:
El tipo de cambio tomado al cierre de junio es de 18.2862

"VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF"

Instrumentos
Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA
A) DISCUSIÓN SOBRE LAS POLÍTICAS DE USO DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.
Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.
Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.
Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.
El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo a las políticas establecidas.
Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:
1) Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo

con su perfil de riesgo.
2)Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
3)Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
4)Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.
Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:
1)Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.
2)Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.
3)Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.
La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.
1)Manual de Operación de Derivados.
2)Política de Administracion de Riesgo de Mercado y Estructural.
3)Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).
4)Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas
5)Política de Riesgo de Contraparte
6)Política de Sobregiros
Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.
SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 “Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura”, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.
Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:
Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado
1.Flujos de EfectivoPagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija PasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las

variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
3.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotanteActivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.Valor RazonableCartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o ExtranjeraActivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.Flujos de EfectivoCertificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.Valor RazonableBonos de tasa fija en moneda funcionalPasivaCobertura ante una posible baja en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.Flujos de EfectivoReportosPasivaCobertura ante una posible alza en las tasas de interésSwap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm.Tipo de CoberturaPosición CubiertaTipo de posición cubiertaCondición de MercadoDerivado
8.Flujos de EfectivoCartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjeraActiva Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXNCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional
9.Flujo de EfectivoBonos de tasa fija en moneda extranjeraActivaCubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesosCross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.
El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.
Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.
Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:
•El modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
•El modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
•El modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados).
•El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.
Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.
Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.
Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.
Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:
•Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.
•Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.
•Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades.
•Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.
•Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.
Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:
•Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo.
•Diversificar fuentes de fondeo.
•Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.
•Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

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

Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	70,772	79,257
Liquidity Buffer	149,058	137,367

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

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

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader’s mark
Correlation
Dividend
Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER
FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,
MXN,PEN,AUD,EUR,
JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER
FX Rate
Surface
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER
FX Rate
Surface
Price
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,
BRL,CLP,COP,PEN,
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO
ProductoSubyacenteMonedaMódelo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,
EUR,JPY PricePriceVALMER

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

estableciendo:
TIPOS DE OPERACIÓN QUE SON OFRECIDOS EN FUNCIÓN AL TIPO DE ACREDITADO
a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:
•Necesidades de tesorería del Banco
•Relación de corresponsalía
•Límites recíprocos
b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:
•Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.
c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:
•Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.
PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO
1)Tesorería: Call Money
2)Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores
3)Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
4)Cambios: FOREX
5)Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
6)Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
7)Metales
SUJETOS DE CRÉDITO
Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:
•Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
•Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
•Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
•Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público
REGLAS PARTICULARES
Metodología utilizada para el consumo de Líneas:
•La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al “Potential Future Exposure”.
•La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
•Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.
•La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.
IDONEIDAD DEL CLIENTE
La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:
•El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar
•Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.
Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.
POLÍTICAS DE VAR
Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las

posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.
Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.
B)DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN
MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:
CÁLCULO DE SENSIBILIDADES
La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L).
Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.
PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)
Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).
Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.
BONOS DE TASA FLOTANTE
En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.
Con metodología se asume que la repreciación ocurre justamente al pago de cupón.
BONOS CUPÓN CERO
Para el cómputo de la sensibilidad de instrumentos cupón cero, se utiliza el mismo sistema utilizado en instrumentos de tasa fija.
RIESGO DE CRÉDITO
También se utiliza el concepto de duración, pero en el caso de los instrumentos de tasa flotante se utiliza la duración total de instrumento en lugar de la "duración al próximo cupón".
SENSIBILIDAD DEL PASIVO
Gran parte del portafolio de trading de la institución se encuentra fondeado con reportos. Para efectos de determinar cuál es la sensibilidad de la parte corta (el financiamiento) de las posiciones, se determina el cambio del valor del portafolio ante un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).
DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS
SWAPS DE TASA DE INTERÉS
Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos

base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.
En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back
FUTUROS DE TIIE
Se considera la duración para estimar su sensibilidad.
FUTUROS DE BONO M
Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.
FUTUROS DE CETE
El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.
EFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:
Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.
Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios mensuales históricos, es decir una ventana de observación de cinco años con base en un análisis de regresión.
Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos). Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:
Grado de relación entre los cambios observados: $R2 \geq 80\%$.
Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].
Significancia de la regresión: $F > 5$.
Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de junio 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas. Durante el segundo trimestre de 2024 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.
La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.
COBERTURA DE FLUJOS DE EFECTIVO:
La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de “Otro Resultado Integral” (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como inefectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.
El componente que forma parte de “Otro Resultado Integral” asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia

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

COBERTURA DE VALOR RAZONABLE:

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

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

En adición, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia o 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 2024 y promedio del segundo trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank- (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	149,058	137,367

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market
En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.
Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:
Scotiabank
(millones de pesos)NormalEscenario
PosibleEscenario
ProbableEscenario
Estrés
Gap 30d Gap Acum70,77267,14867,09867,048
Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,624)(3,674)(3,724)

D)ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD Y CAMBIOS EN EL VALOR RAZONABLE.
Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.
El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.
DELTA
La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.
Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.
Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.
Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.
GAMMA
El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y

análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto el subyacente.
Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas gamma1 y gamma5.-
Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.
VEGA
Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente.
Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.
Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.
RHO
Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).
RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.
THETA
Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.
Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.
DIVIDEND RISK
La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.
El riesgo de dividendos no tiene una letra “griega” asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA
Cifras expresadas en pesos
A)ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.
Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Junio 28, 2024:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(29,848.00)	(75,696.00)	267,578.00	270,359.00	71,752.00	(13,169.00)	490,976.00
CCS	1,884.00	30.00	(94.00)	346.00	593.00	(17.00)	2,742.00
Caps&Floors	320.00	(75.00)	(2,489.00)	1,396.00	(14.00)	(1.00)	(863.00)
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total DERIVATIVES	(27,644.00)	(75,741.00)	264,995.00	272,101.00	72,331.00	(13,187.00)	

492,855.00

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD
SUPUESTOS DE CÁLCULO.
Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.
Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.
Los impactos en los estados de resultados son:
a)Bajo el escenario probable una pérdida de (30.49) Millones de pesos.
b)Con escenario poco probable un P&L de (61.01) Millones de pesos.
c)Y finalmente con el escenario muy poco probable (127.88) Millones de pesos.
Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.
Tipo SensibilidadInstrumentoSensibilidadMTMProbable
Shock
(+/-)P&LStress 1
Shock
(+/-)P&LStress 2
Shock
(+/-)P&L
- 1pb a la tasaFuturos de TIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-
- 1pb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps0.49578.4350.00(24.64)100.00(49.29)200.00
(98.57)
Volatilidad al 1%Caps &Floors(0.12)3.580.10(0.01)0.40(0.05)1.00(0.12)
a FX %Forwards3.1958.380.10(5.84)0.20(11.67)0.50(29.19)
a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50-
Total (30.49) (61.01) (127.88)

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 28 de junio de 2024 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).
OpcionesDeltaVegaGamma
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX89,149.002,632.0021,224.00
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---

Total89,149.002,632.0021,224.00

Análisis de Stress
Los escenarios de stress a la baja; probable (10%), poco probable (30%) y muy poco probable (50%) son los siguientes:
Escenarios a la baja(0.1)(0.3)(0.5)
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX(8,914.90)(26,744.70)(44,574.50)
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total(8,914.90)(26,744.70)(44,574.50)

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:
Escenarios al alza0.050.150.2
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX4,457.4513,372.3517,829.80
Options EEM.P---
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options SHELL.AS---
Options SLB.N---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Options VLO.N---
Total4,457.4513,372.3517,829.80

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5%, 15% y 20% de escenarios al alza.
Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:
EscenarioMonto
Probable(8,914.90)
Poco Probable(26,744.70)
Muy poco Probable(44,574.50)

DESCRIBIR Y NUMERAR LAS LLAMADAS DE MARGEN QUE SE HAYAN PRESENTADO DURANTE EL TRIMESTRE
Respecto a las llamadas de margen, al 28 de junio de 2024 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USD Colateral Enviado USD
CLIENTE 1--11,595,000(6,240,000)
CLIENTE 2672,000,000(355,000,000)--
CLIENTE 3---(1,895,000)
CLIENTE 4--6,220,000(605,000)
CLIENTE 54,500,000(16,400,000)--
CLIENTE 63,116,600,545(218,900,000)69,150,000(55,825,000)
CLIENTE 7--34,640,000(19,030,000)
CLIENTE 8--40,900,000(91,210,000)
CLIENTE 9--207,300,000(175,200,000)
CLIENTE 10--260,000-
SUBTOTAL3,793,100,545(590,300,000)370,065,000(350,005,000)

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USD Colateral Enviado USD
CLIENTE 11--15,460,000(3,320,000)
CLIENTE 12---(100,000)
CLIENTE 13--12,530,000(31,030,000)
CLIENTE 14---(560,000)
CLIENTE 1541,500,000(68,300,000)--
CLIENTE 16709,600,000(432,500,000)--
CLIENTE 17155,200,000(260,900,000)71,190,000(123,460,000)
CLIENTE 18658,308,922(276,525,535)--
CLIENTE 191,200,000---
CLIENTE 205,100,000(43,300,000)--
CLIENTE 21--2,440,000(3,320,000)
CLIENTE 22--580,000(1,710,000)
CLIENTE 23--500,000(1,270,000)
CLIENTE 24--15,570,000(30,280,000)
TOTAL5,364,009,467(1,671,825,535)488,335,000(545,055,000)

REVELACIÓN DE CUALQUIER INCUMPLIMIENTO QUE SE HAYA PRESENTADO A LOS CONTRATOS RESPECTIVOS
ProductoFechaClienteDivisaMontoMotivo del incumplimiento
Interest Rate Swap01/04/2024Cliente 1MXN(1,269,343)En espera de Instrucción
Interest Rate Swap01/04/2024Cliente 2MXN(853,895)En espera de Instrucción
Forward01/04/2024Cliente 3MXN129,182En espera de Instrucción
Forward01/04/2024Cliente 4MXN135,607En espera de Instrucción
Forward03/04/2024Cliente 5MXN3,937,537No fondeo su cuenta
Opcion EQ15/04/2024Cliente 6MXN254,100No reconoce la operación
Opcion EQ16/04/2024Cliente 7MXN241,088No reconoce la operación
Forward19/04/2024Cliente 8MXN3,392,080No fondeo su cuenta
Forward19/04/2024Cliente 9MXN6,161,930No fondeo su cuenta
Interest Rate Swap29/04/2024Cliente 10MXN(1,026,414)En espera de Instrucción
Forward17/05/2024Cliente 11USD31,200Banco Corresponsal no envío los fondos
Forward17/05/2024Cliente 12USD31,200Banco Corresponsal no envío los fondos
CAP17/05/2024Cliente 13MXN11,322No envio los fondos
Interest Rate Swap27/05/2024Cliente 14MXN439,519No envio los fondos
Interest Rate Swap29/05/2024Cliente 15MXN(1,089,826)En espera de Instrucción
Interest Rate Swap12/06/2024Cliente 16MXN406,000No envio los fondos
Opcion FX13/06/2024Cliente 17USD(50,000)Pago fuera de horario
Opcion FX13/06/2024Cliente 18USD(250,000)Pago fuera de horario
Forward18/06/2024Cliente 19MXN52,691,300No recibimos los fondos
Opcion FX21/06/2024Cliente 20EUR873No envio los fondos
Interest Rate Swap26/06/2024Cliente 21MXN273,583No envio los fondos

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

Cifras expresadas en pesos

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
Cifras expresadas en pesos

"VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF"