



# Scotiabank Inverlat

**Scotiabank**

Scotiabank-Indicadores Financieros	T1 2022	T2 2022
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	20.0%	15.7%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	2.1%	1.7%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	4.7%	3.6%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.7%	2.3%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.7%	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.)	96.4%	95.2%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	19.87%	20.70%*
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	16.41%	16.50%*
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	42.0%	45.9%

\* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank- Información Financiera  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
Ingresos por intereses	12,030	13,144	9%	25,174
Gastos por intereses	(6,045)	(6,984)	-16%	(13,029)
<b>Margen Financiero</b>	<b>5,985</b>	<b>6,160</b>	<b>3%</b>	<b>12,145</b>
Comisiones	1,002	1,023	2%	2,025
Resultado por Intermediación	379	464	22%	843
OI OE	135	178	32%	313
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,516</b>	<b>1,665</b>	<b>10%</b>	<b>3,181</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>7,501</b>	<b>7,825</b>	<b>4%</b>	<b>15,326</b>
Gastos de Administración y Promoción	(4,474)	(3,870)	14%	(8,344)
<b>PTPP</b>	<b>3,027</b>	<b>3,955</b>	<b>31%</b>	<b>6,982</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	1,430	(391)	> -100%	1,039
Resultado de la Operación	4,457	3,564	-20%	8,021
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	58	0%	58
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>4,457</b>	<b>3,622</b>	<b>-19%</b>	<b>8,079</b>
Impuestos a la Utilidad	(1,008)	(760)	25%	(1,768)
<b>Resultado Neto</b>	<b>3,449</b>	<b>2,862</b>	<b>-17%</b>	<b>6,311</b>
Otros Resultados Integrales				
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(49)	(108)	> -100%	(157)
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	357	201	-44%	558
Remediación de beneficios definidos a los empleados	(4)	14	> +100%	10
<b>Resultado Integral</b>	<b>3,753</b>	<b>2,969</b>	<b>-21%</b>	<b>6,722</b>

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

La utilidad neta del segundo trimestre de 2022 se ubicó en \$2,862 millones, una disminución de \$835 millones o 17% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en la cartera; compensados parcialmente con una optimización en gastos de personal, menores impuestos a la utilidad, mayores ingresos no financieros, así como un mayor margen financiero.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio de 2022 se ubicó en \$6,311 millones; la cual se integra principalmente por ingresos en margen financiero e ingresos no financieros, así como por liberación de reservas en la cartera; compensados parcialmente por gastos de administración y promoción e impuestos a la utilidad.

## Ingresos no Financieros

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
Actividades Fiduciarias	65	53	-18%	118
Apertura de Cuenta	4	4	0%	8
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	57	50	-12%	107
Cheques Certificados	1	-	-100%	1
Cheques de caja	-	1	0%	1
Compraventa de instrumentos financieros	-	1	0%	1
Manejo de Cuenta	83	89	7%	172
Operaciones de Crédito	391	391	0%	782
Otras Comisiones y Tarifas	330	361	9%	691
Servicios de Banca Electrónica	44	45	2%	89
Transferencia de Fondos	27	28	4%	55
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,002</b>	<b>1,023</b>	<b>2%</b>	<b>2,025</b>

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(14)	(17)	-21%	(31)
Aportaciones al IPAB	(502)	(492)	2%	(994)
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	83	49	-41%	132
Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados	(4)	(4)	0%	(8)
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	-	1	0%	1
Ingresos por Arrendamiento	72	(61)	> -100%	11
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a Funcionarios y Empleados	29	32	10%	61
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	851	730	-14%	1,581
Quebrantos	(405)	(71)	82%	(476)
Recuperaciones	3	3	0%	6
Resultado en Venta de Bienes Adjudicados	22	8	-64%	30
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>135</b>	<b>178</b>	<b>32%</b>	<b>313</b>

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

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

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>1,430</b>	<b>(391)</b>	<b>&gt; -100%</b>	<b>1,039</b>

En el segundo trimestre de 2022, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$391 millones, un incremento de \$1,821 millones respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en la cartera total.

La Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios acumulada al cierre de junio de 2022 mostró un beneficio de \$1,039 millones, integrado principalmente por menores requerimientos de reservas en la cartera comercial y consumo; compensada parcialmente por mayores requerimientos de reservas en la cartera hipotecaria, tarjeta de crédito y automotriz.

## Gastos de Administración y Promoción

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

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
Gastos de Personal	(2,402)	(1,773)	26%	(4,175)
Gastos de Operación	(2,072)	(2,097)	-1%	(4,169)
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(4,474)</b>	<b>(3,870)</b>	<b>14%</b>	<b>(8,344)</b>

## Impuestos a la Utilidad

Scotiabank-Impuestos  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	3 meses			6 meses
	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%	30 jun 2022
Impuesto a la Utilidad Causado	(622)	(807)	-30%	(1,429)
Impuesto a la Utilidad Diferido	(386)	47	> +100%	(339)
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(1,008)</b>	<b>(760)</b>	<b>25%</b>	<b>(1,768)</b>

En el segundo trimestre de 2022, el total de impuestos netos se ubicó en \$760 millones, una disminución de \$248 millones o 25% respecto al trimestre anterior, principalmente por una menor utilidad en el periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2022 ascendieron a \$1,768 millones, lo que representa una tasa efectiva del periodo de 21.9% principalmente por la Inflación del periodo.

### Balance General

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	183,564	228,718	25%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	426,349	443,593	4%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180	16,428	2%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)	(15,648)	0%
Otros Activos	42,974	47,430	10%
<b>Total Activo</b>	<b>653,468</b>	<b>720,521</b>	<b>10%</b>
Depósitos	429,019	439,729	2%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	41,936	41,855	0%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,096	9,052	0%
Otros Pasivos	102,826	154,994	51%
<b>Capital</b>	<b>70,591</b>	<b>74,891</b>	<b>6%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>653,468</b>	<b>720,521</b>	<b>10%</b>

Al 30 de junio de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$720,521 millones, un incremento de \$67,053 millones o 10% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros en valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender), cartera de crédito con riesgo de crédito (etapa 1 y 2 de comercial y vivienda), un mayor volumen en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico), así como deudores por liquidación de operaciones (en Otros Activos).

El total del pasivo ascendió a \$645,630 millones al 30 de junio de 2022, un incremento de \$62,753 millones o 11% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en Otros Pasivos (acreedores por reporto, valores asignados por liquidar, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones); así como por mayores volúmenes en depósitos.

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

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,150	34,313	0%
Créditos a la Vivienda	169,766	176,249	4%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>203,916</b>	<b>210,562</b>	<b>3%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	185,275	197,079	6%
Entidades Financieras	17,720	19,869	12%
Entidades Gubernamentales	19,438	16,083	-17%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>222,433</b>	<b>233,031</b>	<b>5%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>426,349</b>	<b>443,593</b>	<b>4%</b>

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2022 se ubicaron en \$233,031 millones, un incremento de \$10,598 millones o 5% respecto al trimestre anterior, debido principalmente por créditos de actividad empresarial o comercial.

El total de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2022 se ubicó en \$210,562 millones, un incremento de \$6,646 millones o 3% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a créditos a la vivienda.

### Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180	16,428	2%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,599)	(15,648)	0%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>581</b>	<b>780</b>	<b>34%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.7%</b>	<b>3.6%</b>	<b>-9 pb</b>

Al 30 de junio de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$16,428 millones, un incremento de \$248 millones o 2% respecto al trimestre anterior.

Al 30 de junio de 2022 la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,648 millones, un incremento de \$49 millones respecto al trimestre anterior.

Al 30 de junio de 2022, el índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 95.3%, menor al 96.4% respecto al cierre del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 30 de junio de 2022 fue de 3.6%, una disminución de 9pb respecto al trimestre anterior.

## Depósitos

Scotiabank – Depósitos  
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

	31 mar 2022	30 jun 2022	T/T Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>216,843</b>	<b>221,199</b>	<b>2%</b>
Público en General	187,317	192,935	3%
Mercado de Dinero	2,302	2,305	0%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>189,619</b>	<b>195,240</b>	<b>3%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	21,676	22,355	3%
Cuenta global de captación sin movimientos	881	935	6%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>429,019</b>	<b>439,729</b>	<b>2%</b>

Al 30 de junio de 2022, el total de depósitos se ubicó en \$439,729 millones, un incremento de \$10,710 millones o 2% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores depósitos a plazo de público en general por \$5,618 millones o 3%, así como depósitos a la vista y ahorro por \$4,356 millones o 2%.

Scotiabank  
Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-22295	11,970,805,036	6.40%	28	11,914

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>69,264</b>	<b>1,179</b>	<b>39</b>	<b>-</b>	<b>70,482</b>
Sin restricción:	-	-	-	-	-
Restringidos:	69,264	1,179	39	-	70,482
<i>En operaciones de reporto</i>	58,578	1,179	39	-	59,796
<i>Préstamos de valores</i>	241	-	-	-	241
<i>Otros</i>	10,445	-	-	-	10,445
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>47,018</b>	<b>16,881</b>	<b>-</b>	<b>1,330</b>	<b>65,229</b>
Sin restricción:	32,283	16,881	-	1,330	50,494
Restringidos:	14,735	-	-	-	14,735
<i>En operaciones de reporto</i>	13,008	-	-	-	13,008
<i>Otros</i>	1,727	-	-	-	1,727
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>5,206</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>5,206</b>
Sin restricción	5,206	-	-	-	5,206
<b>Total</b>	<b>121,488</b>	<b>18,060</b>	<b>39</b>	<b>1,330</b>	<b>140,917</b>

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022; valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total pasivo
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva		
Negociación	1,348	1,062	-	-	1,490	1,071	526	674	26,792	26,950	-	-	30,156	29,757
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	6,298	3,608	-	-	6,298	3,608

Scotiabank-Montos nomenclales en operaciones derivadas  
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2022)

	Contratos adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
<b>Con fines de negociación</b>												
Posición USD	1,860	2,148	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	2	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	12	12	405	405	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	110	110	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	743	513	1,053	52	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	3,787	3,789	-	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	28,417	27,741	356,631	358,407	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	340	339	1,348	1,654	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	23	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
<b>Con fines de cobertura</b>												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	39,015	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	451	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	158,333	38,257	196,590
Créditos a entidades financieras	19,654	18	19,672
Créditos a entidades gubernamentales	16,061	-	16,061
Créditos al consumo	33,685	-	33,685
Créditos a la vivienda	173,735	15	173,750
<b>Total</b>	<b>401,468</b>	<b>38,290</b>	<b>439,758</b>

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	289	200	489
Créditos a entidades financieras	197	-	197
Créditos a entidades gubernamentales	22	-	22
Créditos al consumo	628	-	628
Créditos a la vivienda	2,493	6	2,499
<b>Total</b>	<b>3,629</b>	<b>206</b>	<b>3,835</b>

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	6,149	1,698	7,847
Créditos a entidades financieras	91	-	91
Créditos a entidades gubernamentales	86	-	86
Créditos al consumo	967	-	967
Créditos a la vivienda	7,395	42	7,437
<b>Total</b>	<b>14,688</b>	<b>1,740</b>	<b>16,428</b>

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

<b>Saldo al 31 de marzo de 2022</b>	<b>16,180</b>
Reestructuras	60
Recuperaciones	(184)
Castigos y quitas	(530)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	883
Fluctuación de tipo de cambio	19
<b>Saldo al 30 de junio de 2022</b>	<b>16,428</b>

Saldo al 31 de marzo de 2022		15,599
Más: Creación de reservas		-
Calificación		497
Menos: Liberaciones		-
Cancelaciones		-
Adjudicaciones y otros		9
Castigos y quitas		521
Comercial	19	
Hipotecario	47	
Consumo	455	
Fusión CF		(63)
Desliz cambiario		(19)
<b>Saldo al 30 de junio de 2022</b>		<b>15,648</b>

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

	31 mar 2022	30 jun 2022
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>		
Metropolitano	56.1%	57.7%
Noroeste – Centro	12.1%	12.1%
Norte	15.7%	14.8%
Bajío	9.7%	9.2%
Sur	6.4%	6.2%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3</b>		
Metropolitano	40.5%	39.5%
Noroeste – Centro	18.0%	17.8%
Norte	8.1%	8.3%
Bajío	17.0%	16.6%
Sur	16.3%	17.8%

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	12,468	19.47%
2	8,248	12.88%
3	6,439	10.05%
<b>Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos</b>		<b>27,155</b>

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia  
Al 30 de junio de 2022  
(millones de pesos)

	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	Reservas Preventivas Necesarias			Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
			No Revolventes	Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes			
Exceptuada calificada							
Riesgo A1	411,854	1,035	109	606	285	2,035	
Riesgo A2	27,252	245	30	183	12	470	
Riesgo B1	9,568	105	45	57	12	219	
Riesgo B2	9,505	86	52	35	56	229	
Riesgo B3	5,654	62	16	39	53	170	
Riesgo C1	3,076	21	26	73	53	173	
Riesgo C2	3,248	16	31	140	207	394	
Riesgo D	5,666	339	52	279	1,020	1,690	
Riesgo E	11,536	5,932	746	325	1,451	8,454	
<b>Total</b>	<b>487,359</b>	<b>7,841</b>	<b>1,107</b>	<b>1,737</b>	<b>3,149</b>	<b>13,834</b>	
<b>Exceso</b>						<b>1,814</b>	
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>15,648</b>	

**NOTAS:**

- Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 30 de junio de 2022.

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	-
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		25
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		26
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		<u>1,763</u>
<b>Total</b>	<b>\$</b>	<b>1,814</b>

### Terminación anticipada de los programas hipotecarios

El 15 y 26 de julio de 2010, se firmó el convenio y se dieron a conocer a través del Diario Oficial de la Federación las Disposiciones de carácter general aplicables en la terminación anticipada a los programas de apoyo para deudores de créditos de vivienda.

Por los descuentos a cargo del Gobierno Federal se reconoció un crédito con vigencia de cinco años pagaderos anualmente, dentro del rubro "Créditos comerciales – Entidades Gubernamentales" formando parte de la cartera de crédito vigente hasta el año 2015.

El Banco recibió hasta el año 2015 cinco pagos anuales por \$366 (\$330 de capital y \$36 de intereses) sobre los descuentos a cargo del Gobierno Federal al amparo del convenio.

Asimismo, los Cetes Especiales que al 30 de junio de 2022 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

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

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	549	07-jul-22
B4 220804	21,792	3	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,553	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>15,196,430</b>	<b>2,105</b>	

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

	Tasa Promedio		
	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	3.19%	0.35%	-
Depósitos a plazo	6.19%	0.00%	-



Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Vencimiento	Préstamos			Financiamiento Fondos de Fomento	Otros Organismos	Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo			
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	1,182	5,993	3,244	-	10,419
Largo	-	-	16,000	6,040	-	22,040
<b>Total</b>	-	<b>1,182</b>	<b>21,993</b>	<b>9,284</b>	-	<b>32,459</b>
Tasa Promedio	0.00%	7.75%	8.79%	7.15%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	7,051	-	7	249	10	7,317
Largo	-	-	-	65	2,014	2,079
<b>Total</b>	<b>7,051</b>	-	<b>7</b>	<b>314</b>	<b>2,024</b>	<b>9,396</b>
Tasa Promedio	0.31%	0.00%	3.04%	1.83%	1.03%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>7,051</b>	<b>1,182</b>	<b>22,000</b>	<b>9,598</b>	<b>2,024</b>	<b>41,855</b>

Scotiabank no cuenta con créditos o financiamientos específicos que representen más del 10% de los pasivos que se muestran en sus estados financieros al 30 de junio de 2022.

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

	31 mar 2022	30 jun 2022
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>53.4%</b>	<b>53.2%</b>
Metropolitano	21.8%	22.5%
Noroeste – Centro	11.4%	11.4%
Norte	8.3%	7.6%
Bajío	6.1%	6.0%
Sur	5.8%	5.7%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>46.0%</b>	<b>46.2%</b>
Metropolitano	18.7%	18.0%
Noroeste - Centro	6.9%	5.8%
Norte	9.2%	9.4%
Bajío	5.6%	6.8%
Sur	5.6%	6.2%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>99.4%</b>	<b>99.4%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>0.6%</b>	<b>0.6%</b>

Scotiabank-Impuestos y PTU Diferidos  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Perdida de arrastre fiscal	18
Provisión por pérdidas de crédito	4,404
Compensación diferida	(1,127)
Ingresos diferidos	534
Instalaciones y equipos / depreciación	316
Beneficios a los empleados	563
Provisiones	1,372
Otros	(405)
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>5,675</b>

Al 30 de junio de 2022, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Resultados por Intermediación  
(millones de pesos)

	30 junio 2022
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(124)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(7)
Resultado por valuación de divisas	(19)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	149
Resultado por compraventa de divisas	465
Costos de transacción	-
<b>Total</b>	<b>464</b>

## Emisión de Certificados Bursátiles

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

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

\* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

<sup>1</sup> las reaperturas SCOTIAB 19 y SCOTIAB 19D fueron autorizadas el 24 de Julio 2019.

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

## Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99-SCOTIAB 13-19	658,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	65,820,000
99-SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
99-SCOTIAB 06-20	6,471,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	647,191,000
99-SCOTIAB 07-20	7,324,700	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	732,470,000
99-SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
99-SCOTIAB 01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	23,884,500
99-SCOTIAB 02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLF)	21,284,500
99-SCOTIAB 03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	184,522,000
99-SCOTIAB 04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB 05-21	4,926,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	492,650,000
99-SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
83-SCOTIAB 07-21	1,526,000	11-ago-21	04-ago-22	358	MSFDVTHY Index	152,600,000
99-SCOTIAB 08-21	809,300	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,930,000
99-SCOTIAB 09-21	3,950,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	395,020,000
99-SCOTIAB 10-21	3,848,100	25-nov-21	22-nov-24	1,093	Index (BNPIUIL5)	384,810,000
99-SCOTIAB 11-21	1,105,530	07-dic-21	01-jun-23	541	MSCI ETF (EZU)	110,553,000
99-SCOTIAB 01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093	MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB 02-22	545,100	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	54,510,000
99-SCOTIAB 03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546	iShares MSCI China ETF	36,975,000
99_SCOTIAB_04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99_SCOTIAB_6-22	1,838,000	15-jun-22	13-jun-25	1,094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	183,800,000
99_SCOTIAB_07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_08-22	1,030,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	103,015,000
99_SCOTIAB_09-22	495,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,500,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
<b>Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2022</b>						<b>4,410,020,000</b>

## 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 2022)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	12,907
2	Resultado de ejercicios anteriores	47,119
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	14,864
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	74,890
7	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,509
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	-
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	8,739
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	8
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	8,036
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	695
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común	10,248
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	64,642

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,580
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,580
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	3,580
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,580
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	68,222
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	4,210
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	1,750
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	5,961
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios		
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	5,961
59	Capital total (TC = T1 + T2)	74,183
60	Activos ponderados por riesgo totales	449,638
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.38%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.17%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.50%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.48%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	7.38%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica

Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	1,750
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,263
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

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

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

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



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

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de Efectivo	53,235
BG2	Cuentas de Margen	811
BG3	Inversiones en Instrumentos Financieros	140,917
BG4	Deudores por reporto	679
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos Financieros Derivados	36,454
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(1,256)

BG8	Total de cartera de crédito (neto)	444,373
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	24,709
BG11	Bienes adjudicados (neto)	197
BG12	Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	1,994
BG13	Inversiones permanentes	3,511
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	17
BG15	Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,681
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (neto)	5,090
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,529
	Activos Intangibles (neto)	4,624
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	439,860
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	41,855
	Valores asignados por liquidar	11,262
BG19	Acreedores por reporto	72,761
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	222
BG22	Instrumentos Financieros Derivados	33,365
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	5
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	29,238
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por impuesto a la utilidad	1,398
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,489
	Pasivos por arrendamiento	1,586
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,052
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	5,582
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	12,907
BG30	Capital ganado	61,983
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	255,676
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	421,606
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	57,829
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	11,123
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	-
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	1,133
BG41	Otras cuentas de registro	1,650,592

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 2022)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	<b>ACTIVO</b>			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,509	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1,509
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	

9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	-	
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	1,750	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$1,750
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	8	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 8
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	8,036	BG 16 Activos Intangibles \$4,625 más Gastos de Instalación \$3,411
21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	695	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 695
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	3,580	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,580
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	4,210	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,210
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	12,907	BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,236
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	47,119	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$47,119
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	937	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$937
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	13,928	BG 30 Reservas de Capital \$8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$268) más Remediación por

				beneficios definidos a los empleados (\$117) más Resultado Neto \$6,311
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
	CUENTAS DE ORDEN			
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador		
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

<b>Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo</b>	<b>Importe de posiciones equivalentes</b>	<b>Requerimiento de capital</b>
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	50,428	4,034
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,811	145
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	3,346	268
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	56	5
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	2,873	230
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,217	177
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	873	70
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	11	1
Requerimiento de capital por impacto Vega	26	2
<b>Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo</b>	<b>Activos ponderados por riesgo</b>	<b>Requerimiento de capital</b>
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	36	3
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-

Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	575	46
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,659	293
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	2	0
Grupo III (ponderados al 50%)	511	41
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,424	274
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	180	14
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	938	75
Grupo VI (ponderados al 20%)	1,604	128
Grupo VI (ponderados al 25%)	1,108	89
Grupo VI (ponderados al 30%)	4,201	336
Grupo VI (ponderados al 40%)	4,606	368
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,253	3,060
Grupo VI (ponderados al 70%)	33	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	19,503	1,560
Grupo VI (ponderados al 85%)	586	47
Grupo VI (ponderados al 100%)	69,889	5,591
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%)	155	12
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	14,060	1,125
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	25	2
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	12,047	964
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	150,598	12,048
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	27	2
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,527	122
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%)	1,008	81
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	5,684	455
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,029	242
Grupo IX (ponderados al 100%)	17,913	1,433
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-

Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,025	242
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	12	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	71	6

Método empleado	Activos ponderados sujetos a riesgo operacional Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	29,708	2,377
<b>Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses</b>		
	31,677	

## Categoría Capitalización

Al 30 de junio de 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio		
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	12,906,542,339
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
Rendimientos / dividendos		
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación anticipada	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de	No



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

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

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



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

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

#### Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

### Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

### **Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos**

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

### **Riesgo de mercado**

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 30 de junio de 2022 fue de \$16.82 y su promedio durante el segundo trimestre de 2022 fue de \$12.6 mismo que corresponde a un 0.017% del capital neto (\$72,274 a mayo 2022, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2022 se muestran a continuación:

<b>Nocional (millones de pesos)</b>	<b>Cierre junio 2022</b>	<b>Promedio</b>
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	896,002	852,169
Mercado de Dinero	58,011	55,991
Tipo de cambio		
Cash	129	160
Derivados	119,812	150,020
Capitales		
Derivados	21,680	19,587

  

<b>VaR 1 día (millones de pesos)</b>	<b>Cierre junio 2022</b>	<b>(Promedio)</b>
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	16.40	12.59
Tipo de cambio	1.32	1.35
Capitales	0.03	-
<b>VaR Global</b>	<b>16.82</b>	<b>12.60</b>

Las exposiciones de VaR y nocionales se encuentran por debajo de los límites establecidos y aprobados por los órganos colegiados del Banco.

Debido a que la medida del VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, diariamente se realizan pruebas bajo condiciones extremas con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando fluctuaciones anormales en los precios de mercado (cambios en la volatilidad y correlaciones entre factores de riesgo). La prueba bajo condiciones extremas al cierre del segundo trimestre de 2022 muestra una pérdida máxima de \$190.47. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado "Error de diciembre" y Mexico 1997 por el efecto de la "crisis del Rublo" y la crisis financiera asiática.

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

### **Riesgo de liquidez y tasas de interés**

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

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

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

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de junio 2022 así como el promedio del segundo trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	61,134	53,469
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	79,165	86,605

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 2022 de 136.55% y 112.12% respectivamente.

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

<sup>2</sup> Cifras previas al cierre de junio 2022.

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

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

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de junio 2022 y en promedio para el segundo trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(936)	(830)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(405)	(409)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Instrumentos financieros para cobrar o vender <sup>1</sup>	65,229	61,868
Derivados de Cobertura	48,100	48,919

*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 2022 y el promedio del segundo trimestre del 2022 fueron \$3,366 y \$3,002, respectivamente.

## Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre de 2022 corresponde a \$102; 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)

Durante junio 2022, el Banco canceló el remanente de las reservas adicionales por COVID que se constituyeron en 2020.

En junio 2022, el Banco informó a CNBV sobre la necesidad de llevar a cabo el reconocimiento y registro de reservas adicionales debido a que aún persisten los efectos adversos como resultado de la emergencia sanitaria por COVID-19, el cual sigue afectando el entorno económico y financiero, con la finalidad de cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de cartera crediticia. Lo anterior, una vez analizado el portafolio y las características de los créditos a la vivienda (posible deterioro y requerimientos de provisiones conforme a la política interna de castigos) que derivado de la contingencia por COVID-19 recibieron un programa de apoyo y la cartera comercial principalmente en etapa 3 que se vio afectada de manera directa o indirecta por la contingencia por COVID-19 y que en función del tiempo que esta permanezca afectada requerirá mayores reservas.

Con base en lo anterior, el banco constituyó MXN \$1,855MM de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio y mantiene como remanente al cierre del trimestre \$1,750MM.

### Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito <sup>1</sup> (Cifras al 30 de junio 2022)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.3%	3.2%
Consumo	4.2%	10.6%
Cartera Comercial	0.7%	4.1%
<b>Total</b>	<b>0.8%</b>	<b>4.2%</b>

<sup>1/</sup> 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 <sup>1</sup> (Cifras en millones de pesos al 30 de junio 2022)	EP <sup>2</sup>	PI	SP
Hipotecas	176,249	1.61%	18.60%
Consumo	52,634	5.32%	72.07%
Cartera Comercial	271,143	1.95%	45.84%

1/ El (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por El. 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 2022.

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

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

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

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

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

## Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de junio 2022 y en promedio durante el segundo trimestre de 2022, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.01% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.10% y 0.11% respectivamente.

## Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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



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

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

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

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

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

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

## **Riesgo Operacional**

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

## **Metodología general**

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

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

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

## **Evaluación de riesgo operacional**

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

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

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

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

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

## Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

## Riesgo Legal

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

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

## Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

## Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de abril - junio 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$65.9, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$297.5, donde \$16.0 corresponden a riesgo operacional y \$281.5 a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

## Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)	Calculo Individual T2 2022		Calculo Consolidado T2 2022		Calculo Consolidado T1 2022		
	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>							
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	86,463.86	No aplica	86,463.86	No aplica	110,177.61
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>							
2	Financiamiento minorista no garantizado	177,024.94	14,277.22	177,024.94	14,277.22	165,030.13	12,249.16
3	Financiamiento estable	98,810.66	6,455.80	98,810.66	6,455.80	94,895.56	5,235.70
4	Financiamiento menos estable	78,214.28	7,821.43	78,214.28	7,821.43	70,134.57	7,013.46
5	Financiamiento mayorista no garantizado	200,884.67	71,586.96	200,884.67	71,586.96	218,277.04	80,412.04
6	Depósitos operacionales	94,657.20	22,963.96	94,657.20	22,963.96	88,964.87	21,507.38
7	Depósitos no operacionales	106,227.47	48,623.00	106,227.47	48,623.00	125,795.78	55,388.28
8	Deuda no garantizada	-	-	-	-	3,516.39	3,516.39
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	211.54	No aplica	211.54	No aplica	412.49
10	Requerimientos adicionales:	243,044.80	19,925.73	243,044.80	19,925.73	286,558.59	23,420.38
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	6,779.89	5,189.93	6,779.89	5,189.93	5,953.19	4,949.49
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	236,264.91	14,735.81	236,264.91	14,735.81	280,605.39	18,470.89
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	32.14	32.14	32.14	32.14	420.96	420.96
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	1,508.96	1,508.96	1,508.96	1,508.96	518.43	518.43
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	107,542.55	No aplica	107,542.55	No aplica	117,433.46
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>							
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	2,209.85	147.91	2,209.85	147.91	10,641.72	212.23
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,084.63	31,269.27	45,084.63	31,269.27	40,943.47	30,244.19
19	Otras entradas de efectivo	13,229.11	13,229.11	13,229.11	13,229.11	12,836.33	12,836.33
20	<b>TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	60,523.59	44,646.30	60,523.59	44,646.30	64,421.52	43,292.75
<b>Importe ajustado</b>							
21	<b>TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES</b>	No aplica	86,463.86	No aplica	86,463.86	No aplica	110,177.61
22	<b>TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	62,896.26	No aplica	62,896.26	No aplica	74,140.72
<b>23</b>	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ<sup>4</sup></b>	<b>No aplica</b>	<b>136.55</b>	<b>No aplica</b>	<b>136.55</b>	<b>No aplica</b>	<b>148.81</b>

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

*90 días naturales*

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

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

<sup>4</sup> Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

- **Durante junio 2022, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):<sup>5</sup>**

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$45,934 y depósitos a plazo tradicionales por \$36,768, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,701 y \$3,336 respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$16,497.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$17,402 y por operaciones de call money de \$15,785 y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,943.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$79,165 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$42,913 en títulos de deuda de nivel 1, \$26,854 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 \$7,650 y \$1,748 en títulos de nivel 2.

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

**Cierre de marzo 2022: 132% – cierre de junio 2022: 138% previo (incremento: 600pb)** El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 600pb respecto de marzo 2022, esto debido principalmente a:

- o El fondeo tradicional del banco creció en \$6,721, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$434.
- o En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$9,960 y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$855 MM.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un decremento de \$4,637.

(d) *La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables<sup>6</sup>;*

Evolución de Activos Líquidos T2-2022	Abril	Mayo	Junio
Efectivo	10%	10%	10%
Reservas en el Banco Central	34%	30%	34%
Nivel 1	54%	58%	54%
Nivel 2 <sup>a</sup>	2%	2%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
<b>Total de Activos Líquidos Ponderados</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

(e) *La concentración de sus fuentes de financiamiento;*

Concentración de fuentes de Financiamiento	Abril	Mayo	Junio
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	46%	48%	46%
Depósitos a plazo			
Del público en general	40%	39%	40%
Mercado de dinero	0%	0%	0%
Títulos de crédito emitidos	6%	5%	5%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	3%	3%	4%
De largo plazo	5%	5%	5%
<b>Total</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

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

<sup>6</sup> Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

(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.

<i>(Cifras en millones de pesos)</i>	
Exposición Potencial Futura (junio 2022)	
Con contrato de compensación	3,032
Sin contrato de compensación	4,589
Posibles llamadas de margen (junio 2022)	
Colateral en Tránsito	144
Downgrade (junio 2022)	
Baja calificación 3 niveles	3,366

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

<i>Scotiabank-Exposición en Derivados</i> <i>(cifras en millones de pesos)</i>	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	896,002
Tipo de cambio	119,812
Capitales	21,680
<b>Total</b>	<b>1,037,494</b>

(g) *El descalce en divisas;*

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el segundo trimestre del 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.74% al cierre de junio del 2022 y en promedio durante segundo trimestre del 2022 fue de -3.19%

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

**I. Información cuantitativa:**

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Descripción	Promedio T2 2022	Junio 2022
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	1,827	2,253
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	33,061	31,579
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	40	40
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	32	32
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	40	40
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	32	32

(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 2022 y el promedio del segundo trimestre de 2022 son:

Scotiabank	Posición (Cierre) <sup>8</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	61,134	53,469
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	79,165	86,605

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.

<sup>8</sup> Cifras previas al cierre de junio 2022.

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:

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

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

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



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

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

De acuerdo 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:

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

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

**Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)  
Periodo Reportado: Segundo trimestre del 2022**

**Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto<sup>9</sup>**

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	> 1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	> 1 año	
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE</b>										
1 Capital:	76,316.00	0.00	0.00	0.00	76,316.00	76,316.00	0.00	0.00	0.00	76,316.00
2 Capital fundamental y capital básico no fundamental.	76,316.00	0.00	0.00	0.00	76,316.00	76,316.00	0.00	0.00	0.00	76,316.00
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	209,276.74	1,506.67	23.64	194,197.50	0.00	209,276.74	1,506.67	23.64	194,197.50
5 Depósitos estables.	0.00	88,754.63	621.15	12.97	84,919.96	0.00	88,754.63	621.15	12.97	84,919.96
6 Depósitos menos estables.	0.00	120,522.12	885.52	10.67	109,277.54	0.00	120,522.12	885.52	10.67	109,277.54
7 Financiamiento mayorista:	0.00	281,068.37	24,176.78	26,452.14	139,553.39	0.00	281,068.37	24,176.78	26,452.14	139,553.39
8 Depósitos operacionales.	0.00	7,710.89	0.00	0.00	3,855.44	0.00	7,710.89	0.00	0.00	3,855.44
9 Otro financiamiento mayorista.	0.00	273,357.49	24,176.78	26,452.14	135,697.95	0.00	273,357.49	24,176.78	26,452.14	135,697.95
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:	509.84	1,508.96	0.00	4,316.66	4,316.66	509.84	1,508.96	0.00	4,316.66	4,316.66
12 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	509.84	0.00	0.00	0.00	0.00	509.84	0.00	0.00	0.00	0.00
13 Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	1,508.96	0.00	4,316.66	4,316.66	0.00	1,508.96	0.00	4,316.66	4,316.66
14 Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	76,825.84	491,854.07	25,683.45	30,792.43	414,383.55	76,825.84	491,854.07	25,683.45	30,792.43	414,383.55
<b>ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO</b>										
15 Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	5,555.50	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	5,555.50
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	105,462.15	35,356.97	280,999.52	305,217.86	0.00	105,462.15	35,356.97	280,999.52	305,217.86
18 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	399.67	0.00	0.00	39.97	0.00	399.67	0.00	0.00	39.97
19 Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	8,653.62	1,913.78	6,353.90	8,608.83	0.00	8,653.62	1,913.78	6,353.90	8,608.83
20 Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	81,169.02	30,439.49	111,642.97	150,489.05	0.00	81,169.02	30,439.49	111,642.97	150,489.05
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	2,941.70	3,135.91	169,712.02	144,249.05	0.00	2,941.70	3,135.91	169,712.02	144,249.05
23 Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	124.15	132.21	7,254.74	4,843.76	0.00	124.15	132.21	7,254.74	4,843.76
24 Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	12,422.29	0.00	545.38	6,674.71	0.00	12,422.29	0.00	545.38	6,674.71
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	57,477.45	2,313.09	815.76	34,249.06	0.00	57,477.45	2,313.09	815.76	34,249.06
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	1,409.47	0.00	0.00	1,198.05	No Aplica	1,409.47	0.00	0.00	1,198.05
29 Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	564.01	No Aplica	0.00	0.00	0.00	564.01
30 Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,146.24	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,146.24
31 Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		56,067.97	2,313.09	815.76	29,340.76	0.00	56,067.97	2,313.09	815.76	29,340.76
32 Operaciones fuera de balance.	No Aplica	231,454.63	0.00	0.00	11,572.73	No Aplica	231,454.63	0.00	0.00	11,572.73
33 Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	356,595.16	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	356,595.16
34 Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	116.21	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	116.21

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

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

o Fondo Estable Disponible:

Fondo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$160,426 y depósitos a plazo tradicionales por \$129,357, Capital (fundamental y complementario) por \$78,469, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$16,273 y \$6,426 respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$17,164.

<sup>9</sup> Anexo 10 de las disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple. Cifras Previas

o Fondo Estable Requerido:

Fondo Requerido ponderado por carteras de \$316,534 y por operaciones mercado de dinero de \$13,857, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$13,082, deducciones de capital por \$10,223 y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$4,958.

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

**Cierre de marzo 2022: 114.6% – cierre de junio 2022: 113.73% (decremento: 84pb)** El coeficiente de financiamiento neto decrementó 84pb respecto de marzo 2022, esto debido principalmente a:

- El fondo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondo tradicional ponderado del banco creció en \$2,683, además, fondo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$9,394.
- El fondo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas decrecieron \$3,979, los compromisos crediticios decrementaron en su monto ponderado en \$2,002 y el financiamiento requerido por operación de instrumentos derivados aumentó \$3,909.

(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	418,093	412,697	412,361
Financiamiento Estable Requerido	354,101	353,116	362,568
<b>Coeficiente de Fondo Estable Neto</b>	<b>118.07%</b>	<b>116.87%</b>	<b>113.73%</b>

(d) El impacto en el Coeficiente de Financiamiento Estable Neto de la incorporación de las entidades objeto de consolidación.

Las entidades objeto de consolidación de acuerdo con las reglas contables, y con aprobación del consejo de administración son las siguientes:

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

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

### Posiciones en Acciones

Al cierre de junio de 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$20.16 millones de pesos, con una plusvalía de \$0.29 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/Minusvalía
Scotiabank	Pública	1IEWG*	5,000	2.32	2.35	(0.03)
Scotiabank	Pública	1BACHOCOB	69,733	5.05	4.82	0.23
Scotiabank	Pública	1EFRES*	922	0.18	0.22	(0.04)
Scotiabank	Pública	1IGDX*	3,600	1.98	2.03	(0.05)
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	40,000	1.90	2.10	(0.20)
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	67,922	0.27	0.26	0.01
Scotiabank	Pública	41BSMXB	189,293	3.88	4.03	(0.15)
Scotiabank	Pública	1IXLC*	1,700	1.86	1.86	-
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	20,000	2.72	2.78	(0.06)
<b>Total</b>			<b>398,170</b>	<b>20.16</b>	<b>20.45</b>	<b>(0.29)</b>

Al cierre del segundo trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$4.19 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	80,925	0.09	(0.01)	0.08
Scotiabank	Pública	1A-GM-*	7,700	0.09	(0.10)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	34,077	0.07	(0.02)	0.05
Scotiabank	Pública	1-KIMBER-A	635,929	0.56	(0.15)	0.41
Scotiabank	Pública	1I-GLD-*	500	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-EWG-*	20,111	0.26	(0.06)	0.20
Scotiabank	Pública	1-BACHOCO-B	164,987	0.17	(0.15)	0.02
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	84,606	0.44	(0.17)	0.27
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	10,300	0.34	(0.03)	0.31
Scotiabank	Pública	1A-TX-*	4,400	0.33	-	0.33
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	6,268	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	1,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	5,600	0.05	(0.09)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-CHDRAUI-B	10,980	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	7,710	0.18	(0.07)	0.11
Scotiabank	Pública	1I-OIH-*	900	0.35	-	0.35
Scotiabank	Pública	1A-FB-*	4,414	0.56	(0.32)	0.24
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	20,840	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	2,087,817	0.23	(0.17)	0.06
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	270,155	0.06	(0.15)	(0.09)
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	8,841	0.12	(0.16)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	166,294	0.53	(0.43)	0.10
Scotiabank	Pública	1-KOF-UBL	38,917	0.15	-	0.15
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	3,407	0.04	(0.02)	0.02
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	487,515	0.19	(0.03)	0.16
Scotiabank	Pública	1-AMX-L	864,556	0.41	(0.02)	0.39
Scotiabank	Pública	1-CEMEX-CPO	3,448,580	1.38	(0.28)	1.10
<b>Total</b>			<b>8,477,329</b>	<b>6.65</b>	<b>(2.46)</b>	<b>4.19</b>

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

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

Al 31 de junio, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$69.87 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$48.55 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$21.32 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
Por Riesgo General de Mercado	24.04	242.43	218.39	22.23%	48.55
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	15.35	18.17	33.53	8.00%	2.68
Índices accionarios	8.68	224.26	232.94	4.00%	9.32
Requerimiento por riesgos específico	8.68	224.26	232.94	4.00%	9.32
			<b>Total Requerimiento de capital</b>		<b>69.87</b>

Anexo 1-O Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento  
TABLA I.1  
FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIA	RUBRO	mar-22	Jun-22
	Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	622,247	685,432
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,029)	(10,248)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	612,217	675,184
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados		

4	Costo actual de reemplazo asociado a <i>todas</i> las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	5,839	7,531
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,789	3,659
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo		
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(1,741)	(1,663)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)		
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)		
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	7,887	9,527
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	3,187	679
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(1,513)	(679)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	1,674	-
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	276,825	231,456
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(177,660)	(154,468)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	99,164	76,988
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	64,042	68,222
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	720,944	761,699
	Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	8.88%	8.96%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-22	Jun-22
1	Activos totales	655,507	722,565
2	Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria	(665)	(703)
3	Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento		
4	Ajuste por instrumentos financieros derivados	(22,186)	(26,927)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(1,513)	(679)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	99,164	76,988
7	Otros ajustes	(9,364)	(9,545)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	720,944	761,699

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Mar-22	Jun-22
1	Activos totales	655,507	722,565
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(30,073)	(36,454)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(3,187)	(679)
4	Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento		
5	Exposiciones dentro del Balance	622,247	685,432

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

CONCEPTO/PERIODO	Mar-22	Jun-22	Variación
Capital Básico <sup>1/</sup>	64,042	68,222	6.5%
Activos Ajustados <sup>2/</sup>	720,944	761,699	5.7%
Razón de Apalancamiento <sup>3/</sup>	8.88%	8.96%	0.8%

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 2022.

El indicador se ubicó en 8.96%, 8pb superior respecto al trimestre anterior, debido principalmente a la mejora en el capital de nivel 1 por \$4,180 millones (+55 pb); compensada con el incremento en las exposiciones totales por \$40,755 millones (-47pb).

El Capital de Nivel 1 mostró un incremento trimestral de \$4,180 millones (+55pb), debido principalmente al resultado neto del periodo y a las fusiones llevadas a cabo en junio 2022.

La variación de -47pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$62,967 millones (-69pb); compensada parcialmente con la disminución en las partidas fuera del balance por \$22,167 millones (+26pb).

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

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

10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente) de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.
13	Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes: <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.</li> <li>b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.</li> <li>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.</li> <li>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.</li> </ul> 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	DESCRIPCIÓN
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
2	Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
4	Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución. El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.
5	Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución. El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.
6	Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.
7	Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

8 Suma de las líneas 1 a 7, la cual debe coincidir con la línea 21 de la Tabla I.1.

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

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

## Agencias Calificadoras

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

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

## Dividendos

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

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

### Fecha de pago

23 de abril de 2013

### Importe

\$ 165 millones

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

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

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



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

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

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

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

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

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

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

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

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

Al 30 de junio del 2022, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$69,257 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$51,075 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

### **Inversiones relevantes en capital**

Al 30 de junio de 2022, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



# Instrumentos Financieros Derivados

**Scotiabank**

## I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

## Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de junio 2022 y en promedio para el segundo trimestre de 2022 es de:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>10</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	61,134	53,469
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	79,165	86,605

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

### Inventario de modelos de derivados

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

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

<sup>10</sup> Cifras previas al cierre de junio 2022.

Tipo de cambio	IRS	El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).	
	CCIRS	Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.	
	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.	
		Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
	Opciones	Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
		Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente $S_T$ alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.
Forward	Forward	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.	
	OTC		

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

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

## Políticas Líneas de Crédito

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

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



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

- Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

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

- Sujetos de Crédito

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

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

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- Idoneidad del Cliente

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

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

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

## Políticas de VaR

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

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

### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

#### Cálculo de Sensibilidades

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

#### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

#### Bonos de Tasa Flotante

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

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

#### Bonos Cupón Cero

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

#### Riesgo de Crédito

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

## Sensibilidad del Pasivo

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

## Derivados de Tasas de Interés

### Swaps de Tasa de Interés

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

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

### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

### Futuros de Bono M

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

### Futuros de CETE

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

### Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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. Al cierre de junio 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

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

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

El componente que forma parte de “Otro Resultado Integral” asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre:

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

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

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

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

Al cierre de junio de 2022 y promedio del segundo trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) <sup>11</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	79,165	86,605

<sup>11</sup> Cifras previas al cierre de junio 2022.

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

Parámetro	Descripción
<b>SD</b>	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
<b>MTM</b>	Mark to Market

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	61,134	57,768	57,768	57,767
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,366)	(3,366)	(3,367)

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

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

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

## Delta

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

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

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

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

## Gamma

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

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

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

## Vega

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

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

## Rho

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

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

## Theta

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

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

## Dividend Risk

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

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

## II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	96,859.00	(63,229.00)	283,699.00	(540,239.00)	(145,004.00)	1,191.00	(366,723.00)
CCS	12.00	168.00	26.00	(237.00)	328.00	(30.00)	267.00
Caps&Floors	133.00	1,101.00	97.00	182.00	0.00	0.00	1,513.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total DERIVATIVES</b>	<b>97,004.00</b>	<b>(61,960.00)</b>	<b>283,822.00</b>	<b>(540,294.00)</b>	<b>(144,676.00)</b>	<b>1,161.00</b>	<b>(364,943.00)</b>

## Análisis de sensibilidad

### Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (47.07) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (94.14) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (217.09) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50	-	100	-	200	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.36)	6.13	50	(18.25)	100	(36.5)	200	(72.99)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	0	(0.27)	0.1	-	0.4	-	1	-
a FX %	Forwards	14.31	288.2	0.1	(28.82)	0.2	(57.64)	0.5	(144.1)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.1	-	0.2	-	0.5	-
<b>Total</b>					<b>(47.07)</b>		<b>(94.14)</b>		<b>(217.09)</b>

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

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 30 de junio de 2022 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

	Delta	Vega	Gamma
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXAS5.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFR5.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXGLD.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	1,734,765.00	9,571.00	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options NVDA.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>1,743,199.00</b>	<b>9,571.00</b>	<b>-</b>

### Análisis de Stress

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

	Escenarios a la Baja		
	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXAS5.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFR5.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXGLD.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	(173,476.50)	(520,429.50)	(867,382.50)
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSxAE.INDX	(843.40)	(2,530.20)	(4,217.00)
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>(174,319.90)</b>	<b>(522,959.70)</b>	<b>(871,599.50)</b>

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXAS5.INDX	-	-	-
Options MEXEZU.USM	-	-	-
Options MEXFR5.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXGLD.USM	-	-	-
Options MEXIL5.INDX	86,738.25	260,214.75	346,953.00
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMCH.USM	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	-	-	-
Options MXSxAE.INDX	421.70	1,265.10	1,686.80
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>87,159.95</b>	<b>261,479.85</b>	<b>348,639.80</b>

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



Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	(174,319.90)
Poco Probable	(522,959.70)
Muy poco Probable	(871,599.50)

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

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	53,400,000	(101,900,000)
CLIENTE 2	MXN	232,500,000	(63,100,000)
CLIENTE 3	MXN	94,800,000	(82,800,000)
CLIENTE 4	MXN	671,600,205	(460,800,000)
CLIENTE 5	USD	31,760,000	(32,950,000)
CLIENTE 6	USD	223,040,000	(11,400,000)
CLIENTE 7	USD	155,700,000	(202,400,000)
CLIENTE 8	USD	-	(320,000)
CLIENTE 9	USD	4,130,000	(5,650,000)
CLIENTE 10	USD	150,000	-
CLIENTE 11	USD	26,750,000	(19,790,000)
CLIENTE 12	USD	5,700,000	(4,970,000)
CLIENTE 13	MXN	373,200,000	(462,200,000)
CLIENTE 14	MXN	411,600,000	(277,800,000)
CLIENTE 15	MXN	15,500,000	(105,800,000)
CLIENTE 16	MXN	1,562,100,000	(1,106,800,000)
CLIENTE 17	USD	12,630,000	-
CLIENTE 18	MXN	390,200,000	(3,983,400,000)
CLIENTE 19	MXN	62,500,000	(62,800,000)
CLIENTE 20	USD	6,000,000	(11,510,000)
CLIENTE 21	USD	2,790,000	(1,620,000)
CLIENTE 22	MXN	-	(105,000,000)
<b>TOTAL</b>		<b>4,336,050,204.71</b>	<b>(7,103,010,000)</b>

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

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlD	Option Notional
C68119	CC Swap	jun-22	Buy	A	USD	902,129,917	MXN	45,562,117	USD	
C68121	CC Swap	jun-22	Buy	A	USD	45,562,117	USD	902,129,917	MXN	
C68303	CC Swap	abr-22	Buy	A	USD	300,308,720	MXN	15,015,436	USD	
C68304	CC Swap	abr-22	Buy	A	USD	15,015,436	USD	300,308,720	MXN	
C76663	CC Swap	may-22	Buy	A	USD	1,499,999,995	MXN	75,187,970	USD	
C76665	CC Swap	may-22	Buy	A	USD	75,187,970	USD	1,499,999,995	MXN	
C78329	CC Swap	jun-22	Buy	A	USD	1,996,000,000	MXN	100,000,000	USD	
C78938	CC Swap	jun-22	Buy	A	USD	100,000,000	USD	1,996,000,000	MXN	
MNL819	Term Deposit	may-22	Buy	A	MXN			300,000,000	MXN	
P16893	Cap	jun-22	Sell	A	MXN					2,363,140
P16905	Cap	abr-22	Sell	A	USD					42,375,000
P16914	Cap	jun-22	Sell	A	MXN					2,777,243
P16915	Cap	abr-22	Buy	A	USD					42,375,000
P16923	Cap	jun-22	Buy	A	MXN					2,363,140
P16924	Cap	jun-22	Buy	A	MXN					2,777,243
P16926	Cap	jun-22	Sell	A	MXN					2,363,140
P16928	Cap	jun-22	Sell	A	MXN					2,777,243
P16930	Cap	jun-22	Buy	A	MXN					150,000,000
P16931	Cap	jun-22	Sell	A	MXN					150,000,000
P16943	Cap	may-22	Sell	A	MXN					9,856,957
P16966	Cap	may-22	Sell	A	MXN					500,000,000
P16967	Cap	may-22	Buy	A	MXN					500,000,000
P16972	Cap	may-22	Sell	A	MXN					2,143,043
P16973	Cap	may-22	Buy	A	MXN					2,143,043
P17053	Cap	abr-22	Sell	A	MXN					40,000,000
P17054	Cap	abr-22	Buy	A	MXN					40,000,000
P17055	Floor	abr-22	Buy	A	MXN					40,000,000
P17056	Floor	abr-22	Sell	A	MXN					40,000,000
P17146	Cap	may-22	Sell	A	MXN					12,000,000
P17147	Cap	may-22	Buy	A	MXN					12,000,000
P17252	Cap	may-22	Sell	A	MXN					42,200,000
P17253	Cap	may-22	Buy	A	MXN					42,200,000
SDR890	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	8,344,112	MXN	8,344,112	MXN	
SDR892	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	8,344,112	MXN	8,344,112	MXN	
SDS164	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	23,920,344	MXN	23,920,344	MXN	
SDS166	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	6,079,656	MXN	6,079,656	MXN	
SDS179	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	23,920,344	MXN	23,920,344	MXN	
SDS182	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS185	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	6,079,656	MXN	6,079,656	MXN	
SDS191	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	1,408,510	MXN	1,408,510	MXN	
SDS239	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,490,566	MXN	3,490,566	MXN	
SDS245	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,490,566	MXN	3,490,566	MXN	
SDS253	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	1,408,510	MXN	1,408,510	MXN	
SDS402	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	6,343,071	MXN	6,343,071	MXN	
SDS403	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	6,343,071	MXN	6,343,071	MXN	
SDS473	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS525	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS527	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS528	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDS529	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS553	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDS554	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDS555	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS560	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS680	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS688	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS692	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS698	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS707	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS714	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS717	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS723	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS737	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	115,000,000	MXN	115,000,000	MXN	
SDS753	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDS762	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDS815	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS816	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	115,000,000	MXN	115,000,000	MXN	
SDS820	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS830	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS834	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS861	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	2,141,000	MXN	2,141,000	MXN	
SDS866	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	2,141,000	MXN	2,141,000	MXN	
SDS876	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS884	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDS890	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS893	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDS916	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDS949	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	470,000,000	MXN	470,000,000	MXN	
SDS950	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	117,000,000	MXN	117,000,000	MXN	
SDS969	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,530,069	MXN	8,530,069	MXN	
SDS979	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,530,069	MXN	8,530,069	MXN	
SDT010	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT078	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDT079	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDT153	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	465,000,000	MXN	465,000,000	MXN	
SDT177	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT184	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	235,000,000	MXN	235,000,000	MXN	
SDT211	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,320,730	MXN	3,320,730	MXN	
SDT216	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,320,730	MXN	3,320,730	MXN	
SDT246	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	459,000,000	MXN	459,000,000	MXN	
SDT294	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDT298	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDT376	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDT399	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,640,000	MXN	7,640,000	MXN	
SDT404	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,400,000	MXN	4,400,000	MXN	
SDT409	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,400,000	MXN	4,400,000	MXN	
SDT410	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,797,988	MXN	7,797,988	MXN	
SDT411	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,640,000	MXN	7,640,000	MXN	
SDT415	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	15,000,000	MXN	15,000,000	MXN	
SDT424	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,797,988	MXN	7,797,988	MXN	
SDT431	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	15,000,000	MXN	15,000,000	MXN	
SDT503	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT533	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	34,155,853	MXN	34,155,853	MXN	
SDT549	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	34,155,853	MXN	34,155,853	MXN	
SDT566	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	309,000	USD	309,000	USD	
SDT571	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	309,000	USD	309,000	USD	
SDT590	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT594	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT616	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	56,076,615	MXN	56,076,615	MXN	
SDT649	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	349,660	USD	349,660	USD	
SDT669	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	56,076,615	MXN	56,076,615	MXN	
SDT675	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDT679	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDT699	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	349,660	USD	349,660	USD	
SDT724	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SDT925	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	61,916	USD	61,916	USD	
SDT984	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	61,916	USD	61,916	USD	
SDU043	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU083	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,865,554	MXN	4,865,554	MXN	
SDU098	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,865,554	MXN	4,865,554	MXN	
SDU101	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDU141	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SDU191	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SDU237	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	12,252,723	MXN	12,252,723	MXN	
SDU353	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	19,185,494	MXN	19,185,494	MXN	
SDU380	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU382	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	19,185,494	MXN	19,185,494	MXN	
SDU468	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU494	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU547	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU551	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDU613	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU617	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU627	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU657	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	550,000,000	MXN	550,000,000	MXN	
SDU669	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU691	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU698	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDU708	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDU732	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDU761	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDU774	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDU809	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDU868	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDU926	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV046	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV052	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,747,354	MXN	8,747,354	MXN	
SDV080	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDV082	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV132	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	300,000	USD	300,000	USD	
SDV175	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV176	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV178	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV179	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV195	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,568,418	MXN	1,568,418	MXN	
SDV201	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDV211	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV214	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV215	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV219	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV237	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV246	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV250	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDV251	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDV252	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV269	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	125,000,000	MXN	125,000,000	MXN	
SDV500	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,568,418	MXN	1,568,418	MXN	
SDV521	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDV523	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	15,225,167	MXN	15,225,167	MXN	
SDV529	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	15,225,167	MXN	15,225,167	MXN	
SDV533	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	12,252,723	MXN	12,252,723	MXN	
SDV553	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV562	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,600,000	MXN	3,600,000	MXN	
SDV568	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	9,262,095	MXN	9,262,095	MXN	
SDV580	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SDV596	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,013,595	MXN	5,013,595	MXN	
SDV620	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	2,196,000	USD	2,196,000	USD	
SDV622	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	2,711,723	USD	2,711,723	USD	
SDV623	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,747,354	MXN	8,747,354	MXN	
SDV643	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	300,000	USD	300,000	USD	
SDV648	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SDV664	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	400,000	USD	400,000	USD	
SDV672	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	400,000	USD	400,000	USD	
SDV678	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	973,312	MXN	973,312	MXN	
SDV680	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,823,383	MXN	8,823,383	MXN	
SDV683	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,823,383	MXN	8,823,383	MXN	
SDV697	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	973,312	MXN	973,312	MXN	
SDV706	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	4,152,905	MXN	4,152,905	MXN	
SDV718	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	4,152,905	MXN	4,152,905	MXN	
SDV728	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,904,175	MXN	8,904,175	MXN	
SDV746	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	104,000	USD	104,000	USD	
SDV748	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,904,175	MXN	8,904,175	MXN	
SDV757	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	104,000	USD	104,000	USD	
SDV796	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SDV812	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	207,500,000	MXN	207,500,000	MXN	
SDV813	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV861	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,080,000,000	MXN	1,080,000,000	MXN	
SDV876	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV884	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV890	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV896	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV902	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV909	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV915	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV921	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV927	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV935	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV941	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV947	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV952	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDV959	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV967	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV972	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDV978	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV979	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,013,595	MXN	5,013,595	MXN	
SDV985	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDV993	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDV994	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDV998	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW007	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW011	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW021	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SDW023	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW034	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SDW036	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDW046	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDW050	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW060	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW061	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW062	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW075	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW101	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	6,330,195	MXN	6,330,195	MXN	
SDW118	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	6,330,195	MXN	6,330,195	MXN	
SDW135	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	17,030,192	MXN	17,030,192	MXN	
SDW138	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	17,030,192	MXN	17,030,192	MXN	
SDW200	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	1,130,000,000	MXN	1,130,000,000	MXN	
SDW223	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	33,677,613	MXN	33,677,613	MXN	
SDW224	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	33,677,613	MXN	33,677,613	MXN	
SDW230	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	8,772,689	MXN	8,772,689	MXN	
SDW239	SC Swap	may-22	Buy	A	USD	2,196,000	USD	2,196,000	USD	
SDW241	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	8,772,689	MXN	8,772,689	MXN	
SDW242	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SDW248	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SDW303	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN	
SDW316	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW321	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,985,008	MXN	5,985,008	MXN	
SDW335	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,985,008	MXN	5,985,008	MXN	
SDW426	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	66,000,000	MXN	66,000,000	MXN	
SDW458	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDW612	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDW628	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	7,251,439	MXN	7,251,439	MXN	
SDW644	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	7,251,439	MXN	7,251,439	MXN	
SDW657	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,093,541	MXN	2,093,541	MXN	
SDW666	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,093,541	MXN	2,093,541	MXN	
SDW675	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDW695	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SDW719	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,221,638	MXN	1,221,638	MXN	
SDW725	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	2,711,723	USD	2,711,723	USD	
SDW730	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,221,638	MXN	1,221,638	MXN	
SDW735	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	3,600,000	MXN	3,600,000	MXN	
SDW856	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	9,262,095	MXN	9,262,095	MXN	
SDW932	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	5,072,780	MXN	5,072,780	MXN	
SDW939	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	5,072,780	MXN	5,072,780	MXN	
SDX085	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX285	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX334	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDX354	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX358	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDX359	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SDX799	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDX801	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDX858	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,220,000,000	MXN	1,220,000,000	MXN	
SDX859	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDY401	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SDY402	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SDZ157	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,300,000,000	MXN	1,300,000,000	MXN	
SDZ677	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SDZ679	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDZ712	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	531,798	MXN	531,798	MXN	
SDZ746	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	531,798	MXN	531,798	MXN	
SDZ917	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDZ921	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SDZ925	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	600,000,000	MXN	600,000,000	MXN	
SEA752	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEB025	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEB037	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SEB238	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEB281	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEB283	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEB372	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SEB373	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEB383	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEB745	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEB917	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SED297	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	
SED343	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SEE914	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	590,000,000	MXN	590,000,000	MXN	
SEF831	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SEG674	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEJ613	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SE0806	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SE0945	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SEP190	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SES979	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	350,000,000	MXN	350,000,000	MXN	
SET525	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SEV986	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	600,000,000	MXN	600,000,000	MXN	
SEW933	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,220,000,000	MXN	2,220,000,000	MXN	
SEW939	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,190,000,000	MXN	1,190,000,000	MXN	
SEX406	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEX923	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEY070	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SEY074	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,500,000,000	MXN	2,500,000,000	MXN	
SEZ272	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEZ405	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEZ638	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SEZ901	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEZ967	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SEZ983	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SFA080	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFA104	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFA193	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	13,000,000	MXN	13,000,000	MXN	
SFA220	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	13,000,000	MXN	13,000,000	MXN	
SFA221	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SFA384	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	18,983,051	MXN	18,983,051	MXN	
SFA403	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	18,983,051	MXN	18,983,051	MXN	
SFA666	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	14,369,492	MXN	14,369,492	MXN	
SFA740	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	14,369,492	MXN	14,369,492	MXN	
SFB215	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SFB222	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SFB253	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	900,000,000	MXN	900,000,000	MXN	
SFB360	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,408,475	MXN	2,408,475	MXN	
SFB391	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,408,475	MXN	2,408,475	MXN	
SFB511	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SFB545	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN	
SFC418	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,190,000,000	MXN	1,190,000,000	MXN	
SFC672	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SFC715	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN	
SFC944	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,860,000,000	MXN	1,860,000,000	MXN	
SFD230	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFD254	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFE713	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFE769	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFE772	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,840,000,000	MXN	1,840,000,000	MXN	
SFE929	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFE937	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFF097	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFF106	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFF482	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,140,000,000	MXN	1,140,000,000	MXN	
SFF932	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	800,000,000	MXN	800,000,000	MXN	
SFR711	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	680,000,000	MXN	680,000,000	MXN	
SFR979	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR982	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR987	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR989	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR990	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR995	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR996	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFR997	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	7,500,000	MXN	7,500,000	MXN	
SFT401	SC Swap	abr-22	Buy	A	USD	6,000,000	USD	6,000,000	USD	
SFT427	SC Swap	abr-22	Buy	A	USD	6,000,000	USD	6,000,000	USD	
SFT998	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	37,000,000	MXN	37,000,000	MXN	
SFU011	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	37,000,000	MXN	37,000,000	MXN	
SFU209	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFU223	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SFW842	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
SFW843	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	5,000,000,000	MXN	5,000,000,000	MXN	
SFW977	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	320,000,000	MXN	320,000,000	MXN	
SFW983	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	320,000,000	MXN	320,000,000	MXN	
SFY791	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,518,644	MXN	1,518,644	MXN	
SFY817	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,518,644	MXN	1,518,644	MXN	

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
SFZ337	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	13,000,000	MXN	13,000,000	MXN	
SFZ348	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	13,000,000	MXN	13,000,000	MXN	
SFZ891	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	1,200,000,000	MXN	1,200,000,000	MXN	
SGA684	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,100,000	MXN	2,100,000	MXN	
SGA703	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,100,000	MXN	2,100,000	MXN	
SGA988	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,700,000	MXN	2,700,000	MXN	
SGA995	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	2,700,000	MXN	2,700,000	MXN	
SGB109	SC Swap	abr-22	Buy	A	USD	2,000,000	USD	2,000,000	USD	
SGB120	SC Swap	abr-22	Buy	A	USD	2,000,000	USD	2,000,000	USD	
SGB947	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SGB964	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SGE488	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGE521	SC Swap	abr-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGE556	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,480,000	MXN	1,480,000	MXN	
SGE559	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	1,480,000	MXN	1,480,000	MXN	
SGE660	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SGE686	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SGJ558	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGJ559	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGK515	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	4,129,041	MXN	4,129,041	MXN	
SGK517	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	4,129,041	MXN	4,129,041	MXN	
SGK941	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGK981	SC Swap	jun-22	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SGM040	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SGM077	SC Swap	may-22	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SGT674	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	22,000,000	USD	22,000,000	USD	
SGT675	SC Swap	jun-22	Buy	A	USD	22,000,000	USD	22,000,000	USD	



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2076637	FX	190,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076638	FX	190,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076639	FX	190,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076640	FX	190,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076641	FX	190,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076642	FX	190,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076659	FX	190,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076660	FX	190,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076661	FX	190,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076662	FX	190,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076663	FX	190,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2076664	FX	190,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080848	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080849	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080857	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2080858	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081709	FX	25,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081711	FX	25,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081713	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081715	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081717	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081721	FX	25,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081723	FX	25,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081725	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081727	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081729	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083319	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083321	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083322	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083324	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083328	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083330	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083331	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083333	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083907	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083908	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083910	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083911	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083922	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083923	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083925	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083926	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083933	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083934	FX	25,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083935	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083936	FX	25,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084114	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084115	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084116	FX	5,528	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084138	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084139	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084140	FX	5,528	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084158	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084159	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084160	FX	7,035	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084162	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084182	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084183	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084184	FX	7,035	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084186	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084375	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084377	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084378	FX	3,934	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084399	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084401	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084402	FX	3,934	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084476	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084477	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084478	FX	11,244	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084479	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084481	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084482	FX	11,244	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084484	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084485	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084486	FX	11,244	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084504	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084505	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084506	FX	11,244	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084507	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084509	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084510	FX	11,244	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084512	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084513	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084514	FX	11,244	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084551	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084552	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084553	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084554	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084555	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084556	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084565	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084566	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084567	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084568	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084569	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084570	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084592	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084593	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084594	FX	5,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084616	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084617	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084618	FX	5,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084640	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084641	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084642	FX	6,122	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084664	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084665	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084666	FX	6,122	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2084802	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084803	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084804	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084820	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084821	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084822	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084845	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084846	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084847	FX	2,369	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084849	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084869	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084870	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084871	FX	2,369	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084873	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084893	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084897	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084917	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084921	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084965	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084966	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084967	FX	4,523	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084969	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084973	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084974	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2084975	FX	4,523	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085013	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085014	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085015	FX	4,523	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085017	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085021	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085022	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085023	FX	4,523	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085061	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085062	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085063	FX	8,535	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085065	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085069	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085109	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085110	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085111	FX	8,535	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085113	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085117	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085604	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085606	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085655	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085657	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085698	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085738	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085803	FX	125,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085805	FX	125,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085806	FX	125,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085808	FX	125,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085809	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085811	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2085857	FX	125,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085859	FX	125,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085860	FX	125,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085862	FX	125,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085863	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2085865	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086009	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086010	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086011	FX	3,563	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086012	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086014	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086015	FX	3,563	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086016	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086018	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086019	FX	3,563	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086033	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086034	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086035	FX	3,563	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086036	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086038	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086039	FX	3,563	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086040	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086042	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086043	FX	3,563	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086048	FX	3,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086050	FX	3,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086051	FX	3,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086053	FX	3,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086064	FX	35,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086069	FX	35,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086070	FX	35,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086081	FX	35,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086086	FX	35,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086087	FX	35,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086092	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086094	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086100	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086102	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086172	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086173	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086174	FX	6,280	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086175	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086177	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086178	FX	6,280	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086179	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086181	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086182	FX	6,280	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086196	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086197	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086198	FX	6,280	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086199	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086201	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086202	FX	6,280	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086203	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2086205	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086206	FX	6,280	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086302	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086303	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086304	FX	10,949	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086305	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086308	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086309	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086310	FX	10,949	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086329	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086330	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086331	FX	10,949	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086332	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086335	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086336	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086337	FX	10,949	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086350	FX	28,311	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086351	FX	28,311	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086354	FX	28,311	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086355	FX	28,311	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086393	FX	571,440	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086394	FX	457,725	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086395	FX	352,725	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086415	FX	571,440	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086416	FX	457,725	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086417	FX	352,725	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086444	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086446	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086447	FX	7,230	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086452	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086454	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086455	FX	7,230	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086536	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086538	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086539	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086540	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086542	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086543	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086544	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086546	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086547	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086548	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086550	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086551	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086552	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086554	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086555	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086556	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086558	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086559	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086560	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086562	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086563	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086564	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2086566	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086567	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086592	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086594	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086595	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086596	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086598	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086599	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086600	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086602	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086603	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086604	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086606	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086607	FX	1,582	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086608	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086610	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086611	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086612	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086614	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086615	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086616	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086618	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086619	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086620	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086622	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086623	FX	1,582	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086628	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086630	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086631	FX	2,183	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086632	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086634	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086635	FX	2,183	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086637	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086638	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086639	FX	2,183	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086668	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086670	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086671	FX	2,183	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086672	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086674	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086675	FX	2,183	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086677	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086678	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086679	FX	2,183	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086716	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086718	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086719	FX	3,190	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086720	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086722	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086723	FX	3,190	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086725	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086726	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086727	FX	3,190	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086740	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2086742	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086743	FX	3,190	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086744	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086746	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086747	FX	3,190	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086749	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086750	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086751	FX	3,190	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086764	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086766	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086767	FX	3,095	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086768	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086770	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086771	FX	3,095	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086773	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086774	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086775	FX	3,095	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086788	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086790	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086791	FX	3,095	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086792	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086794	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086795	FX	3,095	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086797	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086798	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086799	FX	3,095	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086812	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086814	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086815	FX	8,920	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086816	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086818	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086819	FX	8,920	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086820	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086822	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086823	FX	8,920	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086852	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086854	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086855	FX	8,920	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086856	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086858	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086859	FX	8,920	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086860	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086862	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2086863	FX	8,920	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087012	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087014	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087015	FX	2,230	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087016	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087018	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087019	FX	2,230	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087020	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087022	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087023	FX	2,230	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087052	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087054	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087055	FX	2,230	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087056	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087058	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087059	FX	2,230	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087060	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087062	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087063	FX	2,230	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087088	FX	1,200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087090	FX	1,200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087091	FX	1,200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087093	FX	1,200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087109	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087111	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087112	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087114	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087115	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087117	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087118	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087119	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087120	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087121	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087122	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087123	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087124	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087125	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087126	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087127	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087129	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087130	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087132	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087133	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087135	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087136	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087138	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087139	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087140	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087141	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087142	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087144	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087145	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087147	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087163	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087165	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087166	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087168	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087169	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087171	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087172	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087173	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087174	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087175	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087176	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087177	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087178	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087179	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087180	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087181	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087183	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087184	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087186	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087187	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087189	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087190	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087192	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087193	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087194	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087195	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087196	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087198	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087199	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087201	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087202	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087204	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087205	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087206	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087208	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087209	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087210	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087212	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087213	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087214	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087216	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087217	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087219	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087220	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087221	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087222	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087224	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087225	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087226	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087228	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087229	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087230	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087232	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087233	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087234	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087236	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087237	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087238	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087240	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087241	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087243	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087244	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087245	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087247	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087248	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087249	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087250	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087252	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087253	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087254	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087256	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087257	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087258	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087260	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087261	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087262	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087264	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087265	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087266	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087268	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087269	FX	2,414	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087271	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087272	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087273	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087274	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087276	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087277	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087278	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087280	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087281	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087282	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087284	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087285	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087286	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087288	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087289	FX	2,414	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087290	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087292	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087293	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087295	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087296	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087297	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087299	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087300	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087301	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087302	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087304	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087305	FX	2,414	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087312	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087314	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087315	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087316	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087317	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087318	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087320	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087321	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087323	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087324	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087326	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087327	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087329	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087342	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087344	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087345	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087346	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087347	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087348	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087350	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087351	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087353	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087354	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087356	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087357	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087359	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087374	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087376	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087377	FX	1,429	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087379	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087380	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087381	FX	1,429	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087382	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087384	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087385	FX	1,429	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087386	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087388	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087389	FX	1,429	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087390	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087392	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087393	FX	1,429	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087394	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087396	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087397	FX	1,429	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087414	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087416	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087417	FX	1,429	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087419	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087420	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087421	FX	1,429	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087422	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087424	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087425	FX	1,429	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087426	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087428	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087429	FX	1,429	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087430	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087432	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087433	FX	1,429	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087434	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087436	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087437	FX	1,429	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087451	FX	800,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087452	FX	800,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087453	FX	39,437	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087454	FX	800,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087456	FX	800,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087457	FX	39,437	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087458	FX	800,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087460	FX	800,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087461	FX	39,437	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087491	FX	800,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087492	FX	800,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087493	FX	39,437	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087494	FX	800,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087496	FX	800,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087497	FX	39,437	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087498	FX	800,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087500	FX	800,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087501	FX	39,437	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087577	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087579	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087580	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087582	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087583	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087585	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087586	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087587	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087588	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087589	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087590	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087591	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087592	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087593	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087594	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087595	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087597	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087598	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087600	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087601	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087603	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087604	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087606	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087607	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087608	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087609	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087610	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087612	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087613	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087615	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087631	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087633	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087634	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087636	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087637	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087639	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087640	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087641	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087642	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087643	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087644	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087645	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087646	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087647	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087648	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087649	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087651	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087652	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087654	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087655	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087657	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087658	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087660	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087661	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087662	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087663	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087664	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087666	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087667	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087669	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087670	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087672	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087673	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087674	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087676	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087677	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087679	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087680	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087681	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087683	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087684	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087685	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087687	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087688	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087689	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087690	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087692	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087693	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087694	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087696	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087697	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087698	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087700	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087701	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087702	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087704	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087705	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087707	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087708	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087709	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087710	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087712	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087713	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087714	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087716	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087717	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087718	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087720	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087721	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087723	FX	200,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087724	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087725	FX	8,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087727	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087728	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087729	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087731	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087732	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087733	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087734	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087736	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087737	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087738	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087740	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087741	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087742	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087744	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087745	FX	8,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087746	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087748	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087749	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087751	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087752	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087753	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087754	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087756	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087757	FX	8,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087767	FX	3,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087769	FX	3,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087770	FX	3,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087772	FX	3,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087789	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087791	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087792	FX	7,660	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087793	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087795	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087796	FX	7,660	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087797	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087799	FX	200,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087800	FX	7,660	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087801	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087803	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087804	FX	7,660	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087853	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087855	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087856	FX	3,905	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087858	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087859	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087860	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2087877	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087879	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087880	FX	3,905	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087882	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087883	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087884	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087906	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087907	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087908	FX	10,952	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087909	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087911	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087912	FX	10,952	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087913	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087915	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087916	FX	10,952	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087938	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087939	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087940	FX	10,952	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087941	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087943	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087944	FX	10,952	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087945	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087947	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087948	FX	10,952	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087965	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087967	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087968	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087969	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087970	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087971	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087972	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087973	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087974	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087975	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087976	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087977	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087979	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087980	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087982	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087983	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087985	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087986	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087988	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087989	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087990	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087991	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087992	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087994	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087995	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2087997	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088004	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088006	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088007	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088008	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088009	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088010	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088011	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088012	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088013	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088014	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088015	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088016	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088018	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088019	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088021	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088022	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088024	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088025	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088027	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088028	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088029	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088030	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088031	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088033	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088034	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088036	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088063	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088065	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088066	FX	10,551	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088067	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088069	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088070	FX	10,551	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088071	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088073	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088074	FX	10,551	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088075	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088077	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088078	FX	10,551	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088080	FX	236,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088081	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088082	FX	10,551	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088083	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088085	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088086	FX	10,551	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088087	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088089	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088090	FX	10,551	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088111	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088113	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088114	FX	1,028	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088115	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088117	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088118	FX	1,028	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088119	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088121	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088122	FX	1,028	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088123	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088125	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088126	FX	1,028	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088128	FX	23,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088129	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088130	FX	1,028	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088131	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088133	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088134	FX	1,028	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088135	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088137	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088138	FX	1,028	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088159	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088161	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088162	FX	11,579	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088163	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088165	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088166	FX	11,579	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088167	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088169	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088170	FX	11,579	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088171	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088173	FX	259,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088174	FX	11,579	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088176	FX	259,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088177	FX	259,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088178	FX	11,579	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088179	FX	259,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088181	FX	259,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088182	FX	11,579	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088183	FX	259,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088185	FX	259,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088186	FX	11,579	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088263	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088264	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088269	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088270	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088271	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088273	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088274	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088276	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088277	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088279	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088280	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088282	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088283	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088285	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088286	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088288	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088289	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088291	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088292	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088294	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088295	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088297	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088298	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088299	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088300	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088301	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088302	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088303	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088304	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088305	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088306	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088307	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088309	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088310	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088312	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088313	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088315	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088316	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088318	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088319	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088320	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088321	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088322	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088323	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088324	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088325	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088327	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088328	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088330	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088331	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088333	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088334	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088336	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088337	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088338	FX	50,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088339	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088340	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088341	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088342	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088343	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088344	FX	50,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088345	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088346	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088348	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088349	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088351	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088352	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088354	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088355	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088357	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088358	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088359	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088360	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088361	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088362	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088363	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088364	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088366	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088367	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088369	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088370	FX	3,905	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088372	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088373	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088374	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088375	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088377	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088378	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088391	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088393	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088394	FX	3,905	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088396	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088397	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088398	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088399	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088401	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088402	FX	3,905	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088416	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088420	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088424	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088428	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088429	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088430	FX	6,188	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088432	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088433	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088434	FX	6,188	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088436	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088437	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088438	FX	6,188	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088440	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088444	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088448	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088452	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088456	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088457	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088458	FX	6,188	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088460	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088461	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088462	FX	6,188	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088464	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088484	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088488	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088492	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088496	FX	100,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088497	FX	100,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088498	FX	6,188	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088500	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088501	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088502	FX	6,188	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088504	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088505	FX	100,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088506	FX	6,188	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088508	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088512	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088516	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088520	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088524	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088525	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088526	FX	6,188	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088528	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088529	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088530	FX	6,188	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088532	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088647	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088649	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088650	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088652	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088653	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088655	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088656	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088658	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088659	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088661	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088662	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088664	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088665	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088667	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088668	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088670	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088671	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088673	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088674	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088676	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088677	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088679	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088680	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088682	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088683	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088685	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088692	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088694	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088695	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088697	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088698	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088700	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088701	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088703	FX	50,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088704	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088706	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088707	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088709	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088710	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088712	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088713	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088715	FX	50,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088716	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088718	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088719	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088721	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088722	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088724	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088725	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088727	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088728	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088730	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088731	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088733	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088734	FX	49,816	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088735	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088737	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088738	FX	49,816	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088740	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088741	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088742	FX	5,140	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088764	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088765	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088766	FX	5,140	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088813	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088815	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088816	FX	17,840	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088817	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088819	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088820	FX	17,840	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088821	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088822	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088824	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088825	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088834	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088835	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088837	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088838	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088847	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088849	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088850	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088852	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088853	FX	7,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088854	FX	7,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088859	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088861	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088862	FX	24,471	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088863	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088865	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088866	FX	24,471	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088867	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088869	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088870	FX	24,471	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088872	FX	500,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088873	FX	500,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088874	FX	24,471	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088876	FX	500,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088877	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088878	FX	24,471	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088880	FX	500,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088881	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088882	FX	24,471	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088883	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088885	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088886	FX	24,471	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088887	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088889	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088890	FX	24,471	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088891	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088893	FX	500,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088894	FX	24,471	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088895	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088897	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088898	FX	24,471	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088900	FX	500,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088901	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088902	FX	24,471	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088907	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088909	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088910	FX	11,550	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088911	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088913	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088914	FX	11,550	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088915	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088917	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088918	FX	11,550	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088920	FX	236,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088921	FX	236,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088922	FX	11,550	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088924	FX	236,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088925	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088926	FX	11,550	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088928	FX	236,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088929	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088930	FX	11,550	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088931	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088933	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088934	FX	11,550	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088935	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088937	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088938	FX	11,550	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088939	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088941	FX	236,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088942	FX	11,550	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088943	FX	236,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088945	FX	236,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088946	FX	11,550	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088948	FX	236,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088949	FX	236,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088950	FX	11,550	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088955	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2088957	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088958	FX	1,126	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088959	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088961	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088962	FX	1,126	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088963	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088965	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088966	FX	1,126	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088968	FX	23,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088969	FX	23,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088970	FX	1,126	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088972	FX	23,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088973	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088974	FX	1,126	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088976	FX	23,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088977	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088978	FX	1,126	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088979	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088981	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088982	FX	1,126	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088983	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088985	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088986	FX	1,126	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088987	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088989	FX	23,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088990	FX	1,126	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088991	FX	23,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088993	FX	23,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088994	FX	1,126	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088996	FX	23,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088997	FX	23,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2088998	FX	1,126	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089003	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089005	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089006	FX	37,146	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089007	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089009	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089010	FX	37,146	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089011	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089013	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089014	FX	37,146	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089016	FX	759,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089017	FX	759,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089018	FX	37,146	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089020	FX	759,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089021	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089022	FX	37,146	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089024	FX	759,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089025	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089026	FX	37,146	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089027	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089029	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089030	FX	37,146	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089031	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2089033	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089034	FX	37,146	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089035	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089037	FX	759,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089038	FX	37,146	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089039	FX	759,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089041	FX	759,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089042	FX	37,146	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089044	FX	759,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089045	FX	759,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089046	FX	37,146	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089048	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089049	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089050	FX	9,976	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089051	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089053	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089054	FX	9,976	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089056	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089057	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089058	FX	9,976	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089076	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089077	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089078	FX	9,976	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089079	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089081	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089082	FX	9,976	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089084	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089085	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089086	FX	9,976	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089131	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089132	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089133	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089134	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089135	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089145	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089146	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089147	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089148	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089149	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089454	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089456	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089457	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089459	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089461	FX	35,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089462	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089463	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089465	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089466	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089468	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089493	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089495	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089496	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089498	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089500	FX	35,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2089501	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089502	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089504	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089505	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089507	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089532	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089534	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089535	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089536	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089538	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089539	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089541	FX	35,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089542	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089543	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089544	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089546	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089547	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089548	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089550	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089551	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089584	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089586	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089587	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089588	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089590	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089591	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089593	FX	35,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089594	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089595	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089596	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089598	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089599	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089600	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089602	FX	35,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089603	FX	1,580	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089642	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089644	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089645	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089647	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089649	FX	1,000,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089650	FX	1,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089651	FX	48,456	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089652	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089654	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089655	FX	48,456	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089656	FX	1,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089658	FX	1,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089659	FX	48,456	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089673	FX	1,000,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089674	FX	1,000,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089675	FX	48,456	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089676	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089678	FX	1,000,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089679	FX	48,456	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2089680	FX	1,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089682	FX	1,000,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089683	FX	48,456	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089702	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089704	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089720	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089722	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089739	FX	900,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089740	FX	900,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089741	FX	44,248	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089742	FX	900,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089744	FX	900,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089745	FX	44,248	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089763	FX	900,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089764	FX	900,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089765	FX	44,248	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089766	FX	900,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089768	FX	900,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089769	FX	44,248	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089787	FX	150,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089788	FX	150,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089789	FX	7,160	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089790	FX	150,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089792	FX	150,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089793	FX	7,160	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089815	FX	150,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089816	FX	150,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089817	FX	7,160	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089818	FX	150,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089820	FX	150,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2089821	FX	7,160	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090029	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090030	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090031	FX	2,381	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090069	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090070	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090071	FX	2,381	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090118	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090119	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090120	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090121	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090122	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090123	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090124	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090125	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090126	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090127	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090128	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090129	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090130	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090131	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090132	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090133	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090134	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2090135	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090136	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090137	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090138	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090139	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090140	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090141	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090142	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090144	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090145	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090147	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090149	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090150	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090151	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090152	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090153	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090154	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090155	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090156	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090196	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090197	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090198	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090199	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090200	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090201	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090202	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090203	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090204	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090205	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090206	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090207	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090208	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090209	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090210	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090211	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090212	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090213	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090214	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090215	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090216	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090217	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090218	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090219	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090220	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090222	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090223	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090225	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090227	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090228	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090229	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090230	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090231	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090232	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090233	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2090234	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090377	FX	1,100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090378	FX	1,100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090379	FX	80,326	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090380	FX	1,100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090382	FX	1,100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090383	FX	80,326	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090509	FX	987,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090510	FX	987,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090511	FX	72,074	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090512	FX	987,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090514	FX	987,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090515	FX	72,074	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090701	FX	103,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090702	FX	103,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090703	FX	7,521	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090704	FX	103,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090706	FX	103,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090707	FX	7,521	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090893	FX	10,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090894	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090895	FX	730	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090896	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090898	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2090899	FX	730	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091081	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091082	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091083	FX	9,855	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091084	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091086	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091087	FX	9,855	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091117	FX	200,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091118	FX	200,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091119	FX	9,855	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091120	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091122	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091123	FX	9,855	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091188	FX	400,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091189	FX	400,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091190	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091191	FX	400,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091224	FX	400,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091225	FX	400,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091226	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091227	FX	400,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091242	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091243	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091244	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091245	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091246	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091247	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091248	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091249	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091250	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2091252	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091253	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091254	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091255	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091256	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091258	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091259	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091260	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091261	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091262	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091263	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091264	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091265	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091266	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091268	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091269	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091271	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091273	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091274	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091275	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091276	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091277	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091278	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091279	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091280	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091398	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091399	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091400	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091401	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091402	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091403	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091404	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091405	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091406	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091408	FX	250,000	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091409	FX	250,000	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091410	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091411	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091412	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091414	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091415	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091416	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091417	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091418	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091419	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091420	FX	250,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091421	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091422	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091424	FX	250,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091425	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091427	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091429	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091430	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091431	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2091432	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091433	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091434	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091435	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091436	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091477	FX	600,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091478	FX	600,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091479	FX	29,135	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091480	FX	600,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091482	FX	600,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091483	FX	29,135	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091501	FX	600,000	may-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091502	FX	600,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091503	FX	29,135	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091504	FX	600,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091506	FX	600,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091507	FX	29,135	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091524	FX	684,211	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091527	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091529	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091531	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091533	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091535	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091537	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091538	FX	684,211	abr-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091541	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091543	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091545	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091547	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091549	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091551	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091553	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091555	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091557	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091559	FX	684,211	abr-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091572	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091573	FX	500,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091574	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091575	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091576	FX	500,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091577	FX	500,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091578	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091579	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091580	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091581	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091582	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091583	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091669	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091673	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091677	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091678	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091679	FX	6,030	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091681	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091682	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2091683	FX	6,030	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091685	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091753	FX	100,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091757	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091761	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091762	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091763	FX	6,030	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091765	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091766	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091767	FX	6,030	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091769	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091852	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091854	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091855	FX	1,071	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091856	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091858	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091859	FX	1,071	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091876	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091878	FX	25,000	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091879	FX	1,071	may-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091880	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091882	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2091883	FX	1,071	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092043	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092044	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092045	FX	2,110	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092067	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092068	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092069	FX	2,110	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092235	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092236	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092247	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092248	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092307	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092308	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092309	FX	4,567	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092331	FX	300,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092332	FX	300,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092333	FX	13,702	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092355	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092356	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092357	FX	4,567	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092379	FX	100,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092380	FX	100,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092381	FX	4,567	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092433	FX	400,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092434	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092435	FX	17,585	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092457	FX	400,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092458	FX	400,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2092459	FX	17,585	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093508	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093509	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093510	FX	9,852	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED



Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2093532	FX	250,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093533	FX	250,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093534	FX	9,852	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093742	FX	115,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093743	FX	115,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093744	FX	7,831	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093746	FX	115,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093747	FX	115,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093748	FX	7,831	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093750	FX	115,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093751	FX	115,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093752	FX	7,831	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093754	FX	115,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093755	FX	115,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093756	FX	7,831	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093838	FX	125,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093839	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093840	FX	8,512	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093842	FX	125,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093843	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093844	FX	8,512	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093846	FX	125,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093847	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093848	FX	8,512	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093850	FX	125,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093851	FX	125,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093852	FX	8,512	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093934	FX	10,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093935	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093936	FX	681	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093938	FX	10,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093939	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093940	FX	681	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093942	FX	10,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093943	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093944	FX	681	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093946	FX	10,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093947	FX	10,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2093948	FX	681	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094030	FX	25,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094031	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094032	FX	924	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094054	FX	25,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094055	FX	25,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094056	FX	924	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094158	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094159	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094160	FX	8,079	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094182	FX	200,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094183	FX	200,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094184	FX	8,079	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094562	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094563	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094564	FX	3,634	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094598	FX	50,000	jun-22	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094599	FX	50,000	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2094600	FX	3,634	jun-22	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022040103361	B	USDMXN	jun-22	362,000	20.16	(7,298,501)
2022040103329	SO	USDMXN	jun-22	(362,000)	20.16	7,299,658
2022040103380	BO	USDMXN	jun-22	100,000	20.15	(2,014,840)
2022040103357	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.23	2,022,500
2022040103349	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.08	(602,482)
2022040103318	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.09	602,760
2022040403216	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.08	(602,394)
2022040403265	B	USDMXN	jun-22	30,000	20.02	(600,475)
2022040403102	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.09	602,610
2022040403242	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.03	600,765
2022041203502	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.10	(1,206,080)
2022041203462	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.11	1,206,750
2022041203500	B	USDMXN	jun-22	50,000	20.09	(1,004,748)
2022041303181	BO	USDMXN	jun-22	400,000	20.07	(8,027,471)
2022041203456	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.15	1,007,500
2022041303191	SO	USDMXN	jun-22	(400,000)	20.14	8,054,120
2022040103348	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.06	(601,723)
2022040103319	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.07	602,010
2022040103552	B	USDMXN	jun-22	1,148,857	20.13	(23,129,280)
2022040403217	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.05	(601,620)
2022040403262	B	USDMXN	jun-22	30,000	19.99	(599,704)
2022041203477	B	USDMXN	jun-22	210,000	20.07	(4,214,699)
2022040103648	SO	USDMXN	jun-22	(140,440)	20.59	2,892,221
2022040103649	SO	USDMXN	jun-22	(1,008,417)	20.59	20,767,340
2022040103651	SO	USDMXN	jun-22	(787,234)	20.59	16,212,297
2022040103652	SO	USDMXN	jun-22	(22,953)	20.59	472,694
2022040103662	SO	USDMXN	jun-22	(198,230)	20.59	4,082,349
2022040403103	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.06	601,860
2022040403243	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.00	600,015
2022041203473	SO	USDMXN	jun-22	(210,000)	20.09	4,219,320
2022041203498	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.07	(1,204,492)
2022041203463	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.09	1,205,190
2022041303476	B	USDMXN	jun-22	200,000	19.99	(3,997,896)
2022041303389	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	22.60	2,260,200
2022041303390	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	21.68	2,167,600
2022040603416	B	USDMXN	jun-22	52,944	20.41	(1,080,624)
2022040603457	SO	USDMXN	jun-22	(52,944)	20.88	1,105,624
2022040103347	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.03	(600,965)
2022040703242	B	USDMXN	jun-22	192,976	20.39	(3,935,453)
2022040103320	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.04	601,245
2022040703190	SO	USDMXN	jun-22	(192,976)	20.84	4,021,234
2022040403215	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.03	(600,846)
2022040403260	B	USDMXN	jun-22	30,000	19.96	(598,933)
2022042203510	B	USDMXN	jun-22	127,745	20.49	(2,617,308)
2022042203512	B	USDMXN	jun-22	853,907	20.50	(17,504,865)
2022042203515	B	USDMXN	jun-22	372,578	20.50	(7,639,029)
2022042203517	B	USDMXN	jun-22	3,790,333	20.50	(77,699,588)
2022042203519	B	USDMXN	jun-22	565,997	20.50	(11,601,928)
2022042203521	B	USDMXN	jun-22	126,557	20.50	(2,594,457)
2022042203523	B	USDMXN	jun-22	381,124	20.50	(7,813,050)
2022042203531	B	USDMXN	jun-22	852,168	20.49	(17,462,929)
2022042503250	B	USDMXN	jun-22	120,000	20.48	(2,457,544)
2022040403104	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.04	601,110
2022040403244	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	19.98	599,250
2022042203500	SO	USDMXN	jun-22	(7,070,409)	20.48	144,773,699
2022042203556	SON	USDMXN	jun-22	(7,070,409)	20.48	144,773,699
2022042503199	SO	USDMXN	jun-22	(120,000)	20.60	2,471,940
2022041203496	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.04	(1,202,693)
2022041203464	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.06	1,203,630



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041303474	B	USDMXN	jun-22	200,000	19.96	(3,992,766)
2022041303391	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	22.58	2,257,500
2022041303392	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	21.65	2,165,000
2022041303325	B	USDMXN	jun-22	250,000	20.01	(5,002,624)
2022041903234	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.29	(1,014,691)
2022041303248	SO	USDMXN	jun-22	(250,000)	20.01	5,001,275
2022041303253	SO	USDMXN	jun-22	(250,000)	20.01	5,001,275
2022041303339	SO	USDMXN	jun-22	(3,541,393)	20.03	70,921,704
2022041303409	SON	USDMXN	jun-22	(3,541,393)	20.03	70,921,704
2022041903271	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.34	1,016,800
2022040103346	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.01	(600,210)
2022042803454	S	USDMXN	jun-22	(2,691,827)	20.73	55,789,175
2022040103321	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.02	600,495
2022042803429	BO	USDMXN	jun-22	2,691,827	20.73	(55,809,648)
2022042803484	BON	USDMXN	jun-22	2,691,827	20.73	(55,809,648)
2022040403214	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.00	(600,085)
2022040403258	B	USDMXN	jun-22	30,000	19.94	(598,174)
2022041203494	B	USDMXN	jun-22	210,000	20.02	(4,204,825)
2022042103192	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.38	(1,018,782)
2022042503247	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.44	(1,226,567)
2022040403105	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.01	600,345
2022040403245	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	19.95	598,500
2022041203474	SO	USDMXN	jun-22	(210,000)	20.04	4,208,505
2022042103226	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.43	1,021,250
2022042503200	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.57	1,234,290
2022040103366	B	USDMXN	may-22	1,102,000	20.06	(22,101,562)
2022041203491	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.02	(1,201,192)
2022050303378	BO	USDMXN	jun-22	719,212	20.51	(14,752,716)
2022040103330	SO	USDMXN	may-22	(1,102,000)	20.06	22,103,145
2022041203465	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.04	1,202,130
2022050303375	SO	USDMXN	jun-22	(719,212)	20.52	14,755,359
2022050303465	SON	USDMXN	jun-22	(719,212)	20.52	14,755,359
2022041303472	B	USDMXN	jun-22	200,000	19.94	(3,987,710)
2022041803213	B	EURMXN	jun-22	750,000	21.79	(16,343,494)
2022041803228	B	USDMXN	jun-22	4,000,000	20.14	(80,575,056)
2022041803230	B	USDMXN	jun-22	1,500,000	20.14	(30,216,716)
2022041303393	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	22.55	2,254,900
2022041303394	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	21.71	2,171,290
2022041803215	S	EURMXN	jun-22	(750,000)	21.80	16,347,750
2022041803220	S	EURMXN	jun-22	(750,000)	21.80	16,347,750
2022041803226	S	USDMXN	jun-22	(4,000,000)	20.15	80,591,200
2022041803232	S	USDMXN	jun-22	(1,500,000)	20.15	30,221,700
2022041803236	S	USDMXN	jun-22	(4,000,000)	20.15	80,591,200
2022041803241	S	USDMXN	jun-22	(1,500,000)	20.15	30,221,700
2022040103379	BO	USDMXN	may-22	100,000	20.04	(2,003,641)
2022041203489	B	USDMXN	jun-22	50,000	20.01	(1,000,724)
2022041903233	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.27	(1,013,357)
2022042603542	B	USDMXN	jun-22	2,000,000	20.60	(41,202,754)
2022050503385	B	USDMXN	jun-22	100,000	20.49	(2,048,531)
2022040103358	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	20.11	2,011,300
2022041203457	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.07	1,003,650
2022041903272	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.31	1,015,475
2022042603546	SO	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.59	41,182,000
2022050503261	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	21.70	2,170,300
2022040103345	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.98	(599,456)
2022040103322	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	19.99	599,745
2022040403213	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.98	(599,334)
2022040403255	B	USDMXN	may-22	30,000	19.91	(597,425)
2022041103494	B	USDMXN	jun-22	200,000	20.09	(4,017,147)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022042103191	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.35	(1,017,388)
2022042503243	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.42	(1,225,238)
2022040403106	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	19.99	599,595
2022040403246	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	19.93	597,750
2022041103460	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	22.52	2,252,200
2022041103461	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	21.70	2,170,110
2022042103227	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.40	1,019,925
2022042503201	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.55	1,232,730
2022042503320	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.54	1,232,670
2022041203485	B	USDMXN	jun-22	60,000	19.99	(1,199,633)
2022041803426	B	USDMXN	jun-22	300,000	20.09	(6,026,098)
2022042203509	S	USDMXN	jun-22	(127,745)	20.43	2,609,544
2022050403430	B	USDMXN	jun-22	210,000	20.25	(4,252,254)
2022041203466	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.01	1,200,600
2022041803309	SO	USDMXN	jun-22	(150,000)	19.95	2,993,175
2022041803311	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	19.95	997,725
2022041803312	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	19.95	997,725
2022041803313	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	19.95	997,725
2022042203499	BO	USDMXN	jun-22	127,745	20.41	(2,607,273)
2022042203554	BON	USDMXN	jun-22	127,745	20.41	(2,607,273)
2022050403262	SO	USDMXN	jun-22	(210,000)	20.43	4,290,615
2022050203342	B	USDMXN	jun-22	900,000	20.68	(18,610,365)
2022050403416	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.24	(1,214,554)
2022050203340	S	USDMXN	jun-22	(900,000)	20.69	18,621,900
2022050203351	S	USDMXN	jun-22	(900,000)	20.69	18,621,900
2022050403323	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.43	1,225,860
2022041203483	B	USDMXN	may-22	60,000	19.99	(1,199,352)
2022041203507	SO	USDMXN	may-22	(10,000)	19.98	199,797
2022041903106	BO	USDMXN	jun-22	5,000,000	20.15	(100,766,545)
2022041903478	B	USDMXN	jun-22	300,000	20.24	(6,072,158)
2022041203458	SO	USDMXN	may-22	(50,000)	20.05	1,002,375
2022041903104	SO	USDMXN	jun-22	(5,300,000)	20.16	106,832,100
2022041903114	SO	USDMXN	jun-22	(5,300,000)	20.16	106,832,100
2022041903111	BO	USDMXN	jun-22	300,000	20.15	(6,046,229)
2022041903116	SO	USDMXN	jun-22	(300,000)	20.17	6,049,726
2022051203386	S	USDMXN	jun-22	(1,614,548)	20.51	33,111,128
2022051303634	B	USDMXN	jun-22	100,000	20.29	(2,028,950)
2022051303655	BO	USDMXN	jun-22	24,950	20.30	(506,471)
2022051203375	BO	USDMXN	jun-22	1,614,548	20.48	(33,072,406)
2022051203408	BON	USDMXN	jun-22	1,614,548	20.48	(33,072,406)
2022051303387	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	22.63	2,262,700
2022051303638	SO	USDMXN	jun-22	(24,950)	20.26	505,564
2022040103547	B	USDMXN	may-22	836,687	20.04	(16,764,262)
2022040403222	BO	USDMXN	may-22	10,000	19.94	(199,410)
2022041103492	B	USDMXN	may-22	100,000	20.06	(2,005,845)
2022042503241	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.40	(1,223,779)
2022051103043	B	USDMXN	jun-22	500,000	20.45	(10,225,168)
2022051603222	B	USDMXN	jun-22	120,000	20.26	(2,430,670)
2022040103653	SO	USDMXN	may-22	(129,525)	20.59	2,667,438
2022040103654	SO	USDMXN	may-22	(707,162)	20.59	14,563,294
2022040103655	SO	USDMXN	may-22	(176,344)	20.59	3,631,628
2022040103656	SO	USDMXN	may-22	(510,816)	20.59	10,519,745
2022040103657	SO	USDMXN	may-22	(20,002)	20.59	411,921
2022040403157	SO	USDMXN	may-22	(10,000)	20.02	200,245
2022041103462	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	22.58	2,257,500
2022042503202	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.52	1,230,990
2022051103045	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.55	10,274,000
2022051603108	SO	USDMXN	jun-22	(120,000)	20.25	2,430,180
2022041103490	B	USDMXN	may-22	100,000	20.06	(2,005,596)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041203481	B	USDMXN	may-22	60,000	19.97	(1,198,241)
2022041303212	BO	USDMXN	may-22	100,000	19.90	(1,990,242)
2022050603334	BO	USDMXN	jun-22	3,500,000	20.26	(70,900,155)
2022051703473	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.15	(11,165,774)
2022041103463	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	21.32	2,132,290
2022041203467	SO	USDMXN	may-22	(60,000)	19.99	1,199,100
2022041303192	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	19.98	1,997,900
2022050603335	SO	USDMXN	jun-22	(3,500,000)	20.26	70,913,500
2022050603339	SO	USDMXN	jun-22	(3,500,000)	20.26	70,913,500
2022051703415	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.14	11,155,621
2022040403221	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.93	(598,015)
2022041903166	BO	USDMXN	jun-22	20,000	19.93	(398,555)
2022050403413	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.24	(1,214,114)
2022051603210	BO	USDMXN	jun-22	883,993	20.24	(17,893,749)
2022051603323	BO	USDMXN	jun-22	277	20.21	(5,604)
2022051703295	B	USDMXN	jun-22	30,000	20.14	(604,085)
2022040403158	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	20.02	600,510
2022041903101	SO	USDMXN	jun-22	(20,000)	20.01	400,100
2022050403324	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.40	1,224,240
2022051603188	SON	USDMXN	jun-22	(884,270)	20.24	17,900,017
2022051703254	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.18	605,340
2022040103373	BO	USDMXN	may-22	90,000	19.93	(1,793,879)
2022040403220	BO	USDMXN	may-22	60,000	19.93	(1,195,814)
2022040603414	B	USDMXN	may-22	48,249	20.31	(979,700)
2022041903167	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.92	(597,717)
2022041903440	SO	USDMXN	may-22	(3,000,000)	20.22	60,669,827
2022041903441	SO	USDMXN	may-22	(1,000,000)	20.22	20,221,376
2022041903448	S	USDMXN	may-22	(9,442)	20.22	190,895
2022041903457	S	USDMXN	may-22	(4,000,000)	20.22	80,872,668
2022042703449	BO	USDMXN	jun-22	41,700	20.57	(857,695)
2022042703461	BO	USDMXN	jun-22	16	20.58	(329)
2022051603325	B	USDMXN	jun-22	50,000	20.21	(1,010,422)
2022051703203	BO	USDMXN	jun-22	883,993	20.15	(17,810,975)
2022051703293	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.13	(1,207,936)
2022051703302	BO	USDMXN	jun-22	277	20.14	(5,582)
2022051903150	BO	USDMXN	jun-22	12,500	20.09	(251,097)
2022040103367	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	20.04	601,140
2022040103368	SO	USDMXN	may-22	(60,000)	20.01	1,200,480
2022040403159	SO	USDMXN	may-22	(60,000)	20.01	1,200,810
2022040603458	SO	USDMXN	may-22	(48,249)	20.88	1,007,579
2022041903430	BO	USDMXN	may-22	8,709,442	20.22	(176,115,367)
2022041903438	BO	USDMXN	may-22	8,000,000	20.22	(161,752,000)
2022041903465	BON	USDMXN	may-22	8,709,442	20.22	(176,115,367)
2022041903467	BON	USDMXN	may-22	8,000,000	20.22	(161,752,000)
2022041903102	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	20.00	600,045
2022042703450	SO	USDMXN	jun-22	(41,716)	20.58	858,348
2022051603311	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	22.29	1,114,450
2022051603345	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.29	1,014,450
2022051703183	SON	USDMXN	jun-22	(884,270)	20.15	17,816,189
2022051703255	SO	USDMXN	jun-22	(20,000)	20.17	403,480
2022051703256	SO	USDMXN	jun-22	(40,000)	20.19	807,760
2022051903121	SO	USDMXN	jun-22	(12,500)	20.05	250,633
2022040103371	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.97	(598,964)
2022040703240	B	USDMXN	may-22	163,880	20.29	(3,325,016)
2022042003128	B	USDMXN	may-22	683,900	20.14	(13,777,036)
2022051303594	B	USDMXN	jun-22	50,000	20.27	(1,013,668)
2022051303653	BO	USDMXN	jun-22	34,150	20.27	(692,223)
2022051603213	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.22	(1,010,798)
2022051603322	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.22	(1,010,861)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022051703282	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.12	(1,005,818)
2022051703290	B	USDMXN	jun-22	10,000	20.13	(201,277)
2022051803458	BO	USDMXN	jun-22	60,000	20.18	(1,210,832)
2022051903369	BO	USDMXN	jun-22	48,400	20.06	(970,784)
2022052003023	BO	USDMXN	jun-22	50,000	19.99	(999,648)
2022052003282	BO	USDMXN	jun-22	504,000	20.01	(10,083,916)
2022052003328	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.03	(11,093,888)
2022040103369	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	20.00	600,120
2022040503509	BO	USDMXN	may-22	14,483,253	20.10	(291,156,844)
2022040503530	BON	USDMXN	may-22	14,483,253	20.10	(291,156,844)
2022040703191	SO	USDMXN	may-22	(163,880)	20.84	3,414,931
2022042003198	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.18	13,804,180
2022051303591	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.33	1,016,500
2022051303639	SO	USDMXN	jun-22	(34,150)	20.26	691,985
2022051603185	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.29	1,014,550
2022051603194	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.29	1,014,550
2022051603294	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.29	1,014,550
2022051603302	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.29	1,014,550
2022051703257	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.19	201,900
2022051703266	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.21	1,010,500
2022051803455	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.26	1,215,540
2022051903365	SO	USDMXN	jun-22	(48,400)	20.08	971,775
2022052003093	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.02	11,089,418
2022052003322	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.03	11,095,235
2022040103372	BO	USDMXN	may-22	10,000	19.92	(199,248)
2022041203289	BO	USDMXN	may-22	50,000	19.93	(996,611)
2022041903165	BO	USDMXN	may-22	50,000	19.91	(995,429)
2022042103296	BO	USDMXN	may-22	680,000	20.32	(13,814,736)
2022042103298	BO	USDMXN	may-22	3,900	20.31	(79,215)
2022042103516	B	USDMXN	may-22	683,900	20.34	(13,910,525)
2022042503238	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.36	(1,221,783)
2022042803148	S	USDMXN	jun-22	(3,100,000)	20.73	64,276,153
2022050503380	BO	USDMXN	jun-22	20,000	20.21	(404,231)
2022050603250	B	USDMXN	jun-22	300,000	20.22	(6,064,947)
2022052003491	BO	USDMXN	jun-22	18,300	20.03	(366,503)
2022052303406	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.96	(1,996,237)
2022052303545	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.03	(11,095,751)
2022040103370	SO	USDMXN	may-22	(10,000)	20.00	200,000
2022041203259	SO	USDMXN	may-22	(50,000)	20.01	1,000,650
2022041903103	SO	USDMXN	may-22	(50,000)	19.99	999,275
2022042103264	SO	USDMXN	may-22	(683,900)	20.32	13,899,242
2022042103321	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.32	13,899,242
2022042103378	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.35	13,918,049
2022042503203	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.49	1,229,280
2022042803144	BO	USDMXN	jun-22	3,100,000	20.57	(63,776,300)
2022050503242	SO	USDMXN	jun-22	(20,000)	20.28	405,690
2022050603213	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.25	2,024,500
2022050603214	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.25	2,024,500
2022050603215	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.25	2,024,500
2022050603591	SO	USDMXN	jun-22	(45,900)	20.30	931,678
2022052003478	SO	USDMXN	jun-22	(18,300)	20.04	366,759
2022052303282	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.09	2,008,990
2022052303480	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.01	11,084,155
2022052303495	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.01	11,084,155
2022040103246	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,665,747)
2022040103248	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,577)
2022040103251	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,587)
2022040103254	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,725)
2022040103257	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,726)

2022040103259	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,795)
2022040103261	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,666,438)
2022040103263	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,795)
2022040103265	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,666,021)
2022040103268	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,520)
2022040103270	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,644)
2022040103272	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,665,655)
2022040103274	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,915)
2022040103277	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,982)
2022040103280	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,717)
2022040103283	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,153)
2022040103287	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,509)
2022040103290	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,334)
2022040103293	B	USDMXN	may-22	684,211	19.97	(13,664,419)
2022041103488	B	USDMXN	may-22	100,000	20.03	(2,003,067)
2022042203397	BO	USDMXN	may-22	689,000	20.41	(14,060,647)
2022042203444	SO	USDMXN	may-22	(5,100)	20.35	103,789
2022050403485	BO	USDMXN	jun-22	90,000	20.20	(1,817,634)
2022050503379	BO	USDMXN	jun-22	30,000	20.21	(606,230)
2022051603211	BO	USDMXN	jun-22	589,504	20.22	(11,918,419)
2022052403373	B	USDMXN	jun-22	1,108,000	19.99	(22,145,597)
2022052403427	S	USDMXN	jun-22	(6,614,647)	20.01	132,344,700
2022052403429	S	USDMXN	jun-22	(6,172,577)	20.00	123,453,237
2022040103316	SO	USDMXN	may-22	(13,000,000)	19.84	257,920,000
2022042903570	SO	USDMXN	may-22	(13,000,000)	20.21	262,681,900
2022041103464	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	21.30	2,129,540
2022042203366	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.42	13,962,502
2022050403487	SO	USDMXN	jun-22	(90,000)	20.28	1,824,975
2022050503243	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.28	608,415
2022051603189	SON	USDMXN	jun-22	(589,504)	20.24	11,933,143
2022052403417	BO	USDMXN	jun-22	12,787,223	20.00	(255,731,681)
2022052403459	BON	USDMXN	jun-22	12,787,223	20.00	(255,731,681)
2022052403100	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.95	11,050,361
2022052403439	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.02	11,089,141
2022040503506	BO	USDMXN	may-22	42,300	20.10	(850,157)
2022042503337	B	USDMXN	may-22	1,367,800	20.35	(27,828,326)
2022042603517	BO	USDMXN	jun-22	19,900	20.52	(408,349)
2022050303121	BO	USDMXN	jun-22	48,000	20.46	(982,161)
2022050303425	B	USDMXN	jun-22	46,200	20.43	(943,767)
2022050403409	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.22	(1,213,210)
2022051003360	S	USDMXN	jun-22	(9,000,000)	20.48	184,354,758
2022051003364	S	USDMXN	jun-22	(5,734,029)	20.48	117,436,834
2022051703169	BO	USDMXN	jun-22	110,460	20.12	(2,222,247)
2022051703202	BO	USDMXN	jun-22	589,504	20.12	(11,863,095)
2022052403289	BO	USDMXN	jun-22	41,200	20.03	(825,121)
2022052503191	B	USDMXN	jun-22	1,154,000	19.97	(23,040,444)
2022040503512	SO	USDMXN	may-22	(42,300)	20.15	852,345
2022042503290	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.40	13,953,407
2022042503314	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.50	14,017,009
2022042603525	SO	USDMXN	jun-22	(19,900)	20.58	409,443
2022050303132	SO	USDMXN	jun-22	(48,000)	20.47	982,541
2022050303352	SO	USDMXN	jun-22	(46,200)	20.45	944,744
2022050403325	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.38	1,222,560
2022051003345	BO	USDMXN	jun-22	14,734,028	20.49	(301,892,876)
2022051003372	BON	USDMXN	jun-22	14,734,028	20.49	(301,892,876)
2022051703127	SO	USDMXN	jun-22	(110,460)	20.13	2,224,002
2022051703184	SON	USDMXN	jun-22	(589,504)	20.15	11,877,258
2022052403290	SO	USDMXN	jun-22	(41,200)	20.04	825,516
2022052503165	SO	USDMXN	jun-22	(600,000)	19.97	11,980,200
2022052503168	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.98	11,066,981



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041303509	BO	USDMXN	may-22	44,750	19.88	(889,583)
2022042603450	B	USDMXN	may-22	683,900	20.53	(14,037,937)
2022050403199	B	USDMXN	jun-22	197,600	20.35	(4,021,827)
2022050403407	B	USDMXN	jun-22	78,400	20.21	(1,584,635)
2022051203382	B	USDMXN	jun-22	50,000	20.45	(1,022,413)
2022051303411	B	USDMXN	jun-22	30,000	20.21	(606,449)
2022051303426	B	USDMXN	jun-22	100,000	20.22	(2,021,562)
2022051803261	BO	USDMXN	jun-22	18,950	20.14	(381,618)
2022051903149	BO	USDMXN	jun-22	12,500	20.06	(250,739)
2022052303405	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.95	(1,995,056)
2022052503102	BO	USDMXN	jun-22	41,200	19.95	(822,110)
2022052603530	B	USDMXN	jun-22	1,225,000	19.89	(24,368,472)
2022041303504	SO	USDMXN	may-22	(44,750)	19.98	894,284
2022042603426	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.51	14,027,815
2022050403184	SO	USDMXN	jun-22	(40,000)	20.37	814,880
2022050403185	SO	USDMXN	jun-22	(40,000)	20.37	814,880
2022050403186	SO	USDMXN	jun-22	(39,200)	20.37	798,582
2022050403187	SO	USDMXN	jun-22	(39,200)	20.37	798,582
2022050403188	SO	USDMXN	jun-22	(39,200)	20.37	798,582
2022050403264	SO	USDMXN	jun-22	(39,200)	20.39	799,092
2022050403292	SO	USDMXN	jun-22	(39,200)	20.37	798,308
2022051203365	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.44	1,022,150
2022051303214	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.36	1,017,950
2022051303215	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.40	611,970
2022051303268	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.30	1,014,950
2022051803353	SO	USDMXN	jun-22	(18,950)	20.19	382,582
2022051903122	SO	USDMXN	jun-22	(12,500)	20.05	250,633
2022052303283	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.09	2,008,990
2022052503099	SO	USDMXN	jun-22	(41,200)	19.97	822,599
2022052603418	SO	USDMXN	jun-22	(1,225,000)	21.73	26,624,763
2022040403076	BO	EURMXN	may-22	500,000	21.83	(10,916,050)
2022040703416	BO	USDMXN	may-22	22,850	20.22	(462,115)
2022042703175	B	USDMXN	may-22	683,900	20.59	(14,083,047)
2022042803367	BO	USDMXN	jun-22	23,400	20.61	(482,265)
2022051303407	B	USDMXN	jun-22	10,000	20.21	(202,088)
2022051303652	BO	USDMXN	jun-22	9,200	20.24	(186,207)
2022051803459	BO	USDMXN	jun-22	40,000	20.15	(806,062)
2022051903133	BO	USDMXN	jun-22	400,000	20.04	(8,014,728)
2022051903518	BO	USDMXN	jun-22	37,200	20.04	(745,509)
2022052303067	B	USDMXN	jun-22	1,500,000	19.91	(29,870,787)
2022052603315	BO	USDMXN	jun-22	400,000	19.88	(7,951,335)
2022052703706	B	USDMXN	jun-22	554,000	19.71	(10,921,144)
2022041303149	B	USDMXN	may-22	80,000,000	19.90	(1,592,192,000)
2022041303163	B	USDMXN	may-22	80,000,000	19.90	(1,592,192,000)
2022040703566	SO	USDMXN	may-22	(22,850)	20.28	463,352
2022041303260	B	USDMXN	may-22	80,000,000	19.90	(1,592,192,000)
2022042503294	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.50	14,017,009
2022042703065	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.57	14,064,404
2022042803373	SO	USDMXN	jun-22	(23,400)	20.67	483,561
2022051303216	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.40	203,950
2022051303640	SO	USDMXN	jun-22	(9,200)	20.26	186,421
2022051803456	SO	USDMXN	jun-22	(40,000)	20.23	809,180
2022051903100	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.07	2,006,750
2022051903101	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.07	2,006,750
2022051903102	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.07	2,006,750
2022051903103	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.07	2,006,750
2022051903494	SO	USDMXN	jun-22	(37,200)	20.05	745,823
2022052303110	SO	USDMXN	jun-22	(1,500,000)	20.21	30,314,400
2022052603303	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.91	1,991,100

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052603304	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.91	1,991,100
2022052603305	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.91	1,991,100
2022052603306	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.91	1,991,100
2022052703559	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.70	10,911,584
2022040803306	BO	USDMXN	may-22	20,300	20.21	(410,182)
2022042503235	B	USDMXN	may-22	45,000	20.34	(915,206)
2022042803320	B	USDMXN	may-22	683,900	20.60	(14,089,747)
2022042903590	B	USDMXN	jun-22	39,600	20.51	(812,260)
2022050303491	BO	USDMXN	jun-22	880,000	20.39	(17,945,834)
2022050403194	BO	USDMXN	jun-22	50,000	20.33	(1,016,578)
2022050403484	BO	USDMXN	jun-22	100,000	20.27	(2,026,805)
2022050403486	BO	USDMXN	jun-22	10,000	20.18	(201,806)
2022050603576	BO	USDMXN	jun-22	45,900	20.24	(929,027)
2022051303516	B	USDMXN	jun-22	129,280	20.26	(2,618,723)
2022051303610	BO	USDMXN	jun-22	33,602	20.23	(679,823)
2022052303070	BO	USDMXN	jun-22	500,000	19.92	(9,957,758)
2022052703397	BO	USDMXN	jun-22	19,300	19.72	(380,558)
2022053003406	B	USDMXN	jun-22	1,108,000	19.64	(21,755,627)
2022040803322	SO	USDMXN	may-22	(20,300)	20.26	411,258
2022041303344	BO	USDMXN	may-22	14,500,000	19.92	(288,796,500)
2022041303421	BON	USDMXN	may-22	14,500,000	19.92	(288,796,500)
2022042503204	SO	USDMXN	may-22	(45,000)	20.46	920,700
2022042803201	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.71	14,163,569
2022042903557	SO	USDMXN	jun-22	(39,600)	20.49	811,384
2022050303492	SO	USDMXN	jun-22	(880,000)	20.48	18,022,400
2022050403154	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.41	1,020,400
2022050403457	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.40	2,040,100
2022050403488	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.26	202,620
2022050603618	SO	USDMXN	jun-22	(45,900)	20.30	931,678
2022051303467	SO	USDMXN	jun-22	(33,600)	20.24	679,923
2022051303575	SO	USDMXN	jun-22	(68,039)	20.82	1,416,613
2022051303576	SO	USDMXN	jun-22	(36,286)	20.82	755,496
2022051303577	SO	USDMXN	jun-22	(24,957)	20.82	519,620
2022052303098	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.93	9,962,500
2022052703400	SO	USDMXN	jun-22	(19,300)	19.77	381,600
2022053003386	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.61	10,863,940
2022053003413	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.64	10,878,344
2022053003415	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.61	10,863,940
2022040803351	B	EURMXN	may-22	1,000,000	21.97	(21,969,461)
2022041303350	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	19.89	596,566
2022042903139	B	USDMXN	may-22	683,900	20.46	(13,991,807)
2022042903541	B	USDMXN	may-22	683,900	20.47	(13,999,958)
2022050403191	BO	USDMXN	jun-22	80,000	20.35	(1,627,668)
2022051303405	B	USDMXN	jun-22	10,000	20.20	(201,996)
2022051603212	BO	USDMXN	jun-22	500,000	20.19	(10,096,285)
2022051603231	BO	USDMXN	jun-22	34,000	20.20	(686,662)
2022051603293	BO	USDMXN	jun-22	41,100	20.17	(828,909)
2022051603449	BO	USDMXN	jun-22	68,000	20.15	(1,370,437)
2022051703124	BO	USDMXN	jun-22	500,000	20.05	(10,026,148)
2022052303536	BO	USDMXN	jun-22	47,200	20.00	(944,196)
2022052403464	BO	USDMXN	jun-22	350,000	19.96	(6,985,068)
2022053003144	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.59	(2,448,766)
2022053103491	BO	USDMXN	jun-22	554,000	19.80	(10,966,568)
2022053103527	SO	USDMXN	jun-22	(10,000,000)	19.80	197,971,640
2022053103543	S	USDMXN	jun-22	(18,916,504)	19.80	374,537,340
2022053103548	S	USDMXN	jun-22	(9,053,008)	19.80	179,223,884
2022040803349	S	EURMXN	may-22	(1,000,000)	21.97	21,974,400
2022040803358	S	EURMXN	may-22	(1,000,000)	21.97	21,974,400
2022041303359	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.88	(596,520)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022042903226	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.47	13,997,723
2022042903533	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.49	14,010,033
2022050403155	SO	USDMXN	jun-22	(80,000)	20.42	1,633,680
2022051303217	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.39	203,870
2022051603110	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.22	2,022,000
2022051603111	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.22	2,022,000
2022051603112	SO	USDMXN	jun-22	(150,000)	20.22	3,033,000
2022051603113	SO	USDMXN	jun-22	(150,000)	20.22	3,033,000
2022051603232	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.21	687,174
2022051603314	SO	USDMXN	jun-22	(41,100)	20.23	831,371
2022051603355	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.17	685,848
2022051603398	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.17	685,916
2022051703034	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.06	10,028,000
2022052303534	SO	USDMXN	jun-22	(47,200)	20.01	944,614
2022052403473	SO	USDMXN	jun-22	(350,000)	20.00	6,998,950
2022053003084	SO	USDMXN	jun-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003115	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.84	198,401
2022053103520	BO	USDMXN	jun-22	10,969,512	19.79	(217,130,525)
2022053103524	BO	USDMXN	jun-22	14,000,000	19.80	(277,158,000)
2022053103526	BO	USDMXN	jun-22	13,000,000	19.80	(257,348,000)
2022053103571	BON	USDMXN	jun-22	10,969,512	19.79	(217,130,525)
2022053103575	BON	USDMXN	jun-22	14,000,000	19.80	(277,158,000)
2022053103577	BON	USDMXN	jun-22	13,000,000	19.80	(257,348,000)
2022053103463	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.81	10,971,970
2022040403091	B	USDMXN	may-22	2,000,000	19.85	(39,701,976)
2022040403395	BO	USDMXN	may-22	40,000	19.89	(795,669)
2022050303128	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.42	(11,315,099)
2022050303422	B	USDMXN	jun-22	121,500	20.41	(2,479,323)
2022050403404	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.20	(1,211,742)
2022050503378	B	USDMXN	jun-22	500,000	20.37	(10,184,343)
2022051603209	BO	USDMXN	jun-22	589,504	20.19	(11,899,441)
2022051703192	BO	USDMXN	jun-22	34,000	20.10	(683,363)
2022051703528	S	USDMXN	jun-22	(15,745,439)	20.07	316,073,391
2022051703537	S	USDMXN	jun-22	(8,379,328)	20.07	168,188,615
2022052303404	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.93	(1,992,743)
2022052303543	BO	USDMXN	jun-22	75,000	20.00	(1,499,897)
2022060103129	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.84	(19,844,906)
2022040403086	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.85	39,704,000
2022040403113	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.85	39,704,000
2022040403121	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.85	39,704,000
2022040403457	SO	USDMXN	may-22	(40,000)	19.94	797,480
2022050303145	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.45	11,331,516
2022050303353	SO	USDMXN	jun-22	(121,500)	20.42	2,481,455
2022050403326	SO	USDMXN	jun-22	(60,000)	20.35	1,220,940
2022050503043	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.18	10,087,500
2022051603190	SON	USDMXN	jun-22	(589,504)	20.24	11,933,143
2022051703511	BO	USDMXN	jun-22	12,124,767	20.07	(243,319,822)
2022051703519	BO	USDMXN	jun-22	12,000,000	20.06	(240,744,000)
2022051703579	BON	USDMXN	jun-22	12,124,767	20.07	(243,319,822)
2022051703584	BON	USDMXN	jun-22	12,000,000	20.06	(240,744,000)
2022051703187	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.11	683,876
2022052303284	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.09	2,008,990
2022052303546	SO	USDMXN	jun-22	(75,000)	20.20	1,514,850
2022052703577	SO	EURMXN	jun-22	(250,000)	21.15	5,287,500
2022060103053	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.76	19,760,500
2022040103292	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.93	13,637,699
2022040403057	BO	USDMXN	may-22	683,000	19.85	(13,557,321)
2022040403075	BO	USDMXN	may-22	900	19.84	(17,859)
2022040403267	B	USDMXN	may-22	683,900	19.83	(13,560,639)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041903232	BO	USDMXN	may-22	50,000	20.16	(1,008,061)
2022042603537	S	USDMXN	may-22	(400,000)	20.50	8,199,901
2022042903346	BO	USDMXN	may-22	350,000	20.50	(7,176,711)
2022050303448	SO	USDMXN	may-22	(4,993)	20.39	101,793
2022050403192	BO	USDMXN	jun-22	20,000	20.34	(406,763)
2022050403401	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.20	(11,188,746)
2022050403474	BO	USDMXN	jun-22	1,178,986	20.17	(23,778,826)
2022050403506	BO	USDMXN	jun-22	21	20.12	(422)
2022050603375	BO	USDMXN	jun-22	500,000	20.21	(10,102,638)
2022051703201	BO	USDMXN	jun-22	589,504	20.09	(11,844,044)
2022051803465	BO	USDMXN	jun-22	59,200	20.15	(1,193,101)
2022051903151	BO	USDMXN	jun-22	12,500	20.03	(250,386)
2022052503382	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.92	(1,992,104)
2022040403073	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.86	14,264,444
2022040403089	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	19.86	13,580,544
2022040403203	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	19.84	13,568,576
2022041903273	SO	USDMXN	may-22	(50,000)	20.20	1,010,150
2022042603445	BO	USDMXN	may-22	400,000	20.32	(8,126,400)
2022042903325	SO	USDMXN	may-22	(350,000)	20.54	7,190,050
2022050303374	BO	USDMXN	may-22	12,904,993	20.40	(263,223,141)
2022050303463	BON	USDMXN	may-22	12,904,993	20.40	(263,223,141)
2022050403156	SO	USDMXN	jun-22	(20,000)	20.41	408,270
2022050403217	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.34	11,270,022
2022050403242	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.34	11,270,022
2022050403489	SO	USDMXN	jun-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050403575	SON	USDMXN	jun-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050603376	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.28	10,140,750
2022051703185	SON	USDMXN	jun-22	(589,504)	20.15	11,877,258
2022051803280	SO	USDMXN	jun-22	(59,200)	20.11	1,190,364
2022051903123	SO	USDMXN	jun-22	(12,500)	20.05	250,633
2022052503385	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.93	1,992,960
2022040103289	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.93	13,635,182
2022041803544	BO	USDMXN	may-22	20,000	19.98	(399,653)
2022041903488	BO	EURMXN	may-22	132,430	21.76	(2,881,756)
2022042903471	BO	USDMXN	may-22	77,600	20.46	(1,587,533)
2022050403093	BO	USDMXN	may-22	13,000	20.30	(263,954)
2022050503375	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.36	(11,278,672)
2022051203380	B	USDMXN	jun-22	102,000	20.42	(2,082,492)
2022051203426	BO	USDMXN	jun-22	34,000	20.37	(692,716)
2022051303651	BO	USDMXN	jun-22	18,400	20.21	(371,893)
2022051703170	BO	USDMXN	jun-22	66,000	20.06	(1,324,221)
2022051903368	BO	USDMXN	jun-22	35,600	20.00	(712,047)
2022051903567	BO	USDMXN	jun-22	96,800	20.02	(1,938,157)
2022060203283	B	USDMXN	jun-22	99,600	19.65	(1,957,026)
2022060203357	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.64	(1,963,566)
2022041803532	SO	USDMXN	may-22	(20,000)	20.06	401,100
2022041903427	SO	EURMXN	may-22	(132,430)	21.79	2,884,993
2022041903461	SON	EURMXN	may-22	(132,430)	21.79	2,884,993
2022042903458	SO	USDMXN	may-22	(38,800)	20.46	793,945
2022042903459	SO	USDMXN	may-22	(38,800)	20.46	793,945
2022050403036	SO	USDMXN	may-22	(13,000)	20.34	264,408
2022050503335	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.35	11,275,285
2022050503383	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.35	11,275,285
2022051203353	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.37	692,563
2022051203354	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.37	692,563
2022051203355	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.37	692,563
2022051203424	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.39	693,345
2022051303641	SO	USDMXN	jun-22	(18,400)	20.26	372,841
2022051703109	SO	USDMXN	jun-22	(66,000)	20.24	1,336,005

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022051903364	SO	USDMXN	jun-22	(35,600)	20.03	712,890
2022051903468	SO	USDMXN	jun-22	(96,800)	20.00	1,935,855
2022060203262	SO	USDMXN	jun-22	(99,600)	19.65	1,957,140
2022060203323	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.74	1,973,800
2022040103286	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.93	13,632,937
2022040603326	BO	USDMXN	may-22	683,900	20.20	(13,813,307)
2022040603339	B	USDMXN	may-22	683,900	20.21	(13,822,613)
2022041303225	BO	USDMXN	may-22	66,000	19.85	(1,310,231)
2022050303417	B	USDMXN	may-22	25,000	20.39	(509,644)
2022050603485	BO	USDMXN	jun-22	554,000	20.18	(11,179,965)
2022051303403	BO	USDMXN	jun-22	34,000	20.18	(686,258)
2022051303608	BO	USDMXN	jun-22	33,600	20.20	(678,834)
2022052703704	B	USDMXN	jun-22	4,973,739	19.68	(97,884,692)
2022060303440	B	USDMXN	jun-22	139,397	19.65	(2,738,950)
2022060303442	BO	USDMXN	jun-22	164,962	19.65	(3,241,249)
2022040603239	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.21	13,818,541
2022040603329	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.22	13,827,774
2022041303224	SO	USDMXN	may-22	(66,000)	20.06	1,324,158
2022050303383	SO	USDMXN	may-22	(25,000)	20.46	511,513
2022050603337	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.19	11,184,983
2022051303367	SO	USDMXN	jun-22	(34,000)	20.22	687,310
2022051303468	SO	USDMXN	jun-22	(33,600)	20.21	678,955
2022052703619	SO	USDMXN	jun-22	(4,973,739)	19.69	97,942,866
2022060303317	SO	USDMXN	jun-22	(170,169)	19.66	3,344,840
2022060303363	SON	USDMXN	jun-22	(170,169)	19.66	3,344,840
2022060303395	SO	USDMXN	jun-22	(134,190)	19.68	2,640,363
2022040103282	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.92	13,630,161
2022040703261	B	USDMXN	may-22	683,900	20.20	(13,817,165)
2022040703324	BO	USDMXN	may-22	683,000	20.22	(13,812,029)
2022040703325	BO	USDMXN	may-22	900	20.19	(18,174)
2022042603265	BO	USDMXN	may-22	19,468	20.47	(398,478)
2022050903271	B	USDMXN	jun-22	1,108,000	20.44	(22,645,920)
2022050903316	BO	USDMXN	jun-22	83,000	20.40	(1,693,285)
2022050903317	BO	USDMXN	jun-22	432	20.43	(8,827)
2022051703193	BO	USDMXN	jun-22	17,122	20.07	(343,717)
2022052303471	BO	USDMXN	jun-22	750,000	19.98	(14,981,838)
2022053003143	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.56	(2,445,427)
2022053003514	BO	USDMXN	jun-22	7,821,290	19.62	(153,457,025)
2022060703332	BO	EURMXN	jun-22	107,337	21.04	(2,258,500)
2022060603353	BO	USDMXN	jun-22	67,095	19.68	(1,320,641)
2022060603412	BO	USDMXN	jun-22	40,400	19.66	(794,122)
2022060703334	BO	USDMXN	jun-22	1,283,029	19.65	(25,212,154)
2022060703360	S	USDMXN	jun-22	(2,566,058)	19.65	50,418,339
2022040703116	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.23	13,836,665
2022040703195	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.24	13,841,452
2022042603272	SO	USDMXN	may-22	(19,469)	20.48	398,624
2022050903192	SO	USDMXN	jun-22	(41,716)	20.42	851,632
2022050903193	SO	USDMXN	jun-22	(41,716)	20.42	851,632
2022050903251	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.41	11,305,478
2022050903252	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.39	11,298,553
2022051703197	SO	USDMXN	jun-22	(17,122)	20.08	343,776
2022052303475	SO	USDMXN	jun-22	(750,000)	19.99	14,992,125
2022053003085	SO	USDMXN	jun-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003116	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.84	198,401
2022053003539	SO	USDMXN	jun-22	(7,821,290)	19.63	153,516,272
2022060703328	SO	EURMXN	jun-22	(107,337)	21.05	2,259,019
2022060703394	SON	EURMXN	jun-22	(107,337)	21.05	2,259,019
2022060603091	SO	USDMXN	jun-22	(67,095)	19.62	1,316,337
2022060603420	SO	USDMXN	jun-22	(40,400)	19.67	794,668

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022060703333	BO	USDMXN	jun-22	1,283,029	19.65	(25,214,090)
2022060703400	BON	USDMXN	jun-22	1,283,029	19.65	(25,214,090)
2022040103279	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.92	13,627,667
2022040403394	BO	USDMXN	abr-22	24,000	19.87	(476,815)
2022040803489	BO	USDMXN	may-22	683,900	20.21	(13,820,815)
2022041203312	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.90	(19,903,775)
2022042203392	BO	USDMXN	may-22	66,000	20.42	(1,347,512)
2022050303119	BO	USDMXN	may-22	102,000	20.41	(2,082,080)
2022050303328	BO	USDMXN	may-22	400	20.39	(8,156)
2022050403168	BO	USDMXN	may-22	17,088	20.32	(347,180)
2022050403399	B	USDMXN	may-22	45,000	20.19	(908,530)
2022051003160	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.47	(11,342,360)
2022051003324	BO	USDMXN	jun-22	74,400	20.47	(1,523,154)
2022051003326	BO	USDMXN	jun-22	38,800	20.43	(792,706)
2022051003355	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.43	(11,320,624)
2022052403121	BO	USDMXN	jun-22	40,400	19.98	(807,271)
2022060703342	B	USDMXN	jun-22	40,400	19.64	(793,503)
2022040403458	SO	USDMXN	abr-22	(24,000)	19.91	477,900
2022040803024	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	20.22	13,826,748
2022041203254	SO	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.91	19,912,000
2022042203150	SO	USDMXN	may-22	(66,000)	20.62	1,361,052
2022050303133	SO	USDMXN	may-22	(24,000)	20.42	490,128
2022050303134	SO	USDMXN	may-22	(39,200)	20.42	800,542
2022050303135	SO	USDMXN	may-22	(39,200)	20.42	800,542
2022050403170	SO	USDMXN	may-22	(17,088)	20.32	347,245
2022050403327	SO	USDMXN	may-22	(45,000)	20.32	914,490
2022051003047	SO	USDMXN	jun-22	(38,800)	20.37	790,434
2022051003146	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.39	11,294,232
2022051003185	SO	USDMXN	jun-22	(37,200)	20.49	762,116
2022051003186	SO	USDMXN	jun-22	(37,200)	20.49	762,116
2022051003352	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.49	11,350,740
2022052403117	SO	USDMXN	jun-22	(40,400)	20.01	808,404
2022060703306	SO	USDMXN	jun-22	(40,400)	19.68	795,153
2022040103276	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.91	13,620,691
2022040403413	BO	USDMXN	abr-22	32,000	19.88	(636,137)
2022042203487	SO	USDMXN	may-22	(208,500)	20.31	4,234,516
2022042203527	SO	USDMXN	may-22	(58)	20.31	1,175
2022042703206	B	USDMXN	may-22	114,000	20.48	(2,335,203)
2022050403475	BO	USDMXN	may-22	1,179,007	20.14	(23,747,866)
2022051003359	B	USDMXN	may-22	9,000,000	20.43	(183,843,648)
2022051103082	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.33	(11,261,674)
2022051103192	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.33	(11,263,320)
2022051103213	BO	USDMXN	jun-22	37,200	20.33	(756,118)
2022051903148	BO	USDMXN	jun-22	12,500	20.00	(250,034)
2022052303403	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.90	(1,989,662)
2022052603298	B	USDMXN	jun-22	1,139,449	19.86	(22,629,701)
2022052703516	BO	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.67	(19,674,186)
2022052703687	B	USDMXN	jun-22	28,000,000	19.66	(550,550,000)
2022052703695	B	USDMXN	jun-22	11,393	19.66	(223,975)
2022060103406	BO	USDMXN	jun-22	20,450	19.77	(404,350)
2022060203355	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.61	(1,961,471)
2022040403441	SO	USDMXN	abr-22	(32,000)	20.04	641,248
2022042203488	BO	USDMXN	may-22	208,558	20.31	(4,235,226)
2022042203550	BON	USDMXN	may-22	208,558	20.31	(4,235,226)
2022042703188	SO	USDMXN	may-22	(38,000)	20.54	780,558
2022042703189	SO	USDMXN	may-22	(38,000)	20.54	780,558
2022042703190	SO	USDMXN	may-22	(38,000)	20.54	780,558
2022050403490	SO	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050403576	SON	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022051003349	SO	USDMXN	may-22	(9,000,000)	20.43	183,883,500
2022051003375	SON	USDMXN	may-22	(9,000,000)	20.43	183,883,500
2022051103076	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.35	11,273,069
2022051103181	SO	USDMXN	jun-22	(37,200)	20.33	756,425
2022051103189	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.34	11,270,299
2022051803201	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.35	11,273,069
2022051803203	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.34	11,270,299
2022051903124	SO	USDMXN	jun-22	(12,500)	20.05	250,633
2022052303285	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.09	2,008,990
2022052603224	SON	USDMXN	jun-22	(1,139,449)	19.86	22,630,597
2022052603232	SON	USDMXN	jun-22	(1,139,449)	19.86	22,630,597
2022052703414	SO	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.68	19,683,000
2022052703620	SO	USDMXN	jun-22	(28,011,393)	19.67	551,012,103
2022060103418	SO	USDMXN	jun-22	(20,450)	19.83	405,442
2022060203324	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.72	1,971,600
2022040103273	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.90	13,618,223
2022041803543	BO	USDMXN	may-22	30,000	19.96	(598,720)
2022042503409	SO	USDMXN	may-22	(289,000)	20.26	5,855,265
2022042803474	BO	USDMXN	may-22	48,000	20.56	(986,836)
2022051203271	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.37	(11,284,062)
2022051303650	BO	USDMXN	jun-22	9,200	20.18	(185,694)
2022051603372	BO	USDMXN	jun-22	100,000	20.11	(2,010,617)
2022060103385	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.76	(1,975,582)
2022060203266	B	USDMXN	jun-22	400,000	19.62	(7,846,482)
2022060203280	B	USDMXN	jun-22	41,600	19.63	(816,554)
2022060203351	BO	USDMXN	jun-22	41,600	19.62	(816,317)
2022060203481	BO	USDMXN	jun-22	74,400	19.61	(1,458,741)
2022061003476	S	USDMXN	jun-22	(125,000)	20.04	2,505,127
2022041803533	SO	USDMXN	may-22	(30,000)	20.03	600,900
2022042503426	BO	USDMXN	may-22	158,000	20.11	(3,176,827)
2022042503427	BO	USDMXN	may-22	131,000	20.11	(2,633,952)
2022042803475	SO	USDMXN	may-22	(48,000)	20.57	987,216
2022051203205	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.38	11,287,750
2022051803206	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.38	11,287,750
2022051303642	SO	USDMXN	jun-22	(9,200)	20.26	186,421
2022051603390	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.19	2,018,710
2022060103359	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.81	1,981,000
2022060203112	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.67	1,966,830
2022060203113	SO	USDMXN	jun-22	(200,000)	19.67	3,933,660
2022060203114	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.67	1,966,830
2022060203140	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.67	1,966,830
2022060203142	SO	USDMXN	jun-22	(200,000)	19.67	3,933,660
2022060203144	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.67	1,966,830
2022060203263	SO	USDMXN	jun-22	(41,600)	19.62	816,358
2022060203309	SO	USDMXN	jun-22	(41,600)	19.65	817,274
2022060203477	SO	USDMXN	jun-22	(24,800)	19.62	486,626
2022060203478	SO	USDMXN	jun-22	(24,800)	19.62	486,626
2022060203479	SO	USDMXN	jun-22	(24,800)	19.62	486,626
2022061003442	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.84	(2,479,750)
2022040103271	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.90	13,616,399
2022040803467	B	USDMXN	abr-22	153,630	20.09	(3,086,694)
2022041203315	B	USDMXN	abr-22	500,000	19.88	(9,938,718)
2022041303219	B	USDMXN	may-22	683,900	19.87	(13,587,158)
2022042503407	SO	USDMXN	may-22	(245,000)	20.26	4,962,939
2022042703205	S	USDMXN	may-22	(114,000)	20.48	2,334,264
2022042703211	S	USDMXN	may-22	(400,000)	20.47	8,188,054
2022042703213	SO	USDMXN	may-22	(11,000)	20.47	225,138
2022050303412	B	USDMXN	may-22	25,000	20.36	(508,932)
2022050403092	BO	USDMXN	may-22	27,000	20.27	(547,385)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022050403196	B	USDMXN	may-22	66,000	20.29	(1,339,308)
2022050403483	BO	USDMXN	may-22	100,000	20.21	(2,021,463)
2022051303400	B	USDMXN	jun-22	1,108,000	20.15	(22,329,184)
2022051903412	B	USDMXN	jun-22	50,000	19.96	(997,762)
2022052303064	B	USDMXN	jun-22	1,500,000	19.86	(29,783,487)
2022052503130	BO	USDMXN	jun-22	500,000	19.92	(9,961,088)
2022053103529	SO	USDMXN	jun-22	(270,000)	19.75	5,331,179
2022061003272	B	USDMXN	jun-22	40,400	19.98	(807,043)
2022040803454	SO	USDMXN	abr-22	(153,630)	20.11	3,088,856
2022040803524	SON	USDMXN	abr-22	(153,630)	20.11	3,088,856
2022041203255	SO	USDMXN	abr-22	(500,000)	19.90	9,948,000
2022041303125	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	19.85	13,573,363
2022042503421	BO	USDMXN	may-22	126,000	20.10	(2,532,915)
2022042503422	BO	USDMXN	may-22	119,000	20.10	(2,392,198)
2022042703177	BO	USDMXN	may-22	117,000	20.34	(2,379,780)
2022042703178	BO	USDMXN	may-22	119,000	20.34	(2,420,460)
2022042703179	BO	USDMXN	may-22	158,000	20.34	(3,213,720)
2022042703180	BO	USDMXN	may-22	131,000	20.34	(2,664,540)
2022050303384	SO	USDMXN	may-22	(25,000)	20.43	510,825
2022050403037	SO	USDMXN	may-22	(27,000)	20.34	549,156
2022050403178	SO	USDMXN	may-22	(66,000)	20.48	1,351,548
2022050403458	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	20.33	2,032,850
2022051303282	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.21	11,198,833
2022051303364	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.20	11,191,631
2022051803210	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.21	11,198,833
2022051803212	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.20	11,191,631
2022051903408	SO	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.07	1,003,350
2022052303111	SO	USDMXN	jun-22	(1,500,000)	20.21	30,314,400
2022052303116	SO	USDMXN	jun-22	(1,500,000)	20.21	30,314,400
2022052503141	SO	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.94	9,968,500
2022053103541	BO	USDMXN	jun-22	270,000	19.72	(5,324,400)
2022061003061	SO	USDMXN	jun-22	(40,400)	19.92	804,930
2022040103269	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.90	13,613,170
2022041203283	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.89	5,967,187
2022042003414	S	USDMXN	may-22	(281,000)	20.09	5,644,076
2022051603086	B	USDMXN	jun-22	554,000	20.11	(11,142,133)
2022052003463	BO	USDMXN	jun-22	5,000,000	19.94	(99,690,845)
2022052003465	BO	USDMXN	jun-22	2,800,000	19.94	(55,826,613)
2022052703668	B	USDMXN	jun-22	38,367	19.65	(753,909)
2022053003142	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.54	(2,442,132)
2022053003314	B	USDMXN	jun-22	3,000,000	19.57	(58,711,518)
2022061003474	S	USDMXN	jun-22	(251,000)	20.04	5,029,946
2022061403322	B	USDMXN	jun-22	7,308,812	20.67	(151,045,727)
2022041203141	BO	USDMXN	abr-22	300,000	20.58	(6,174,900)
2022042003404	BO	USDMXN	may-22	146,000	19.92	(2,908,612)
2022042003405	BO	USDMXN	may-22	135,000	19.92	(2,689,470)
2022051603060	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.13	11,153,128
2022051803214	SON	USDMXN	jun-22	(554,000)	20.13	11,153,128
2022052003464	SO	USDMXN	jun-22	(7,800,000)	19.94	155,539,800
2022052003469	SO	USDMXN	jun-22	(7,800,000)	19.94	155,539,800
2022052703621	SO	USDMXN	jun-22	(38,367)	19.66	754,257
2022053003086	SO	USDMXN	jun-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003117	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.84	198,401
2022053003183	SO	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	19.86	59,580,600
2022061403278	SO	EURMXN	jun-22	(122,671)	21.57	2,646,139
2022061403382	SON	EURMXN	jun-22	(122,671)	21.57	2,646,139
2022061403393	SON	EURMXN	jun-22	(122,671)	21.57	2,646,139
2022061003443	BO	USDMXN	jun-22	105,000	19.83	(2,082,203)
2022061003444	BO	USDMXN	jun-22	146,000	19.83	(2,895,253)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022061403282	SO	USDMXN	jun-22	(7,308,812)	20.69	151,190,086
2022061403384	SON	USDMXN	jun-22	(7,308,812)	20.69	151,190,086
2022061403395	SON	USDMXN	jun-22	(7,308,812)	20.69	151,190,086
2022040103267	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.89	13,610,663
2022040403391	BO	USDMXN	abr-22	46,100	19.84	(914,737)
2022042003412	S	USDMXN	may-22	(121,000)	20.08	2,429,814
2022042503406	SO	USDMXN	may-22	(184,000)	20.25	3,725,920
2022042803456	SO	USDMXN	may-22	(748)	20.54	15,358
2022051703299	B	USDMXN	jun-22	101,600	20.02	(2,034,374)
2022052603525	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.82	1,982,032
2022053103542	B	USDMXN	jun-22	18,916,504	19.74	(373,481,402)
2022060603352	BO	USDMXN	jun-22	40,000	19.65	(786,150)
2022061003468	S	USDMXN	jun-22	(242,000)	20.04	4,848,626
2022061503248	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.70	10,352,064
2022061503386	SO	USDMXN	jun-22	(1,600,000)	20.68	33,080,011
2022061503490	SO	USDMXN	jun-22	(233,000)	20.47	4,769,495
2022040403459	SO	USDMXN	abr-22	(46,100)	19.89	916,837
2022041303342	SO	USDMXN	abr-22	(7,000,000)	19.86	138,985,000
2022041303416	SON	USDMXN	abr-22	(7,000,000)	19.86	138,985,000
2022042003401	BO	USDMXN	may-22	121,000	19.91	(2,409,352)
2022042503417	BO	USDMXN	may-22	158,000	20.09	(3,174,931)
2022042503418	BO	USDMXN	may-22	26,000	20.09	(522,457)
2022042803425	BO	USDMXN	may-22	4,380,748	20.55	(90,019,988)
2022042803481	BON	USDMXN	may-22	4,380,748	20.55	(90,019,988)
2022051703180	SO	USDMXN	jun-22	(101,600)	20.06	2,037,690
2022052603527	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.81	(1,981,000)
2022053103518	SO	USDMXN	jun-22	(9,916,504)	19.74	195,731,952
2022053103522	SO	USDMXN	jun-22	(9,000,000)	19.74	177,696,000
2022053103569	SON	USDMXN	jun-22	(9,916,504)	19.74	195,731,952
2022053103573	SON	USDMXN	jun-22	(9,000,000)	19.74	177,696,000
2022053103580	SON	USDMXN	jun-22	(9,916,504)	19.74	195,731,952
2022060603068	SO	USDMXN	jun-22	(40,000)	19.65	785,972
2022061003432	BO	USDMXN	jun-22	117,000	19.83	(2,319,759)
2022061003436	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.83	(2,478,375)
2022061503466	BO	USDMXN	jun-22	117,000	20.30	(2,375,568)
2022061503467	BO	USDMXN	jun-22	116,000	20.30	(2,355,264)
2022061503479	BO	USDMXN	jun-22	1,600,000	20.66	(33,060,000)
2022041803205	B	USDMXN	may-22	683,900	20.00	(13,675,498)
2022042503405	SO	USDMXN	may-22	(250,000)	20.24	5,061,092
2022042603407	S	USDMXN	may-22	(402,000)	20.44	8,217,654
2022050403473	BO	USDMXN	may-22	1,179,007	20.12	(23,716,834)
2022051703527	B	USDMXN	may-22	15,745,439	20.01	(315,123,658)
2022052303402	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.87	(1,986,974)
2022060103297	B	USDMXN	jun-22	188,600	19.75	(3,725,275)
2022060103389	BO	USDMXN	jun-22	1,000	19.74	(19,742)
2022060203256	B	USDMXN	jun-22	1,114,269	19.58	(21,822,343)
2022061003466	S	USDMXN	jun-22	(233,000)	20.02	4,664,803
2022041803121	SON	USDMXN	may-22	(683,900)	19.99	13,671,503
2022042503414	BO	USDMXN	may-22	191,000	20.09	(3,837,286)
2022042503415	BO	USDMXN	may-22	131,000	20.09	(2,631,856)
2022042503437	BO	USDMXN	may-22	119,000	20.09	(2,390,770)
2022042603286	BO	USDMXN	may-22	402,000	20.27	(8,146,932)
2022050403491	SO	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050403577	SON	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022051703510	SO	USDMXN	may-22	(8,245,439)	20.02	165,039,057
2022051703518	SO	USDMXN	may-22	(7,500,000)	20.01	150,073,500
2022051703575	SON	USDMXN	may-22	(8,245,439)	20.02	165,039,057
2022051703582	SON	USDMXN	may-22	(7,500,000)	20.01	150,073,500
2022052303286	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	20.09	2,008,990

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022060103166	SO	USDMXN	jun-22	(33,600)	19.81	665,472
2022060103169	SO	USDMXN	jun-22	(59,200)	19.81	1,172,497
2022060103171	SO	USDMXN	jun-22	(96,800)	19.81	1,917,192
2022060203287	SON	USDMXN	jun-22	(1,114,269)	19.61	21,845,801
2022061003429	BO	USDMXN	jun-22	121,000	19.82	(2,397,736)
2022061003430	BO	USDMXN	jun-22	112,000	19.82	(2,219,392)
2022042003409	S	USDMXN	may-22	(297,000)	20.07	5,960,122
2022050303402	BO	EURMXN	may-22	180,944	21.42	(3,875,124)
2022050303391	BO	USDMXN	may-22	1,000,000	20.34	(20,338,577)
2022050303393	BO	USDMXN	may-22	1,000,000	20.34	(20,338,477)
2022050303394	BO	USDMXN	may-22	2,000,000	20.34	(40,675,354)
2022050303404	B	USDMXN	may-22	6,000,000	20.35	(122,082,138)
2022050303409	B	USDMXN	may-22	177,690	20.35	(3,615,137)
2022050403472	BO	USDMXN	may-22	1,179,007	20.11	(23,712,402)
2022050603487	B	USDMXN	may-22	182,650	20.16	(3,682,530)
2022051303648	BO	USDMXN	may-22	18,400	20.16	(370,914)
2022051603373	BO	USDMXN	may-22	100,000	20.08	(2,007,803)
2022051803445	B	USDMXN	may-22	2,500,000	20.08	(50,202,455)
2022051803130	SO	USDMXN	may-22	(2,500,000)	20.02	50,045,000
2022051803132	SO	USDMXN	may-22	(2,500,000)	20.02	50,045,000
2022061003464	S	USDMXN	jun-22	(233,000)	20.01	4,662,892
2022061403466	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.68	10,340,490
2022042003397	BO	USDMXN	may-22	159,000	19.91	(3,166,008)
2022042003398	BO	USDMXN	may-22	32,000	19.91	(637,184)
2022042003399	BO	USDMXN	may-22	106,000	19.91	(2,110,672)
2022050303371	SO	EURMXN	may-22	(180,944)	21.42	3,875,830
2022050303457	SON	EURMXN	may-22	(180,944)	21.42	3,875,830
2022050303373	SO	USDMXN	may-22	(13,077,690)	20.34	266,039,454
2022050303380	SO	USDMXN	may-22	(10,000,000)	20.34	203,390,000
2022050303459	SON	USDMXN	may-22	(13,077,690)	20.34	266,039,454
2022050303467	SON	USDMXN	may-22	(10,000,000)	20.34	203,390,000
2022050403492	SO	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050403578	SON	USDMXN	may-22	(1,179,007)	20.17	23,780,100
2022050603469	SO	USDMXN	may-22	(36,858)	20.18	743,750
2022050603470	SO	USDMXN	may-22	(37,295)	20.18	752,568
2022050603471	SO	USDMXN	may-22	(36,421)	20.18	734,932
2022050603472	SO	USDMXN	may-22	(36,653)	20.18	739,614
2022050603473	SO	USDMXN	may-22	(35,423)	20.18	714,794
2022051303643	SO	USDMXN	may-22	(18,400)	20.26	372,841
2022051603391	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	20.15	2,014,800
2022061003422	BO	USDMXN	jun-22	116,000	19.81	(2,298,250)
2022061003423	BO	USDMXN	jun-22	117,000	19.81	(2,318,063)
2022061703206	S	USDMXN	jun-22	(27,000,000)	20.48	552,960,000
2022040103541	B	USDMXN	abr-22	1,054,739	19.90	(20,990,921)
2022040103596	B	USDMXN	abr-22	172,000	19.89	(3,421,915)
2022040103264	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.88	13,600,117
2022040803551	BO	USDMXN	abr-22	18,750	20.07	(376,386)
2022042003407	S	USDMXN	may-22	(387,000)	20.06	7,762,825
2022042903587	B	USDMXN	may-22	201,928	20.43	(4,124,825)
2022050403091	BO	USDMXN	may-22	37,000	20.25	(749,130)
2022052003490	BO	USDMXN	jun-22	182,570	19.92	(3,636,766)
2022052703665	B	USDMXN	jun-22	340,097	19.63	(6,674,427)
2022060303001	B	USDMXN	jun-22	20,000,000	19.57	(391,496,900)
2022060303426	B	USDMXN	jun-22	173,913	19.60	(3,408,825)
2022060303287	S	USDMXN	jun-22	(32,200,000)	19.59	630,878,500
2022061003536	BO	USDMXN	jun-22	230,000	20.01	(4,602,187)
2022061003555	BO	USDMXN	jun-22	1,711	19.98	(34,189)
2022061303412	S	USDMXN	jun-22	(350,000)	20.48	7,168,593
2022061303582	S	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.54	1,027,172

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022061403360	S	USDMXN	jun-22	(200,000)	20.66	4,131,992
2022061703491	SO	USDMXN	jun-22	(6,979,000)	20.38	142,240,555
2022040103504	BO	USDMXN	abr-22	146,200	21.41	(3,130,142)
2022040103502	SO	USDMXN	abr-22	(318,200)	21.41	6,812,662
2022040103644	SO	USDMXN	abr-22	(22,077)	20.59	454,654
2022040103658	SO	USDMXN	abr-22	(125,325)	20.59	2,580,943
2022040103659	SO	USDMXN	abr-22	(929,414)	20.59	19,140,352
2022040103660	SO	USDMXN	abr-22	(170,789)	20.59	3,517,229
2022040103661	SO	USDMXN	abr-22	(736,548)	20.59	15,168,470
2022040803564	SO	USDMXN	abr-22	(18,750)	20.12	377,250
2022042003389	BO	USDMXN	may-22	120,000	19.91	(2,388,960)
2022042003390	BO	USDMXN	may-22	135,000	19.91	(2,687,580)
2022042003391	BO	USDMXN	may-22	132,000	19.91	(2,627,856)
2022042903551	SO	USDMXN	may-22	(33,403)	20.41	681,588
2022042903552	SO	USDMXN	may-22	(33,825)	20.41	690,199
2022042903553	SO	USDMXN	may-22	(32,839)	20.41	670,080
2022042903554	SO	USDMXN	may-22	(34,089)	20.41	695,586
2022042903555	SO	USDMXN	may-22	(33,969)	20.41	693,137
2022042903556	SO	USDMXN	may-22	(33,803)	20.41	689,750
2022050403038	SO	USDMXN	may-22	(37,000)	20.34	752,547
2022052003479	SO	USDMXN	jun-22	(30,744)	19.93	612,789
2022052003480	SO	USDMXN	jun-22	(30,153)	19.93	601,010
2022052003481	SO	USDMXN	jun-22	(30,478)	19.93	607,488
2022052003482	SO	USDMXN	jun-22	(30,497)	19.93	607,866
2022052003483	SO	USDMXN	jun-22	(29,887)	19.93	595,708
2022052003484	SO	USDMXN	jun-22	(30,811)	19.93	614,125
2022052703534	SO	USDMXN	jun-22	(37,635)	19.64	739,189
2022052703535	SO	USDMXN	jun-22	(36,583)	19.64	718,527
2022052703536	SO	USDMXN	jun-22	(36,836)	19.64	723,496
2022052703537	SO	USDMXN	jun-22	(36,758)	19.64	721,964
2022052703538	SO	USDMXN	jun-22	(35,000)	19.64	687,435
2022052703539	SO	USDMXN	jun-22	(35,285)	19.64	693,033
2022052703540	SO	USDMXN	jun-22	(122,000)	19.64	2,396,202
2022060303350	SO	USDMXN	jun-22	(36,857)	19.61	722,674
2022060303351	SO	USDMXN	jun-22	(37,056)	19.61	726,576
2022061003537	SO	USDMXN	jun-22	(37,278)	20.02	746,380
2022061003538	SO	USDMXN	jun-22	(37,798)	20.02	756,792
2022061003539	SO	USDMXN	jun-22	(38,306)	20.02	766,963
2022061003540	SO	USDMXN	jun-22	(39,462)	20.02	790,108
2022061003541	SO	USDMXN	jun-22	(39,218)	20.02	785,223
2022061003542	SO	USDMXN	jun-22	(39,649)	20.02	793,852
2022061303394	BO	USDMXN	jun-22	350,000	20.00	(6,998,950)
2022061303467	BO	USDMXN	jun-22	250,000	22.62	(5,653,750)
2022061303474	SO	USDMXN	jun-22	(200,000)	22.62	4,523,000
2022061403198	BO	USDMXN	jun-22	200,000	20.66	(4,131,400)
2022061703490	BO	USDMXN	jun-22	6,979,144	20.37	(142,179,122)
2022061703520	BON	USDMXN	jun-22	6,979,144	20.37	(142,179,122)
2022040103262	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.87	13,596,771
2022041203281	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.87	5,960,670
2022041303569	BO	USDMXN	abr-22	50,000	19.78	(989,072)
2022041903435	BO	USDMXN	abr-22	3,280,000	20.10	(65,925,957)
2022041903447	B	USDMXN	abr-22	9,442	20.10	(189,757)
2022041903489	BO	USDMXN	abr-22	916	20.09	(18,404)
2022050203263	BO	USDMXN	may-22	18,600	20.48	(380,983)
2022050603290	B	EURMXN	may-22	1,000,000	21.28	(21,282,444)
2022051103252	SO	USDMXN	may-22	(150,000)	20.30	3,044,398
2022051103308	SO	USDMXN	may-22	(80,000)	20.32	1,625,768
2022051303628	B	EURMXN	may-22	1,000,000	20.95	(20,949,056)
2022051603091	BO	USDMXN	may-22	146,960	20.08	(2,950,940)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052303537	BO	USDMXN	jun-22	33,150	19.92	(660,453)
2022053003141	BO	USDMXN	jun-22	125,000	19.51	(2,438,838)
2022060103366	B	USDMXN	jun-22	33,000	19.70	(649,996)
2022060103369	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.71	(1,970,952)
2022060103364	S	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.70	1,970,449
2022060603411	BO	USDMXN	jun-22	78,705	19.60	(1,542,983)
2022061003460	S	USDMXN	jun-22	(640,000)	20.01	12,805,921
2022061303384	S	USDMXN	jun-22	(800,000)	20.41	16,331,694
2022062003212	SO	USDMXN	jun-22	(144)	20.29	2,924
2022041203136	BO	USDMXN	abr-22	300,000	20.56	(6,166,800)
2022041303640	SO	USDMXN	abr-22	(50,000)	19.85	992,600
2022041903429	SO	USDMXN	abr-22	(11,990,358)	20.11	241,111,707
2022041903463	SON	USDMXN	abr-22	(11,990,358)	20.11	241,111,707
2022050203291	SO	USDMXN	may-22	(18,600)	20.54	381,951
2022050603288	S	EURMXN	may-22	(1,000,000)	21.28	21,282,600
2022050603301	S	EURMXN	may-22	(1,000,000)	21.28	21,282,600
2022051103261	BO	USDMXN	may-22	150,000	20.28	(3,042,450)
2022051103312	BO	USDMXN	may-22	80,000	20.30	(1,624,000)
2022051303631	S	EURMXN	may-22	(1,000,000)	20.96	20,959,000
2022051603087	SO	USDMXN	may-22	(35,017)	20.10	703,754
2022051603088	SO	USDMXN	may-22	(36,243)	20.10	728,394
2022051603089	SO	USDMXN	may-22	(38,373)	20.10	771,201
2022051603090	SO	USDMXN	may-22	(37,327)	20.10	750,179
2022051903490	BON	USDMXN	may-22	5,664,316	19.91	(112,793,516)
2022052303535	SO	USDMXN	jun-22	(33,150)	19.93	660,762
2022053003087	SO	USDMXN	jun-22	(115,000)	19.84	2,281,612
2022053003118	SO	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.84	198,401
2022060103309	BO	USDMXN	jun-22	100,000	19.73	(1,973,000)
2022060103360	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.77	1,976,950
2022060603421	SO	USDMXN	jun-22	(38,305)	19.62	751,429
2022060603422	SO	USDMXN	jun-22	(40,400)	19.62	792,527
2022061003403	BO	USDMXN	jun-22	128,000	19.81	(2,535,040)
2022061003404	BO	USDMXN	jun-22	107,000	19.81	(2,119,135)
2022061003405	BO	USDMXN	jun-22	117,000	19.81	(2,317,185)
2022061003406	BO	USDMXN	jun-22	137,000	19.81	(2,713,285)
2022061003407	BO	USDMXN	jun-22	151,000	19.81	(2,990,555)
2022061303299	BO	USDMXN	jun-22	800,000	20.51	(16,406,080)
2022040103260	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.87	13,596,071
2022041903376	BO	USDMXN	abr-22	17,900	20.08	(359,516)
2022050503372	B	USDMXN	may-22	3,996,356	20.28	(81,054,558)
2022051903137	B	USDMXN	may-22	5,000,000	19.98	(99,897,907)
2022051903509	S	USDMXN	may-22	(5,664,316)	19.94	112,962,583
2022052503397	BO	USDMXN	jun-22	10,286	19.85	(204,202)
2022061503238	S	USDMXN	jun-22	(400,000)	20.69	8,275,744
2022062203487	S	USDMXN	jun-22	(26,500,000)	20.03	530,718,124
2022040503508	SO	USDMXN	abr-22	(12,327,657)	20.00	246,540,813
2022040503510	SO	USDMXN	abr-22	(13,000,000)	20.00	259,974,000
2022040503528	SON	USDMXN	abr-22	(12,327,657)	20.00	246,540,813
2022040503532	SON	USDMXN	abr-22	(13,000,000)	20.00	259,974,000
2022041903389	SO	USDMXN	abr-22	(17,900)	20.16	360,936
2022050503281	SO	USDMXN	may-22	(3,996,356)	20.29	81,082,073
2022050503332	SON	USDMXN	may-22	(3,996,356)	20.29	81,082,073
2022052503401	SO	USDMXN	jun-22	(10,826)	19.85	214,929
2022052503409	SO	USDMXN	jun-22	(10,286)	19.85	204,208
2022060703481	SO	USDMXN	jun-22	(28,755)	19.60	563,713
2022061503191	BO	USDMXN	jun-22	400,000	20.41	(8,164,800)
2022062203466	BO	USDMXN	jun-22	14,000,000	20.04	(280,574,000)
2022062203470	BO	USDMXN	jun-22	12,500,000	20.04	(250,525,000)
2022062203534	BON	USDMXN	jun-22	14,000,000	20.04	(280,574,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022062203539	BON	USDMXN	jun-22	12,500,000	20.04	(250,525,000)
2022040103258	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.86	13,587,434
2022040603410	B	USDMXN	abr-22	47,781	20.18	(964,132)
2022042103440	BO	USDMXN	abr-22	19,350	20.18	(390,558)
2022042603399	S	USDMXN	may-22	(1,718,000)	20.42	35,075,827
2022042603403	S	USDMXN	may-22	(1,718,000)	20.42	35,075,827
2022051203083	BO	USDMXN	may-22	10,453	20.36	(212,790)
2022051703287	B	USDMXN	may-22	100,000	20.00	(1,999,826)
2022052403426	B	USDMXN	may-22	6,614,647	19.89	(131,593,210)
2022060103121	BO	USDMXN	jun-22	122,000	19.76	(2,411,235)
2022060103374	B	USDMXN	jun-22	33,000	19.70	(649,996)
2022060603351	BO	USDMXN	jun-22	30,000	19.62	(588,726)
2022060803004	BO	USDMXN	jun-22	28,755	19.64	(564,864)
2022061003399	S	USDMXN	jun-22	(383,000)	19.98	7,653,955
2022041203196	B	USDMXN	abr-22	1,130,769	19.84	(22,434,452)
2022041203242	B	USDMXN	abr-22	182,347	19.85	(3,619,584)
2022041203650	B	USDMXN	abr-22	1,130,831	19.83	(22,426,820)
2022041203652	B	USDMXN	abr-22	182,371	19.85	(3,620,058)
2022041203661	B	USDMXN	abr-22	46,385	19.83	(919,920)
2022041203240	S	USDMXN	abr-22	(10,000)	19.84	198,400
2022041203552	S	USDMXN	abr-22	(970,000)	19.82	19,228,795
2022041203648	S	USDMXN	abr-22	(980,322)	19.82	19,434,069
2022041303693	B	USDMXN	abr-22	24,739	19.77	(488,971)
2022041303239	S	USDMXN	abr-22	(161,000)	19.82	3,190,859
2022041303691	S	USDMXN	abr-22	(100,943)	19.77	1,995,139
2022052403275	S	DKKMXN	may-22	(770,000)	2.87	2,211,825
2022040603459	SO	USDMXN	abr-22	(47,781)	20.88	997,806
2022041103021	S	USDMXN	abr-22	(30,000,000)	20.06	601,722,000
2022041103023	S	USDMXN	abr-22	(20,000,000)	20.06	401,148,000
2022041203319	S	USDMXN	abr-22	(149,742)	19.87	2,975,376
2022041303574	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.78	5,934,000
2022041303581	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.78	5,934,000
2022042103457	SO	USDMXN	abr-22	(19,350)	20.26	392,108
2022042103460	SO	USDMXN	abr-22	(19,350)	20.26	392,108
2022042603256	BO	USDMXN	may-22	1,718,000	20.24	(34,772,320)
2022051203089	SO	USDMXN	may-22	(10,453)	20.36	212,823
2022051703267	SO	USDMXN	may-22	(100,000)	20.07	2,007,200
2022052403418	SO	USDMXN	may-22	(6,614,647)	19.89	131,532,250
2022052403467	SON	USDMXN	may-22	(6,614,647)	19.89	131,532,250
2022060103119	SO	USDMXN	jun-22	(122,000)	19.78	2,412,940
2022060103361	SO	USDMXN	jun-22	(33,000)	19.77	652,278
2022060603069	SO	USDMXN	jun-22	(30,000)	19.60	588,030
2022061003374	BO	USDMXN	jun-22	136,000	19.83	(2,696,472)
2022061003375	BO	USDMXN	jun-22	120,000	19.83	(2,379,240)
2022061003376	BO	USDMXN	jun-22	127,000	19.83	(2,518,029)
2022040103256	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.86	13,585,043
2022041203280	B	USDMXN	abr-22	300,000	19.86	(5,957,850)
2022041203282	B	USDMXN	abr-22	300,000	19.86	(5,957,097)
2022041203514	B	USDMXN	abr-22	37,293	19.84	(740,029)
2022041203516	S	MXNUSD	abr-22	(313,576)	19.84	15,803
2022041203518	B	USDMXN	abr-22	465,694	19.84	(9,240,024)
2022041203520	B	USDMXN	abr-22	298,672	19.84	(5,925,097)
2022041203522	B	USDMXN	abr-22	186,213	19.84	(3,694,569)
2022041203525	B	USDMXN	abr-22	464,659	19.84	(9,218,911)
2022041203527	B	USDMXN	abr-22	185,712	19.84	(3,684,908)
2022041203311	S	USDMXN	abr-22	(1,000,000)	19.85	19,846,500
2022041203314	S	USDMXN	abr-22	(500,000)	19.84	9,919,250
2022041203476	S	USDMXN	abr-22	(210,000)	19.83	4,163,739
2022041203479	S	USDMXN	abr-22	(210,000)	19.83	4,163,733

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041303218	S	USDMXN	abr-22	(683,900)	19.82	13,555,719
2022041303324	S	USDMXN	abr-22	(250,000)	19.81	4,952,050
2022041303326	S	USDMXN	abr-22	(250,000)	19.81	4,952,050
2022041303329	S	USDMXN	abr-22	(250,000)	19.81	4,952,550
2022041303331	S	USDMXN	abr-22	(250,000)	19.81	4,953,530
2022041303471	S	USDMXN	abr-22	(200,000)	19.76	3,951,128
2022041303473	S	USDMXN	abr-22	(200,000)	19.76	3,951,128
2022041303475	S	USDMXN	abr-22	(200,000)	19.76	3,951,128
2022053103594	SO	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	19.68	59,032,911
2022060803222	SO	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	19.59	97,972,570
2022041203005	B	USDMXN	abr-22	1,000,000	19.82	(19,820,800)
2022041203015	B	USDMXN	abr-22	1,600,000	19.87	(31,784,000)
2022041203018	B	USDMXN	abr-22	1,160,000	19.83	(23,005,120)
2022041203053	B	USDMXN	abr-22	1,000,000	19.86	(19,856,000)
2022041203318	B	USDMXN	abr-22	500,000	19.85	(9,922,700)
2022041203468	B	USDMXN	abr-22	5,110,208	19.85	(101,437,635)
2022041203506	B	USDMXN	abr-22	150,000	19.85	(2,977,169)
2022041203554	B	USDMXN	abr-22	5,056,278	19.85	(100,367,114)
2022041203603	B	USDMXN	abr-22	378,082	19.81	(7,489,396)
2022041203653	B	USDMXN	abr-22	46,385	19.83	(919,920)
2022041203655	B	USDMXN	abr-22	331,692	19.81	(6,570,444)
2022041203016	S	USDMXN	abr-22	(1,600,000)	19.87	31,784,000
2022041203087	S	USDMXN	abr-22	(320,000)	19.82	6,342,720
2022041203201	S	USDMXN	abr-22	(5,000,000)	19.84	99,217,500
2022041203469	S	USDMXN	abr-22	(5,110,208)	19.85	101,437,635
2022041203557	S	USDMXN	abr-22	(5,056,278)	19.85	100,367,114
2022041203604	S	USDMXN	abr-22	(522,117)	19.81	10,344,435
2022041203657	S	USDMXN	abr-22	(216,722)	19.81	4,292,175
2022041203658	S	USDMXN	abr-22	(117,989)	19.81	2,336,778
2022041203659	S	USDMXN	abr-22	(187,568)	19.82	3,718,380
2022041303011	B	USDMXN	abr-22	1,000,000	19.77	(19,765,000)
2022041303013	B	USDMXN	abr-22	1,000,000	19.77	(19,765,100)
2022041303470	B	USDMXN	abr-22	1,250,000	19.76	(24,697,500)
2022041303498	B	USDMXN	abr-22	350,000	19.77	(6,917,750)
2022041303631	B	USDMXN	abr-22	572,025	19.81	(11,331,809)
2022041303687	B	USDMXN	abr-22	260,179	19.81	(5,154,147)
2022041303688	B	USDMXN	abr-22	311,987	19.81	(6,180,468)
2022041303689	B	USDMXN	abr-22	24,739	19.77	(488,971)
2022041303012	S	USDMXN	abr-22	(1,000,000)	19.77	19,765,000
2022041303016	S	USDMXN	abr-22	(800,866)	19.81	15,867,182
2022041303148	S	USDMXN	abr-22	(80,000,000)	19.81	1,584,400,000
2022041303162	S	USDMXN	abr-22	(80,000,000)	19.81	1,584,400,000
2022041303462	S	USDMXN	abr-22	(2,000,000)	19.76	39,526,800
2022041303632	S	USDMXN	abr-22	(1,065,082)	19.82	21,106,830
2022041303681	S	USDMXN	abr-22	(620,984)	19.81	12,302,327
2022041303682	S	USDMXN	abr-22	(39,961)	19.81	791,676
2022041303683	S	USDMXN	abr-22	(60,256)	19.82	1,194,561
2022041303684	S	USDMXN	abr-22	(394,396)	19.82	7,818,775
2022041303685	S	USDMXN	abr-22	(7,901)	19.83	156,650
2022052503404	B	CHF MXN	may-22	486,000	20.61	(10,015,303)
2022052503402	B	NOK MXN	may-22	490,000	2.07	(1,013,712)
2022052603430	B	USDMXN	jun-22	3,500,000	19.80	(69,307,700)
2022053103224	B	USDMXN	jun-22	70,000	19.64	(1,374,590)
2022053103226	B	USDMXN	jun-22	7,000	19.64	(137,459)
2022053103231	B	USDMXN	jun-22	164,369	19.71	(3,239,713)
2022053103728	B	USDMXN	jun-22	171,595	19.69	(3,379,567)
2022053103730	B	USDMXN	jun-22	1,420	19.69	(27,966)
2022053103222	S	USDMXN	jun-22	(40,798)	19.72	804,326
2022053103717	S	USDMXN	jun-22	(39,610)	19.67	779,075

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022060103428	B	USDMXN	jun-22	189,000	19.76	(3,734,640)
2022060103606	B	USDMXN	jun-22	130,140	19.76	(2,571,566)
2022060103609	B	USDMXN	jun-22	58,863	19.76	(1,163,142)
2022060103088	S	USDMXN	jun-22	(775,246)	19.76	15,314,984
2022060103452	S	USDMXN	jun-22	(5,500)	19.70	108,323
2022060103563	S	USDMXN	jun-22	(60,093)	19.70	1,183,535
2022060103599	S	USDMXN	jun-22	(840,095)	19.75	16,592,143
2022040403319	S	USDMXN	abr-22	(253,239)	19.81	5,015,407
2022040703194	SO	USDMXN	abr-22	(159,206)	20.84	3,317,535
2022041303242	S	EURMXN	abr-22	(69,428)	21.53	1,494,794
2022041303243	S	EURMXN	abr-22	(34,359)	21.53	739,756
2022041203211	BON	USDMXN	abr-22	244,236	21.54	(5,260,111)
2022041203212	BON	USDMXN	abr-22	698,413	20.43	(14,267,181)
2022041203215	BON	USDMXN	abr-22	3,795,346	20.19	(76,631,831)
2022041203216	BO	USDMXN	abr-22	66,464	19.84	0
2022041203383	B	USDMXN	abr-22	4,200	19.45	(81,676)
2022041203391	BON	USDMXN	abr-22	3,795,346	20.19	(76,631,831)
2022041203586	B	USDMXN	abr-22	4,200	19.45	(81,676)
2022041203014	S	USDMXN	abr-22	(30,000,000)	19.85	595,429,500
2022041203107	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.82	495,425
2022041203108	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.82	495,398
2022041203116	S	USDMXN	abr-22	(5,100)	19.85	101,250
2022041203125	S	USDMXN	abr-22	(5,000)	19.86	99,295
2022041203126	S	USDMXN	abr-22	(20,000)	19.86	397,174
2022041203127	S	USDMXN	abr-22	(11,874)	19.86	235,767
2022041203128	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.86	496,388
2022041203153	S	USDMXN	abr-22	(37,298)	19.85	740,424
2022041203159	S	USDMXN	abr-22	(50,000)	19.86	992,865
2022041203172	S	USDMXN	abr-22	(30,000)	19.88	596,274
2022041203181	S	USDMXN	abr-22	(50,000)	19.88	994,155
2022041203182	S	USDMXN	abr-22	(35)	19.84	695
2022041203184	S	USDMXN	abr-22	(20,000)	19.88	397,686
2022041203190	S	USDMXN	abr-22	(35)	19.84	695
2022041203195	S	USDMXN	abr-22	(34,726)	19.88	690,356
2022041203197	S	USDMXN	abr-22	(20,000)	19.88	397,548
2022041203198	S	USDMXN	abr-22	(20,000)	19.88	397,540
2022041203199	S	USDMXN	abr-22	(10,000)	19.88	198,779
2022041203213	SO	USDMXN	abr-22	0	19.84	413,614
2022041203214	SO	USDMXN	abr-22	0	19.84	408,222
2022041203230	S	USDMXN	abr-22	(55,000)	19.88	1,093,400
2022041203231	S	USDMXN	abr-22	(70,751)	19.88	1,406,600
2022041203236	S	USDMXN	abr-22	(6,500,000)	19.89	129,303,200
2022041203253	S	USDMXN	abr-22	(3,000)	19.88	59,650
2022041203268	S	USDMXN	abr-22	(60,100)	19.89	1,195,395
2022041203293	S	USDMXN	abr-22	(30,045)	19.88	597,434
2022041203301	S	USDMXN	abr-22	(7,000)	19.88	139,136
2022041203320	S	USDMXN	abr-22	(5,663)	19.90	112,682
2022041203335	S	USDMXN	abr-22	(30,000)	19.89	596,724
2022041203360	S	USDMXN	abr-22	(420,000)	19.84	8,334,480
2022041203375	S	USDMXN	abr-22	(6,000)	19.89	119,333
2022041203392	SO	USDMXN	abr-22	0	19.84	1,318,883
2022041203393	S	USDMXN	abr-22	(630,000)	19.85	12,502,980
2022041203402	S	USDMXN	abr-22	(30,000)	19.88	596,274
2022041203405	S	USDMXN	abr-22	(30,000)	19.88	596,259
2022041203540	S	USDMXN	abr-22	(90,000)	19.87	1,788,174
2022041203561	S	USDMXN	abr-22	(200,000)	19.82	3,963,480
2022041203563	S	USDMXN	abr-22	(500,000)	19.82	9,908,700
2022041203565	S	USDMXN	abr-22	(500,000)	19.82	9,908,700
2022041203567	S	USDMXN	abr-22	(500,000)	19.82	9,908,700

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041203624	S	USDMXN	abr-22	(253,000)	19.82	5,013,524
2022041303017	B	USDMXN	abr-22	800,866	19.81	(15,865,580)
2022041303221	B	USDMXN	abr-22	800,866	19.81	(15,865,580)
2022041303283	B	USDMXN	abr-22	3,000	19.41	(58,226)
2022041303448	B	USDMXN	abr-22	317,500	19.76	(6,273,165)
2022041303000	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.78	494,578
2022041303001	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.78	494,578
2022041303087	S	USDMXN	abr-22	(683,900)	19.80	13,538,826
2022041303108	S	USDMXN	abr-22	(8,000)	19.82	158,590
2022041303117	S	USDMXN	abr-22	(5,010)	19.82	99,305
2022041303130	S	USDMXN	abr-22	(200,000)	19.80	3,960,000
2022041303133	S	USDMXN	abr-22	(6,600)	19.84	130,912
2022041303194	S	USDMXN	abr-22	(35)	19.79	693
2022041303197	S	USDMXN	abr-22	(35)	19.79	693
2022041303259	S	USDMXN	abr-22	(80,000,000)	19.81	1,584,400,000
2022041303290	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.85	496,295
2022041303398	S	USDMXN	abr-22	(19,501)	19.82	386,568
2022041303426	S	USDMXN	abr-22	(40,000)	19.77	790,872
2022041303434	S	USDMXN	abr-22	(3,475)	19.81	68,828
2022041303435	S	USDMXN	abr-22	(3,495)	19.81	69,227
2022041303437	S	USDMXN	abr-22	(9,021)	19.81	178,686
2022041303450	S	USDMXN	abr-22	(40,000)	19.78	791,032
2022041303464	S	USDMXN	abr-22	(10,000)	19.81	198,069
2022041303466	S	USDMXN	abr-22	(10,000)	19.81	198,073
2022041303493	S	USDMXN	abr-22	(5,100)	19.81	101,034
2022041303494	S	USDMXN	abr-22	(5,100)	19.81	101,034
2022041303496	S	USDMXN	abr-22	(2,000)	19.81	39,625
2022041303514	S	USDMXN	abr-22	(10,000)	19.82	198,169
2022042203096	S	USDMXN	abr-22	(17,820)	20.36	362,762
2022051303644	S	USDMXN	may-22	(9,200)	20.26	186,421
2022051703154	S	USDMXN	may-22	(200,000)	20.02	4,003,200
2022052303188	S	USDMXN	may-22	(288,444)	19.85	5,724,168
2022052503097	S	USDMXN	may-22	(19,404)	19.87	385,460
2022052703417	S	USDMXN	jun-22	(300,000)	19.63	5,888,400
2022052703418	S	USDMXN	jun-22	(300,000)	19.63	5,888,400
2022053003574	S	USDMXN	jun-22	(366,779)	19.58	7,181,528
2022060603360	BO	USDMXN	jun-22	100,000	21.03	(2,102,900)
2022060603285	S	USDMXN	jun-22	(63,797)	19.67	1,254,750
2022061003360	B	USDMXN	jun-22	182,000	19.84	(3,609,970)
2022061303522	SO	USDMXN	jun-22	(70,000)	20.46	1,432,200
2022061303573	S	USDMXN	jun-22	(70,000)	20.46	1,432,200
2022062103301	S	USDMXN	jun-22	(113,294)	20.30	2,299,634
2022040103253	S	USDMXN	abr-22	(684,211)	19.85	13,582,726
2022042603402	B	USDMXN	abr-22	1,718,000	20.40	(35,047,980)
2022042603406	B	USDMXN	abr-22	402,000	20.40	(8,199,857)
2022042603449	S	USDMXN	abr-22	(683,900)	20.40	13,948,414
2022052603126	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,946,900
2022052603128	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,946,925
2022052603130	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,947,325
2022052603132	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,947,100
2022052603136	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,946,775
2022052603138	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.78	4,945,400
2022052603141	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.78	4,945,950
2022052603143	S	USDMXN	may-22	(250,000)	19.79	4,946,775
2022052603297	S	USDMXN	may-22	(1,139,449)	19.80	22,559,199
2022052603334	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.79	39,585,780
2022052603444	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.78	19,778,210
2022052603529	S	USDMXN	may-22	(1,225,000)	19.78	24,227,144
2022052703628	B	USDMXN	jun-22	1,825,000	19.61	(35,795,076)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052703630	B	USDMXN	jun-22	1,825,000	19.61	(35,796,663)
2022052703450	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	19.62	39,237,440
2022052703453	S	USDMXN	jun-22	(750,000)	19.62	14,712,660
2022052703471	S	USDMXN	jun-22	(400,000)	19.62	7,848,228
2022052703475	S	USDMXN	jun-22	(400,000)	19.62	7,848,324
2022052703478	S	USDMXN	jun-22	(400,000)	19.62	7,848,280
2022052703480	S	USDMXN	jun-22	(250,000)	19.62	4,905,113
2022052703482	S	USDMXN	jun-22	(250,000)	19.62	4,905,188
2022052703487	S	USDMXN	jun-22	(250,000)	19.62	4,905,188
2022052703489	S	USDMXN	jun-22	(250,000)	19.62	4,905,188
2022052703624	S	USDMXN	jun-22	(1,825,000)	19.61	35,783,031
2022052703626	S	USDMXN	jun-22	(1,825,000)	19.61	35,783,031
2022052703632	S	USDMXN	jun-22	(200,000)	19.61	3,921,722
2022052703664	S	USDMXN	jun-22	(340,097)	19.60	6,664,813
2022052703667	S	USDMXN	jun-22	(38,367)	19.60	751,958
2022052703677	S	USDMXN	jun-22	(54,400)	19.60	1,066,327
2022052703686	S	USDMXN	jun-22	(28,000,000)	19.60	548,800,000
2022052703694	S	USDMXN	jun-22	(11,393)	19.60	223,267
2022052703703	S	USDMXN	jun-22	(4,973,739)	19.60	97,486,276
2022052703705	S	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.60	10,860,007
2022061603457	B	USDMXN	jun-22	20,000,000	20.38	(407,636,000)
2022061603355	B	MXNUSD	jun-22	499,500,000	20.36	(24,528,821)
2022061603384	S	USDMXN	jun-22	(555,500)	20.38	11,322,590
2022061603394	S	USDMXN	jun-22	(26,900)	20.40	548,687
2022061703361	S	USDMXN	jun-22	(555,500)	20.38	11,322,590
2022061703366	S	USDMXN	jun-22	(555,500)	20.38	11,322,590
2022041303170	B	USDMXN	abr-22	20,000,000	19.83	(396,628,000)
2022041303187	B	USDMXN	abr-22	1,187,970	19.81	(23,539,327)
2022041403001	B	USDMXN	abr-22	300,000	19.74	(5,922,600)
2022041403003	B	USDMXN	abr-22	300,000	19.74	(5,922,600)
2022041403002	S	USDMXN	abr-22	(100,000)	20.02	2,001,900
2022041403004	S	USDMXN	abr-22	(12,700,000)	19.83	251,815,600
2022042003141	B	EURMXN	abr-22	4,105,040	21.71	(89,120,418)
2022042003142	S	EURMXN	abr-22	(4,105,040)	21.71	89,120,418
2022042903596	B	GBPMXN	may-22	40,000	25.68	(1,027,236)
2022042703513	B	JPYMXN	may-22	4,250,000	0.16	(675,750)
2022042803498	B	USDMXN	may-22	487,377	20.57	(10,025,355)
2022042803687	B	USDMXN	may-22	136,063	20.54	(2,794,443)
2022042803692	B	USDMXN	may-22	51,164	20.57	(1,052,363)
2022042803694	B	USDMXN	may-22	194,385	20.62	(4,008,210)
2022042803696	B	USDMXN	may-22	320,089	20.57	(6,584,231)
2022042803521	S	USDMXN	may-22	(218,000)	20.62	4,495,160
2022042903565	B	USDMXN	may-22	111,145	20.37	(2,263,686)
2022042903582	B	USDMXN	may-22	11,000	20.37	(224,070)
2022042903667	B	USDMXN	may-22	122,965	20.31	(2,497,530)
2022042903671	B	USDMXN	may-22	1,226	20.41	(25,013)
2022050603552	B	USDMXN	may-22	3,500,000	20.16	(70,546,000)
2022051103490	B	USDMXN	may-22	1,305	20.28	(26,466)
2022052403561	B	USDMXN	may-22	513,577	19.88	(10,210,531)
2022052403564	B	USDMXN	may-22	1,753	19.88	(34,844)
2022052403571	B	USDMXN	may-22	3,511	19.88	(69,795)
2022052403274	S	SEKMXN	may-22	(1,000,000)	2.04	2,035,510
2022052603442	B	CHF MXN	may-22	117,000	20.62	(2,412,381)
2022052603468	B	EURMXN	may-22	485,000	21.20	(10,282,000)
2022052603003	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.80	(19,800,000)
2022052603014	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.78	(19,780,000)
2022052603043	B	USDMXN	may-22	105,000	19.78	(2,076,585)
2022052603073	B	USDMXN	may-22	3,000,000	19.77	(59,295,000)
2022052603074	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.77	(19,766,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052603099	B	USDMXN	may-22	400,000	19.77	(7,907,200)
2022052603125	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.77	(19,770,000)
2022052603134	B	USDMXN	may-22	1,000,000	19.77	(19,772,000)
2022052603385	B	USDMXN	may-22	20,000,000	19.80	(395,909,400)
2022052603393	B	USDMXN	may-22	105,000	19.79	(2,078,408)
2022052603542	B	USDMXN	may-22	2,891,341	19.78	(57,186,701)
2022052603646	B	USDMXN	may-22	1,025,829	19.79	(20,296,032)
2022052603647	B	USDMXN	may-22	333,335	19.80	(6,598,368)
2022052603648	B	USDMXN	may-22	1,532,611	19.77	(30,305,350)
2022052603000	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.81	19,809,800
2022052603001	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.81	19,812,870
2022052603015	S	USDMXN	may-22	(922,359)	19.77	18,238,782
2022052603056	S	USDMXN	may-22	(4,000,000)	19.78	79,100,000
2022052603088	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.79	19,794,010
2022052603221	S	USDMXN	may-22	(3,000,000)	19.80	59,400,000
2022052603289	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.80	39,604,000
2022052603344	S	USDMXN	may-22	(2,000,000)	19.80	39,590,000
2022052603434	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.78	19,775,820
2022052603507	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	19.78	19,780,000
2022052603543	S	USDMXN	may-22	(468,029)	19.78	9,255,267
2022052603546	S	USDMXN	may-22	(5,000,000)	19.78	98,896,000
2022052603642	S	USDMXN	may-22	(467,998)	19.78	9,254,657
2022052703741	B	EURMXN	jun-22	393,000	21.03	(8,264,318)
2022052703002	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.69	(1,968,700)
2022052703012	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.75	(1,974,500)
2022052703013	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.68	(1,967,700)
2022052703015	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.72	(1,971,700)
2022052703039	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.72	(1,972,000)
2022052703058	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.68	(19,677,000)
2022052703059	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.73	(19,727,000)
2022052703074	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.62	(19,620,000)
2022052703075	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.61	(19,610,000)
2022052703086	B	USDMXN	jun-22	500,000	19.60	(9,800,000)
2022052703087	B	USDMXN	jun-22	500,000	19.59	(9,795,955)
2022052703108	B	USDMXN	jun-22	100,000	19.59	(1,958,700)
2022052703145	B	USDMXN	jun-22	500,000	19.59	(9,793,500)
2022052703611	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.60	(19,602,600)
2022052703635	B	USDMXN	jun-22	20,000,000	19.61	(392,172,000)
2022052703652	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.60	(19,603,300)
2022052703656	B	USDMXN	jun-22	372,684	19.61	(7,307,774)
2022052703690	B	USDMXN	jun-22	500,000	19.60	(9,798,350)
2022052703713	B	USDMXN	jun-22	50,000	19.57	(978,641)
2022052703784	B	USDMXN	jun-22	190,824	19.60	(3,739,575)
2022052703786	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	19.60	(19,595,400)
2022052703912	B	USDMXN	jun-22	6,313	19.60	(123,746)
2022052703913	B	USDMXN	jun-22	11,701,839	19.60	(229,411,972)
2022052703914	B	USDMXN	jun-22	84,439	19.60	(1,655,417)
2022052703915	B	USDMXN	jun-22	13,291	19.60	(260,545)
2022052703925	B	USDMXN	jun-22	190,874	19.58	(3,737,925)
2022052703115	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	19.58	39,160,000
2022052703118	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	19.58	39,160,000
2022052703149	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,580,000
2022052703151	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,582,600
2022052703153	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,582,700
2022052703156	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,584,800
2022052703161	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.59	19,586,500
2022052703162	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.59	19,588,900
2022052703163	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.59	19,588,600
2022052703176	S	USDMXN	jun-22	(21,000,000)	19.59	411,304,530

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052703374	S	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	19.60	58,788,000
2022052703660	S	USDMXN	jun-22	(42,500)	19.61	833,497
2022052703736	S	USDMXN	jun-22	(246,669)	19.57	4,827,814
2022052703785	S	USDMXN	jun-22	(2,700,079)	19.61	52,949,971
2022052703906	S	USDMXN	jun-22	(227,597)	19.59	4,458,876
2022052703907	S	USDMXN	jun-22	(67,538)	19.58	1,322,385
2022052703908	S	USDMXN	jun-22	(2,140,034)	19.61	41,968,502
2022052703909	S	USDMXN	jun-22	(264,427)	19.59	5,180,423
2022060203468	B	GBPUSD	jun-22	50,000	1.27	(63,480)
2022060203470	S	GBPUSD	jun-22	(50,000)	1.27	63,480
2022060903327	B	USDMXN	jun-22	3,500,000	19.65	(68,759,250)
2022061703425	B	CADMXN	jun-22	390,000	15.62	(6,093,282)
2022061703424	B	EURMXN	jun-22	345,000	21.37	(7,373,858)
2022061703423	B	GBPMXN	jun-22	36,000	24.89	(895,943)
2022061603021	B	USDMXN	jun-22	500,000	20.65	(10,325,800)
2022061603031	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.69	(20,690,000)
2022061603032	B	USDMXN	jun-22	500,000	20.69	(10,345,000)
2022061603074	B	USDMXN	jun-22	3,500,000	20.60	(72,089,500)
2022061603139	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.65	(20,646,000)
2022061603168	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.63	(20,628,710)
2022061603185	B	USDMXN	jun-22	10,000,000	20.53	(205,294,000)
2022061603224	B	USDMXN	jun-22	400,000	20.54	(8,215,200)
2022061603312	B	USDMXN	jun-22	20,000,000	20.34	(406,886,000)
2022061603349	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.59	(20,590,000)
2022061603383	B	USDMXN	jun-22	555,500	20.42	(11,343,310)
2022061603487	B	USDMXN	jun-22	15,753,632	20.56	(323,846,162)
2022061603544	B	USDMXN	jun-22	11,480	20.56	(236,073)
2022061603545	B	USDMXN	jun-22	303,989	20.40	(6,200,162)
2022061603546	B	USDMXN	jun-22	3,790,145	20.59	(78,054,363)
2022061603547	B	USDMXN	jun-22	9,486,240	20.56	(195,076,172)
2022061603548	B	USDMXN	jun-22	2,161,630	20.48	(44,275,453)
2022061603001	S	USDMXN	jun-22	(9,000,000)	20.55	184,938,480
2022061603002	S	USDMXN	jun-22	(831,615)	20.63	17,152,059
2022061603016	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.63	20,627,200
2022061603025	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.70	20,700,000
2022061603028	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.70	20,700,000
2022061603052	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.67	103,358,000
2022061603055	S	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	20.68	62,040,000
2022061603068	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.69	103,435,000
2022061603077	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.69	103,440,000
2022061603078	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.69	103,439,000
2022061603087	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.69	103,470,000
2022061603089	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.69	20,693,000
2022061603090	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.70	20,696,000
2022061603094	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.70	41,390,000
2022061603099	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.69	103,465,000
2022061603131	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.66	20,660,480
2022061603160	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.61	20,609,400
2022061603181	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.56	20,559,200
2022061603184	S	USDMXN	jun-22	(10,000,000)	20.54	205,384,000
2022061603216	S	USDMXN	jun-22	(5,000,000)	20.50	102,507,000
2022061603221	S	USDMXN	jun-22	(2,155,111)	20.56	44,299,147
2022061603225	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.50	20,499,030
2022061603332	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.35	20,351,000
2022061603334	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.35	20,350,300
2022061603337	S	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	20.35	61,059,000
2022061603341	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.35	40,706,000
2022061603342	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.35	40,706,000
2022061603346	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.36	40,714,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022061603439	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.41	20,407,160
2022061603440	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.42	20,415,600
2022061603441	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.43	20,428,500
2022061603452	S	USDMXN	jun-22	(10,000,000)	20.40	204,015,000
2022061603476	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.41	20,405,800
2022061603488	S	USDMXN	jun-22	(13,024,236)	20.57	267,874,929
2022061603535	S	USDMXN	jun-22	(47,523)	20.55	976,732
2022061603536	S	USDMXN	jun-22	(265,940)	20.56	5,468,897
2022061603537	S	USDMXN	jun-22	(195,538)	20.56	4,021,134
2022061603538	S	USDMXN	jun-22	(1,839,584)	20.65	37,980,644
2022061603539	S	USDMXN	jun-22	(985,302)	20.47	20,174,029
2022061603540	S	USDMXN	jun-22	(9,652,548)	20.56	198,480,518
2022061703009	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.51	(20,505,000)
2022061703032	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.56	(20,557,900)
2022061703042	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.54	(20,544,700)
2022061703193	B	USDMXN	jun-22	350,000	20.50	(7,175,350)
2022061703202	B	USDMXN	jun-22	1,000,000	20.42	(20,419,600)
2022061703329	B	USDMXN	jun-22	555,500	20.38	(11,320,152)
2022061703426	B	NOKMXN	jun-22	43,000	2.04	(87,750)
2022061703565	B	USDMXN	jun-22	1,058,098	20.36	(21,543,479)
2022061703623	B	USDMXN	jun-22	18,645	20.52	(382,565)
2022061703624	B	USDMXN	jun-22	40,785	20.53	(837,431)
2022061703625	B	USDMXN	jun-22	982,367	20.35	(19,988,217)
2022061703048	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.55	41,100,000
2022061703058	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.57	20,572,000
2022061703080	S	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	20.52	61,545,000
2022061703081	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.53	20,525,900
2022061703082	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.53	20,526,800
2022061703084	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.53	20,529,220
2022061703114	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.48	20,480,000
2022061703210	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.42	40,839,000
2022061703212	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.40	20,403,100
2022061703242	S	USDMXN	jun-22	(735,917)	20.43	15,034,778
2022061703248	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.40	20,400,000
2022061703345	S	USDMXN	jun-22	(2,000,000)	20.38	40,760,000
2022061703412	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	20.36	10,181,250
2022061703486	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.35	20,350,000
2022061703487	S	USDMXN	jun-22	(10,000,000)	20.36	203,553,000
2022061703514	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	20.36	20,360,000
2022061703566	S	USDMXN	jun-22	(24,914)	20.55	511,930
2022061703621	S	USDMXN	jun-22	(24,866)	20.55	510,950
2022040103439	S	USDMXN	abr-22	(26,634)	19.89	529,697
2022040103440	S	USDMXN	abr-22	(19,721)	19.89	392,219
2022040103441	S	USDMXN	abr-22	(66,251)	19.89	1,317,608
2022040103442	S	USDMXN	abr-22	(199,000)	19.89	3,957,704
2022040103443	S	USDMXN	abr-22	(37,206)	19.89	739,953
2022040403014	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.80	5,940,000
2022040403015	S	USDMXN	abr-22	(300,000)	19.80	5,940,000
2022041303084	B	USDMXN	abr-22	4,200	19.45	(81,676)
2022041303322	BON	USDMXN	abr-22	244,236	21.78	(5,318,727)
2022041303696	BON	USDMXN	abr-22	244,236	21.78	(5,318,727)
2022041303137	S	USDMXN	abr-22	(366,610)	19.80	7,257,082
2022041303190	S	USDMXN	abr-22	(1,187,970)	19.82	23,540,515
2022041303207	S	USDMXN	abr-22	(1,187,970)	19.82	23,540,515
2022041303241	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.85	496,195
2022041303246	S	USDMXN	abr-22	(4,245)	19.84	84,224
2022041303291	S	USDMXN	abr-22	(10,579)	19.85	210,012
2022041303294	S	USDMXN	abr-22	(35,000)	19.85	694,638
2022041303323	SO	USDMXN	abr-22	0	19.81	479,496

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022041303333	S	USDMXN	abr-22	(24,000)	19.86	476,599
2022041303334	S	USDMXN	abr-22	(28,808)	19.86	572,123
2022041303430	S	USDMXN	abr-22	(5,000)	19.81	99,040
2022041303432	S	USDMXN	abr-22	(5,580)	19.81	110,521
2022041303440	S	USDMXN	abr-22	(15,000)	19.80	297,000
2022041303442	S	USDMXN	abr-22	(25,000)	19.80	495,000
2022041303477	S	USDMXN	abr-22	(11,000)	19.80	217,747
2022041303511	S	USDMXN	abr-22	(15,000)	19.79	296,850
2022041303612	S	USDMXN	abr-22	(19,950)	19.81	395,162
2022041303697	SO	USDMXN	abr-22	0	19.84	472,230
2022041903192	B	USDMXN	abr-22	800,000	20.05	(16,038,400)
2022042103389	B	USDMXN	abr-22	500,000	20.19	(10,096,750)
2022042503068	B	USDMXN	abr-22	2,500,000	20.45	(51,125,000)
2022042603275	BO	USDMXN	abr-22	402,000	20.27	(8,146,932)
2022042603288	BO	USDMXN	abr-22	500,000	19.90	(9,948,000)
2022042603266	S	USDMXN	abr-22	(1,718,000)	20.23	34,755,140
2022042603280	S	USDMXN	abr-22	(402,000)	20.23	8,131,656
2022042603331	S	USDMXN	abr-22	(402,000)	20.23	8,131,656
2022042603338	S	USDMXN	abr-22	(1,718,000)	20.23	34,755,140
2022042803525	S	EURMXN	may-22	(3,703)	21.56	79,835
2022042803527	S	EURMXN	may-22	(2,928)	21.56	63,111
2022050303239	S	JPYMXN	may-22	(281,250)	0.16	45,000
2022042903182	BO	USDMXN	may-22	1,000,000	19.91	(19,912,000)
2022042903069	SO	USDMXN	may-22	(500,000)	20.31	10,154,500
2022042903082	S	USDMXN	may-22	(500,000)	20.31	10,154,500
2022050203280	S	USDMXN	may-22	(58,920)	20.49	1,207,448
2022050303010	SO	USDMXN	may-22	(1,800,000)	20.36	36,648,000
2022050303012	S	USDMXN	may-22	(1,800,000)	20.36	36,648,000
2022050303299	SO	USDMXN	may-22	(1,000,000)	20.30	20,300,000
2022050303304	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	20.30	20,300,000
2022050503426	B	EURMXN	may-22	1,000,000	21.97	(21,974,400)
2022050403039	S	USDMXN	may-22	(23,000)	20.34	467,799
2022050403439	SO	USDMXN	may-22	(500,000)	20.08	10,038,000
2022050403452	S	USDMXN	may-22	(500,000)	20.08	10,038,000
2022050403455	S	USDMXN	may-22	(300,000)	20.08	6,023,400
2022050403456	S	USDMXN	may-22	(300,000)	20.08	6,023,400
2022050403500	SO	USDMXN	may-22	(1,000,000)	20.03	20,026,000
2022050403503	S	USDMXN	may-22	(1,000,000)	20.03	20,026,000
2022051103087	S	USDMXN	may-22	(30,000,000)	20.28	608,442,000
2022051303578	SO	USDMXN	may-22	(65,197)	20.82	1,357,441
2022051303579	SO	USDMXN	may-22	(33,622)	20.82	700,030
2022051303580	SO	USDMXN	may-22	(24,327)	20.82	506,503
2022051703073	S	USDMXN	may-22	(20,000)	19.97	399,460
2022051703131	S	USDMXN	may-22	(510,880)	19.97	10,199,718
2022051703152	S	USDMXN	may-22	(100,000)	20.00	2,000,200
2022051703467	S	USDMXN	may-22	(257,069)	19.99	5,138,458
2022051703565	S	USDMXN	may-22	(500,000)	19.96	9,981,150
2022051703567	S	USDMXN	may-22	(500,000)	19.96	9,981,150
2022052503098	S	USDMXN	may-22	(292,580)	19.86	5,810,647
2022052603016	B	USDMXN	may-22	922,359	19.77	(18,236,937)
2022052603237	B	USDMXN	may-22	460	19.39	(8,924)
2022052603013	S	USDMXN	may-22	(20,000,000)	19.82	396,309,000
2022052603050	S	USDMXN	may-22	(30,000)	19.83	594,933
2022052603057	S	USDMXN	may-22	(2,500,000)	19.78	49,448,750
2022052603068	S	USDMXN	may-22	(5,050)	19.82	100,083
2022052603069	S	USDMXN	may-22	(2,085)	19.81	41,315
2022052603087	S	USDMXN	may-22	(927)	19.83	18,374
2022052603090	S	USDMXN	may-22	(29,898)	19.84	593,232
2022052603108	S	USDMXN	may-22	(5,100)	19.83	101,121

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052603114	S	USDMXN	may-22	(50,000)	19.84	991,945
2022052603115	S	USDMXN	may-22	(78,000)	19.83	1,546,654
2022052603118	S	USDMXN	may-22	(20,000)	19.83	396,546
2022052603119	S	USDMXN	may-22	(530,000)	19.79	10,486,156
2022052603121	S	USDMXN	may-22	(530,000)	19.79	10,486,686
2022052603157	S	USDMXN	may-22	(52,346)	19.83	1,038,205
2022052603158	S	USDMXN	may-22	(50,000)	19.83	991,625
2022052603210	S	USDMXN	may-22	(30,705)	19.84	609,276
2022052603212	S	USDMXN	may-22	(30,000)	19.84	595,287
2022052603296	S	USDMXN	may-22	(9,458)	19.84	187,663
2022052603316	S	USDMXN	may-22	(100,080)	19.84	1,985,587
2022052603394	S	USDMXN	may-22	(105,000)	19.79	2,078,408
2022052603398	S	USDMXN	may-22	(8,000)	19.83	158,664
2022052603415	S	USDMXN	may-22	(21,000)	20.19	424,022
2022052603420	SO	USDMXN	may-22	(975,000)	21.61	21,074,138
2022052603422	S	USDMXN	may-22	(21,000)	19.82	416,220
2022052603457	S	USDMXN	may-22	(9,912)	19.82	196,455
2022052603532	S	USDMXN	may-22	(40,000)	19.83	793,160
2022052703123	B	USDMXN	jun-22	992,722	19.56	(19,412,682)
2022052703209	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.45	(11,331,516)
2022052703213	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.34	(11,270,022)
2022052703215	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.35	(11,275,285)
2022052703217	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.19	(11,184,983)
2022052703218	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.41	(11,305,478)
2022052703220	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.39	(11,298,553)
2022052703223	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.39	(11,294,232)
2022052703225	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.49	(11,350,740)
2022052703233	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.35	(11,273,069)
2022052703235	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.34	(11,270,299)
2022052703237	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.38	(11,287,750)
2022052703239	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.21	(11,198,833)
2022052703241	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.20	(11,191,631)
2022052703243	BON	USDMXN	jun-22	554,000	20.13	(11,153,128)
2022052703434	BON	USDMXN	jun-22	1,179,007	20.17	(23,780,100)
2022052703543	BO	USDMXN	jun-22	317,500	19.61	(6,225,223)
2022052703634	B	USDMXN	jun-22	25,000	19.60	(490,008)
2022052703084	S	USDMXN	jun-22	(32,477)	19.64	637,917
2022052703085	S	USDMXN	jun-22	(50,000)	19.64	982,180
2022052703089	S	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.63	196,322
2022052703091	S	USDMXN	jun-22	(5,100)	19.63	100,126
2022052703098	S	USDMXN	jun-22	(24,854)	19.64	488,090
2022052703102	S	USDMXN	jun-22	(8,053)	19.63	158,043
2022052703109	S	USDMXN	jun-22	(3,273)	19.62	64,231
2022052703112	S	USDMXN	jun-22	(60,000)	19.62	1,177,308
2022052703126	S	USDMXN	jun-22	(7,000)	19.65	137,550
2022052703128	S	USDMXN	jun-22	(40,000)	19.61	784,448
2022052703146	S	USDMXN	jun-22	(10,168)	19.62	199,493
2022052703159	S	USDMXN	jun-22	(1,000)	19.60	19,596
2022052703210	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	480,318
2022052703214	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	418,824
2022052703216	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	424,087
2022052703219	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	333,785
2022052703221	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	454,280
2022052703222	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	447,355
2022052703224	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	443,034
2022052703226	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	499,542
2022052703234	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	421,871
2022052703236	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	419,101
2022052703238	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	436,552

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022052703240	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	347,635
2022052703242	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	340,433
2022052703244	SO	USDMXN	jun-22	0	19.59	301,930
2022052703250	SO	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	19.58	58,743,000
2022052703251	SO	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,581,000
2022052703252	SO	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,581,000
2022052703253	S	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.59	1,958,780
2022052703256	S	USDMXN	jun-22	(3,000,000)	19.58	58,743,000
2022052703260	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,581,000
2022052703265	S	USDMXN	jun-22	(1,000,000)	19.58	19,581,000
2022052703285	S	USDMXN	jun-22	(48,330)	19.62	948,254
2022052703287	S	USDMXN	jun-22	(25,000)	19.62	490,455
2022052703308	S	USDMXN	jun-22	(20,000)	19.62	392,350
2022052703309	S	USDMXN	jun-22	(20,000)	19.62	392,440
2022052703316	SO	USDMXN	jun-22	(554,000)	19.58	10,847,320
2022052703332	S	USDMXN	jun-22	(50,000)	19.63	981,385
2022052703336	S	USDMXN	jun-22	(2,254)	19.60	44,171
2022052703337	S	USDMXN	jun-22	(5,644)	19.60	110,625
2022052703340	S	USDMXN	jun-22	(1,950)	19.60	38,215
2022052703359	S	USDMXN	jun-22	(25,000)	19.63	490,723
2022052703377	S	USDMXN	jun-22	(1,680)	19.65	33,010
2022052703379	S	USDMXN	jun-22	(2,900)	19.65	56,982
2022052703380	S	USDMXN	jun-22	(3,000)	19.66	58,967
2022052703405	SO	USDMXN	jun-22	(345,000)	19.61	6,764,415
2022052703419	S	USDMXN	jun-22	(10,200)	19.66	200,483
2022052703435	SO	USDMXN	jun-22	0	19.60	675,689
2022052703441	S	USDMXN	jun-22	(25,000)	19.63	490,825
2022052703500	S	USDMXN	jun-22	(19,985)	19.66	392,873
2022052703506	S	USDMXN	jun-22	(19,550)	19.63	383,800
2022052703528	S	USDMXN	jun-22	(18,000)	19.62	353,122
2022052703560	S	USDMXN	jun-22	(13,194)	19.96	263,313
2022052703567	S	USDMXN	jun-22	(20,000)	19.65	393,058
2022052703579	S	USDMXN	jun-22	(10,000)	19.65	196,499
2022052703592	S	USDMXN	jun-22	(1)	19.71	20
2022052703650	S	USDMXN	jun-22	(5,100)	19.65	100,209
2022052703653	S	USDMXN	jun-22	(5,005)	19.65	98,325
2022052703655	S	USDMXN	jun-22	(1,904)	19.65	37,405
2022052703657	S	USDMXN	jun-22	(900)	19.64	17,680
2022052703661	S	USDMXN	jun-22	(7,763)	19.64	152,487
2022052703662	S	USDMXN	jun-22	(1,012)	19.64	19,876
2022052703663	S	USDMXN	jun-22	(900)	19.64	17,677
2022052703666	S	USDMXN	jun-22	(1,556)	19.64	30,562
2022053103540	BO	USDMXN	jun-22	400,000	20.99	(8,394,400)
2022060203325	SO	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.65	1,965,400
2022060203416	S	USDMXN	jun-22	(100,000)	19.65	1,965,400
2022060303380	S	USDMXN	jun-22	(115,020)	19.60	2,253,817
2022060603307	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603309	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603311	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603313	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603315	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603317	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603319	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060603321	S	USDMXN	jun-22	(500,000)	19.61	9,805,550
2022060903047	SO	EURMXN	jun-22	(1,500,000)	20.89	31,329,000
2022060903067	S	EURMXN	jun-22	(1,500,000)	20.89	31,329,000
2022060903413	BO	USDMXN	jun-22	421,582	19.65	(8,284,921)
2022060903444	BON	USDMXN	jun-22	421,582	19.65	(8,284,921)
2022061303125	S	USDMXN	jun-22	(52,065)	20.47	1,065,510

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022061403067	B	USDMXN	jun-22	2,000,000	20.61	(41,214,000)
2022061403434	S	USDMXN	jun-22	(520,000)	20.64	10,732,280
2022061503457	S	USDMXN	jun-22	(300,000)	20.48	6,144,000
2022061603062	B	USDMXN	jun-22	15,000,000	20.68	(310,267,500)
2022061603085	B	USDMXN	jun-22	15,000,000	20.69	(310,342,500)
2022061603104	B	USDMXN	jun-22	15,000,000	20.68	(310,267,500)
2022061603110	B	USDMXN	jun-22	15,000,000	20.69	(310,342,500)
2022061603166	B	USDMXN	jun-22	60,000	20.58	(1,234,800)
2022061603253	B	USDMXN	jun-22	100,000	20.43	(2,042,530)
2022061603359	B	USDMXN	jun-22	24,557,522	20.34	(499,500,000)
2022061603473	B	USDMXN	jun-22	7,000	19.88	(139,186)
2022061603477	B	USDMXN	jun-22	5,000	19.90	(99,517)
2022061603045	S	USDMXN	jun-22	(12,000)	20.73	248,735
2022061603102	S	USDMXN	jun-22	(18,853)	20.73	390,730
2022061603107	S	USDMXN	jun-22	(79,314)	20.69	1,641,125
2022061603123	S	USDMXN	jun-22	(5,000)	20.72	103,579
2022061603153	S	USDMXN	jun-22	(15,000)	20.68	310,181
2022061603176	S	USDMXN	jun-22	(20,000)	20.63	412,566
2022061603189	S	USDMXN	jun-22	(30,500)	20.60	628,327
2022061603191	S	USDMXN	jun-22	(28,939)	20.59	595,892
2022061603247	S	USDMXN	jun-22	(5,040)	20.48	103,196
2022061603251	S	USDMXN	jun-22	(555,500)	20.42	11,343,866
2022061603260	S	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.48	204,795
2022061603310	S	USDMXN	jun-22	(30,000)	20.37	611,115
2022061703307	BON	USDMXN	jun-22	589,504	20.24	(11,933,143)
2022061703308	BO	USDMXN	jun-22	0	20.48	(137,531)
2022061703309	BON	USDMXN	jun-22	589,504	20.15	(11,877,258)
2022061703310	BO	USDMXN	jun-22	0	20.48	(193,416)
2022061703388	B	USDMXN	jun-22	20,000	20.06	(401,262)
2022061703395	B	USDMXN	jun-22	867	20.27	(17,566)
2022061703011	S	USDMXN	jun-22	(25,000,000)	20.54	513,593,750
2022061703160	S	USDMXN	jun-22	(100,610)	20.47	2,059,617
2022061703161	S	USDMXN	jun-22	(98,500)	20.47	2,016,453
2022061703162	S	USDMXN	jun-22	(100,890)	20.48	2,066,298
2022061703223	S	USDMXN	jun-22	(35,000)	20.44	715,407
2022061703264	SO	USDMXN	jun-22	(555,500)	20.39	11,323,868
2022061703276	S	USDMXN	jun-22	(8,560)	20.38	174,465
2022061703295	S	USDMXN	jun-22	(4,330)	20.40	88,327
2022061703296	S	USDMXN	jun-22	(900)	20.40	18,358
2022061703299	S	USDMXN	jun-22	(3,061)	20.39	62,419
2022061703300	S	USDMXN	jun-22	(19,615)	20.39	400,000
2022061703301	S	USDMXN	jun-22	(500)	20.39	10,196
2022061703302	S	USDMXN	jun-22	(900)	20.39	18,350
2022061703304	S	USDMXN	jun-22	(7,303)	20.39	148,907
2022061703306	S	USDMXN	jun-22	(6,425)	20.39	130,999
2022061703311	S	USDMXN	jun-22	(1,700)	20.39	34,662
2022061703328	S	USDMXN	jun-22	(25,000)	20.40	509,915
2022061703337	S	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.41	1,020,270
2022061703344	S	USDMXN	jun-22	(164,018)	20.49	3,360,344
2022061703349	S	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.42	204,220
2022061703352	S	USDMXN	jun-22	(10,000)	20.42	204,204
2022061703384	S	USDMXN	jun-22	(800)	20.42	16,336
2022061703418	S	USDMXN	jun-22	(24,213)	20.40	493,951
2022061703440	S	USDMXN	jun-22	(15,000)	20.38	305,697
2022061703441	S	USDMXN	jun-22	(5,000)	20.38	101,908
2022061703443	S	USDMXN	jun-22	(5,005)	20.38	102,006
2022061703446	S	USDMXN	jun-22	(25,000)	20.38	509,435
2022061703501	S	USDMXN	jun-22	(3,000)	20.39	61,177
2022061703502	S	USDMXN	jun-22	(3,000)	20.40	61,188
2022061703539	S	USDMXN	jun-22	(4,000)	20.39	81,553
2022061703559	S	USDMXN	jun-22	(40,000)	20.38	815,272
2022061703580	S	USDMXN	jun-22	(50,000)	20.37	1,018,400
2022062403246	S	USDMXN	jun-22	(5,340)	19.93	106,410

## Liquidados anticipadamente

TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlID	Option Notional
C67350	CC Swap	oct-24	Buy	U	USD	5,000,000	USD	90,775,000	MXN	
C67362	CC Swap	oct-24	Buy	U	USD	90,775,000	MXN	5,000,000	USD	
C67378	CC Swap	mar-24	Buy	U	USD	4,518,000	USD	87,100,000	MXN	
C72553	CC Swap	mar-24	Buy	U	USD	4,000,000	EUR	4,518,000	USD	
C76774	CC Swap	ene-28	Buy	U	USD	15,000,000	USD	313,200,000	MXN	
C76775	CC Swap	abr-29	Buy	U	USD	10,000,000	USD	209,500,000	MXN	
C76776	CC Swap	abr-29	Buy	U	USD	5,000,000	USD	104,525,000	MXN	
E74540	Eq Option	nov-24	Sell	U	MXN					395,020,000
E74542	Eq Option	nov-24	Sell	U	MXN					384,810,000
E75704	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					789,510,000
E75705	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					789,510,000
E75706	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					789,510,000
E75707	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					789,510,000
E77268	Eq Option	mar-23	Buy	U	MXN					647,191,000
E77269	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					647,191,000
E77270	Eq Option	mar-23	Sell	U	MXN					647,191,000
E79216	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					788,140,000
E79224	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					788,140,000
E79225	Eq Option	may-23	Sell	U	MXN					788,140,000
E79226	Eq Option	may-23	Buy	U	MXN					788,140,000
MNF336	Term Deposit	jun-22	Buy	U	USD			9,400,000	USD	
MNF337	Term Deposit	jun-22	Buy	U	USD			4,967,757	USD	
MNF361	Term Deposit	dic-22	Buy	U	MXN			150,000,000	MXN	
MPL841	Term Deposit	mar-24	Buy	U	EUR			4,000,000	EUR	
MTD700	Term Deposit	ene-28	Buy	U	USD			15,000,000	USD	
MTD701	Term Deposit	abr-29	Buy	U	USD			10,000,000	USD	
MTD714	Term Deposit	abr-29	Buy	U	USD			5,000,000	USD	
P17004	Cap	nov-23	Sell	U	MXN					500,000,000
P17005	Cap	nov-23	Buy	U	MXN					500,000,000
P17202	Cap	jun-27	Sell	U	MXN					58,782,000
P17203	Floor	jun-27	Buy	U	MXN					58,782,000
P17204	Floor	jun-27	Sell	U	MXN					58,782,000
P17205	Cap	jun-27	Buy	U	MXN					58,782,000
SCG833	SC Swap	jun-27	Buy	U	MXN	92,613,255	MXN	92,613,255	MXN	
SCG861	SC Swap	jun-27	Buy	U	MXN	92,613,255	MXN	92,613,255	MXN	
SDR951	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,161,180	MXN	3,161,180	MXN	
SDR954	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,161,180	MXN	3,161,180	MXN	
SDS262	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	10,021,929	MXN	10,021,929	MXN	
SDS282	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	10,021,929	MXN	10,021,929	MXN	
SDS345	SC Swap	ago-23	Buy	U	MXN	14,430,000	MXN	14,430,000	MXN	
SDS361	SC Swap	ago-23	Buy	U	MXN	14,430,000	MXN	14,430,000	MXN	
SDS414	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDS433	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,454,000	MXN	3,454,000	MXN	
SDS437	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,454,000	MXN	3,454,000	MXN	
SDS507	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	8,150,000	MXN	8,150,000	MXN	
SDS521	SC Swap	ene-24	Buy	U	MXN	8,150,000	MXN	8,150,000	MXN	
SDS549	SC Swap	oct-22	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SDT123	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDT134	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDT193	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	15,300,000	MXN	15,300,000	MXN	
SDT196	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	15,300,000	MXN	15,300,000	MXN	
SDT205	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	41,512,715	MXN	41,512,715	MXN	
SDT220	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT222	SC Swap	mar-26	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SDT240	SC Swap	mar-25	Buy	U	MXN	41,512,715	MXN	41,512,715	MXN	
SDT277	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,500,000	MXN	3,500,000	MXN	
SDT278	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	3,500,000	MXN	3,500,000	MXN	
SDT333	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDT336	SC Swap	nov-23	Buy	U	MXN	140,000,000	MXN	140,000,000	MXN	
SDT524	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	9,400,000	USD	9,400,000	USD	
SDT527	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	9,400,000	USD	9,400,000	USD	
SDT529	SC Swap	ene-27	Buy	U	MXN	122,169,514	MXN	122,169,514	MXN	
SDT532	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	9,400,000	USD	9,400,000	USD	
SDT535	SC Swap	ene-27	Buy	U	MXN	122,169,514	MXN	122,169,514	MXN	
SDT547	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	4,967,757	USD	4,967,757	USD	
SDT550	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	4,967,757	USD	4,967,757	USD	
SDT555	SC Swap	jun-22	Buy	U	USD	4,967,757	USD	4,967,757	USD	
SDT803	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	19,500,000	MXN	19,500,000	MXN	
SDT817	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	19,500,000	MXN	19,500,000	MXN	
SDT932	SC Swap	abr-24	Buy	U	USD	36,000,000	USD	36,000,000	USD	
SDT943	SC Swap	abr-24	Buy	U	USD	36,000,000	USD	36,000,000	USD	
SDU094	SC Swap	ene-23	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SDU114	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	24,000,000	MXN	24,000,000	MXN	
SDU120	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	24,000,000	MXN	24,000,000	MXN	



TransID	Trans Product ID	MaturityDate	BuySellFlag	Trans Status	BaseCurlD	PaySide Notional	PaySide CurlD	RcvSide Notional	RcvSide CurlD	Option Notional
SDU850	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	4,562,769	MXN	4,562,769	MXN	
SDU860	SC Swap	abr-24	Buy	U	MXN	4,562,769	MXN	4,562,769	MXN	
SDV030	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDV038	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SDV146	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV149	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV171	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SDV436	SC Swap	may-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDV463	SC Swap	may-24	Buy	U	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SDV740	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN	
SDV845	SC Swap	jul-24	Buy	U	MXN	55,000,000	MXN	55,000,000	MXN	
SDW183	SC Swap	jul-22	Buy	U	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN	
SEG069	SC Swap	dic-22	Buy	U	MXN	337,500,000	MXN	337,500,000	MXN	
SFR967	SC Swap	nov-28	Buy	U	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SFS629	SC Swap	dic-23	Buy	U	MXN	3,470,590	MXN	3,470,590	MXN	
SGN098	SC Swap	abr-24	Buy	U	USD	50,000,000	USD	50,000,000	USD	
SGP372	SC Swap	may-32	Buy	U	USD	15,000,000	USD	15,000,000	USD	
SGT596	SC Swap	jun-32	Buy	U	USD	5,700,000	USD	5,700,000	USD	
SGX391	SC Swap	jun-26	Buy	U	USD	20,000,000	USD	20,000,000	USD	
SGX392	SC Swap	jun-27	Buy	U	USD	18,000,000	USD	18,000,000	USD	
SGX393	SC Swap	jun-28	Buy	U	USD	4,000,000	USD	4,000,000	USD	



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

Cifras expresadas en pesos

Producto	Fecha de evento	Contraparte/ Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 1	MXN	9,562	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 2	MXN	136,081	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 3	MXN	6,886	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 4	MXN	8,787	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 5	MXN	17,050	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA
Forwards FX	abr-22	Cliente 6	MXN	145,896	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards FX	abr-22	Cliente 7	MXN	223,318	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards FX	abr-22	Cliente 8	MXN	72,308	NO ENVIO LOS FONDOS
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 9	MXN	579,370	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 10	MXN	324	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	abr-22	Cliente 11	MXN	609,360	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 12	MXN	612,408	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 13	MXN	614,868	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 14	MXN	622,905	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 15	MXN	627,435	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 16	MXN	1,264,680	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 17	MXN	632,070	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 18	MXN	632,925	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards FX	abr-22	Cliente 19	MXN	635,895	PAGO FUERA DE HORARIO
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente 20	MXN	531,517	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 21	MXN	24,257	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 22	MXN	58,443	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente 23	MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente 24	MXN	266,843	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 25	MXN	2,885	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 26	MXN	1,376	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 27	MXN	516,845	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 28	MXN	585,330	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente 29	MXN	187	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente 30	MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente 31	MXN	203,771	NO FONDEO SU CUENTA
FX Options (Vanilla)	jun-22	Cliente 32	MXN	2,025,000	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 33	MXN	2,270	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 34	MXN	(2,874)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 35	MXN	69,961	NO ENVIO LOS FONDOS
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 36	MXN	99,944	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards FX	jun-22	Cliente 37	USD	117,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente 38	USD	128,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente 39	USD	137,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente 40	USD	151,000	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 41	MXN	389,084	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 42	MXN	(3,175)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 43	MXN	312,150	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente 44	MXN	391	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente 45	MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente 46	MXN	194,068	NO FONDEO SU CUENTA

## Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

### Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	1,860,476,602	Compra	Divisas	Divisas	136,329,046,937	81,132,969,175	1,645,763,156	214,713,446	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	2,149,712,101	Venta	Divisas	Divisas	( 136,116,384,001)	( 80,845,850,069)	1,930,046,629	219,665,472	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,052,739,000	Compra	Acción	Acción	217,645,480	229,944,056	437,360,000	615,379,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	51,916,000	Venta	Acción	Acción	( 191,664,644)	( 207,932,358)	437,360,000	( 385,444,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,269,057,365	Compra	Divisas	Divisas	164,017,986	211,096,768	7,970,330,951	298,726,414	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,269,057,365	Venta	Divisas	Divisas	( 164,018,410)	( 199,349,583)	7,970,330,951	298,726,414	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,789,431,000	Compra	Índice	Índice	291,016,692	343,470,239	152,600,000	3,636,831,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Índice	Índice	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	35,270,453,478	Compra	Tasas	Tasas	599,905,185	926,955,741	1,351,807,909	30,502,299,961	3,416,345,609	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	34,573,564,712	Venta	Tasas	Tasas	( 579,699,670)	( 889,730,804)	1,351,807,909	29,980,868,049	3,240,888,755	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	742,570,000	Compra	Acción NE	Acción NE	186,646,497	151,949,310	-	742,570,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	512,879,000	Venta	Acción NE	Acción NE	( 212,627,333)	( 173,961,009)	-	512,879,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,787,131,000	Venta	Índice NE	Índice NE	( 291,016,692)	( 343,306,851)	152,600,000	3,634,531,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	237,515,102	Compra	Divisas NE	Divisas NE	-	15,487,193	-	237,515,102	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	237,515,102	Venta	Divisas NE	Divisas NE	-	( 27,234,486)	-	237,515,102	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	9,085,130,530	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	330,632,090	429,095,530	-	5,618,272,340	3,466,858,190	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	-	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	( 4,400,003)	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	39,014,814,065	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	1,684,465,667	2,261,184,525	-	22,289,862,518	16,724,951,547	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	-	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	1,820,081	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	172,089,028	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	115,462,194	264,506,585	-	172,089,028	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	19,114,680,370	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	262,013,756	596,899,221	-	5,964,546,833	13,150,133,537	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	347,255,302,810	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	10,834,226,892	14,555,243,926	104,990,818,777	110,357,467,985	131,907,016,048	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	24,195,630,415	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	( 328,450,026)	( 886,794,340)	73,806,850	12,554,391,985	11,567,431,580	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	350,838,438,750	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	( 11,092,302,253)	( 14,723,662,751)	108,163,889,557	104,395,897,538	138,278,651,656	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			<b>A C T I V O</b>	720,520,798,331	0
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	51,075,132,115	0
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	839,400,968	0
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	140,917,013,036	0
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	70,482,153,033	0
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	65,228,673,637	0
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	5,206,186,366	0
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	5,207,399,336	0
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-1,212,970	0
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	688,971,454	0
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	36,454,494,629	0
	101400102001		Con fines de negociación	30,156,421,721	0
	101400102002		Con fines de cobertura	6,298,072,908	0
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-1,256,331,883	0
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	439,757,686,826	0
	101800105001		Créditos comerciales	232,322,806,414	0
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	196,589,871,096	0
		101800107002	Entidades financieras	19,672,071,100	0
		101800107003	Entidades gubernamentales	16,060,864,218	0
	101800105002		Créditos de consumo	33,685,216,840	0
	101800105003		Créditos a la vivienda	173,749,663,572	0
		101800507023	Media y residencial	167,945,874,159	0
		101800507024	De interés social	5,024,419	0
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,798,764,994	0
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2</b>	3,835,224,642	0
	101800205005		Créditos comerciales	707,650,300	0
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	489,268,688	0
		101800506008	Entidades financieras	196,692,642	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	21,688,970	0
	101800205006		Créditos de consumo	628,144,315	0
	101800205007		Créditos a la vivienda	2,499,430,027	0
		101800706018	Media y residencial	2,379,895,547	0
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	119,534,480	0
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3</b>	16,428,498,940	0
	101800305008		Créditos comerciales	8,024,633,205	0
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	7,847,416,098	0
		101800806024	Entidades financieras	91,312,618	0
		101800806025	Entidades gubernamentales	85,904,489	0
	101800305009		Créditos de consumo	967,210,444	0
	101800305010		Créditos a la vivienda	7,436,655,291	0
		101801006034	Media y residencial	7,210,515,665	0
		101801006035	De interés social	11,725,403	0
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	214,414,223	0
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		<b>Cartera de crédito valuada a valor razonable</b>	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	460,021,410,408	0
	131800103002		Partidas diferidas	0	0
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-15,648,038,646	0
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	444,373,371,762	0
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	444,373,371,762	0
102000001001			<b>Activos virtuales</b>	0	0
102200001001			<b>BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
132400001001			<b>Otras cuentas por cobrar (neto)</b>	24,972,623,659	0
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	196,913,716	0
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	16,533,054	0
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	5,022,625,795	0
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	4,182,889,805	0
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,685,531,750	0
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	52,132,294	0
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	5,675,046,124	0
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,624,450,053	0
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			<b>P A S I V O</b>	645,630,099,083	0
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	439,729,162,368	0
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	221,198,858,397	0
	200200102002		Depósitos a plazo	195,240,240,380	0
		200200203003	Del público en general	192,934,636,714	0
		200200203004	Mercado de dinero	2,305,603,666	0
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	22,354,674,668	0
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	935,388,923	0
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	41,854,739,229	0
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	17,735,985,334	0
	200400102003		De largo plazo	24,118,753,895	0
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	11,262,297,601	0
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	68,665,753,661	0
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	222,305,367	0
	201200102001		Reportos	252	0
	201200102002		Préstamo de valores	222,305,115	0
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	33,365,196,441	0
	201400102001		Con fines de negociación	29,756,976,512	0
	201400102002		Con fines de cobertura	3,608,219,929	0
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	5,071,226	0
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,786,518,860	0
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	30,185,071,939	0
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	16,008,563,377	0
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,887,085,482	0
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	4,069,908,482	0
	202400102004		Contribuciones por pagar	442,407,552	0
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	7,777,107,046	0
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
20300001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,051,585,649	0
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	9,051,585,649	0
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
203400001001			Pasivo por impuestos a la utilidad	1,403,697,654	0
203600001001			Pasivo por beneficios a los empleados	5,609,839,432	0
203800001001			Créditos diferidos y cobros anticipados	1,488,859,656	0
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	74,890,699,248	0
440200001001			Participación controladora	74,889,528,699	0
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	12,906,542,339	0
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	0
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	0
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,155,059,263	0
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	0
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		<b>CAPITAL GANADO</b>	61,982,986,360	0
		400200203010	Reservas de capital	7,839,163,707	0
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	0
		400200203012	Resultados acumulados	53,429,744,854	0
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	47,118,580,284	0
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	6,311,164,570	0
	400200203013		Otros resultados integrales	551,721,561	0
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-267,642,351	0
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	936,734,939	0
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-117,371,027	0
		400201304013	Incremento por actualización de la remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	38,944	0
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,170,549	0
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	51,914	0
	440400102002		Otra participación no controladora	1,118,635	0
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	2,901,335,826,864	0
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	255,675,823,355	0
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	421,605,849,123	0
	700800102001		Fideicomisos	392,383,073,692	0
	700800102002		Mandatos	29,222,775,431	0
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	560,892,681,342	0
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	11,132,876,663	0
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	249	0
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,132,978,315	0
702000001001			Otras cuentas de registro	1,650,895,617,817	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2022**

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

## ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

**CONSOLIDADO**

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(PESOS)

**Impresión Final**

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	25,174,089,012	0
600400101002	Gastos por intereses	13,029,403,012	0
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	12,144,686,000	0
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	-1,039,411,521	0
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	13,184,097,521	0
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	2,353,983,622	0
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	329,387,216	0
501400301007	Resultado por intermediación	842,954,734	0
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	313,193,680	0
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	8,344,400,005	0
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	8,020,442,336	0
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	58,244,060	0
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	8,078,686,396	0
602400501012	Impuestos a la utilidad	1,767,469,912	0
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	6,311,216,484	0
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	6,311,216,484	0
502800701014	Otros Resultados Integrales	410,775,959	0
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-156,604,458	0
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	557,444,163	0
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	9,936,254	0
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	38,944	0
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	6,722,031,387	0
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	6,311,216,484	0
543201602158	Participación controladora	6,311,164,570	0
543201602159	Participación no controladora	51,914	0
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	6,721,992,443	0
543401702160	Participación controladora	6,721,992,443	0
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	<b>UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA</b>	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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 2022 Y 2021

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	8,078,686,396	0
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	103,690,043	0
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	505,638,253	0
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	280,017,626	0
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-57,656,639	0
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-58,244,060	0
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-566,065,137	0
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	-12,144,686,000	0
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	1,247,925,277	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	482,298,633	0
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	-13,874,909,910	0
851000102004		<b>Cambios en partidas de operación</b>	-15,689,310,144	0
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-6,552,805,639	0
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	-1,398,439,320	0
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	-6,971,121,189	0
	851000403004	Cambio en deudores por reporte (neto)	12,758,682,397	0
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-12,127,694,692	0
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-22,296,768,127	0
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	-10,993,596,722	0
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-73,023,621	0
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	1,366,929,655	0
	851000403014	Cambio en captación tradicional	-2,325,954,075	0
	851000403015	Cambio en acreedores por reporte	11,020,068,371	0
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-37,122	0
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-2,535,351,875	0
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	10,590,958,422	0
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	-2,664,634	0
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	78,415,668	0
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	524,812,510	0
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	13,393,791,999	0
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-145,512,150	0
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	-19,651,619,705	0
		<b>Actividades de inversión</b>		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-158,179,704	0
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	-8,152	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	57,687,998	0
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-315,018,438	0
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**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 2022 Y 2021

**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	666,696	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	<b>-414,851,600</b>	<b>0</b>
		<b>Actividades de financiamiento</b>		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	-1,247,925,277	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-482,298,633	0
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	-11,011,546	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	25,174,089,012	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	-11,288,167,556	0
851000001003		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento</b>	<b>12,144,686,000</b>	<b>0</b>
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>-7,921,785,305</b>	<b>0</b>
	851200000000	<b>Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
	851400000000	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo</b>	<b>58,996,917,420</b>	<b>0</b>
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	<b>51,075,132,115</b>	<b>0</b>

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

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2022

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE  
 CRÉDITO

AL 30 DE JUNIO DE 2022 Y 2021

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado								Participación en ORI de otras entidades	Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios				
<b>Saldo al inicio del periodo</b>	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,574,357.437	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	67,350,071.573	1,118.635	67,351,190.208
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	-514,012.649	0	0	0	0	0	0	0	-514,012.649	0	-514,012.649
<b>Ajustes retrospectivos por correcciones de errores</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Saldo ajustado</b>	10,457,688.673	0	1,117,363.364	0	7,059,716.497	48,060,344.788	-111,037.893	379,290.776	0	-127,307.281	0	0	0	66,836,058.924	1,118.635	66,837,177.559
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	213,277.129	0	1,118,213.173	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,331,490.302	0	1,331,490.302
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	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Total</b>	213,277.129	0	1,118,213.173	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,331,490.302	0	1,331,490.302
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	941,764.504	-941,764.504	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	6,311,164.570	0	0	0	0	0	0	0	6,311,164.570	51,914	6,311,216.484
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-156,604.458	557,444.163	0	9,936.254	0	0	0	410,775.959	0	410,775.959
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-156,604.458	0	0	0	0	0	0	-156,604.458	0	-156,604.458
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	557,444.163	0	0	0	0	0	557,444.163	0	557,444.163
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	9,936.254	0	0	0	9,936.254	0	9,936.254
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	38,944	38,944	0	38,944
<b>Total</b>	0	0	0	0	0	6,311,164.570	-156,604.458	557,444.163	0	9,936.254	0	0	38,944	6,721,979.473	51,914	6,722,031.387
<b>Saldo al final del periodo</b>	10,670,965.802	0	2,235,576.537	0	8,001,481.001	53,429,744.854	-267,642.351	936,734.939	0	-117,371.027	0	0	38,944	74,889,528.699	1,170.549	74,890,699.248

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 1 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Scotiabank Inverlat

Scotiabank-Indicadores FinancierosT1 2022T2 2022

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)20.0%15.7%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)2.1%1.7%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)4.7%3.6%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 2 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio) 2.7% 2.3%

## Índice de Morosidad

(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre) 3.7% 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.) 96.4% 95.2%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito 19.87% 20.70%\*

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional) 16.41% 16.50%\*

## Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos) 42.0% 45.9%

\* Sujeto a aprobación del Banco Central.

3 meses 6 meses

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar

2022 30 jun

2022T/T

Δ% 30 jun

2022

Ingresos por intereses 12,030 13,144 9% 25,174

Gastos por intereses (6,045) (6,984) -16% (13,029)

Margen Financiero 5,985 6,160 3% 12,145

Comisiones 1,002 1,023 2% 2,025

Resultado por Intermediación 379 464 22% 843

OI OE 135 178 32% 313

Ingresos no Financieros 1,516 1,665 10% 3,181

Total Ingresos 7,501 7,825 4% 15,326

Gastos de Administración y Promoción (4,474) (3,870) 14% (8,344)

PTPP 3,027 3,955 31% 6,982

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios 1,430 (391) > -100% 1,039

Resultado de la Operación 4,457 3,564 -20% 8,021

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

Controladora - 58 0% 58

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 4,457 3,622 -19% 8,079

Impuestos a la Utilidad (1,008) (760) 25% (1,768)

Resultado Neto 3,449 2,862 -17% 6,311

## Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender (49) (108) > -100% (157)

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 357  
201 -44% 558

Remediación de beneficios definidos a los empleados (4) 14 > +100% 10

Resultado Integral 3,753 2,969 -21% 6,722

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

La utilidad neta del segundo trimestre de 2022 se ubicó en \$2,862 millones, una disminución de \$835 millones o 17% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en la cartera; compensados parcialmente con una optimización en gastos de personal, menores impuestos a la utilidad, mayores ingresos no financieros, así como un mayor margen financiero.

La utilidad neta acumulada al cierre de junio de 2022 se ubicó en \$6,311 millones; la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 3 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

cual se integra principalmente por ingresos en margen financiero e ingresos no financieros, así como por liberación de reservas en la cartera; compensados parcialmente por gastos de administración y promoción e impuestos a la utilidad.

Ingresos no Financieros

3 meses6 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%30 jun

2022

Actividades Fiduciarias 65 53 -18% 118

Apertura de Cuenta 4 4 0% 8

Cartas de Crédito sin Refinanciamiento 57 50 -12% 107

Cheques Certificados 1 - -100% 1

Cheques de caja- 1 0% 1

Compraventa de instrumentos financieros- 1 0% 1

Manejo de Cuenta 83 89 7% 172

Operaciones de Crédito 391 391 0% 782

Otras Comisiones y Tarifas 330 361 9% 691

Servicios de Banca Electrónica 44 45 2% 89

Transferencia de Fondos 27 28 4% 55

Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,002 1,023 2% 2,025

3 meses6 meses

Scotiabank -Otros Ingresos/Egresos de la Operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%30 jun

2022

Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(14) (17) -21%(31)

Aportaciones al IPAB(502) (492)2%(994)

Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 83 49 -41% 132

Estimación por Pérdida de Valor de Bienes Adjudicados(4) (4)0%(8)

Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito- 1 0% 1

Ingresos por Arrendamiento 72 (61)> -100% 11

Intereses a favor Provenientes de Préstamos a Funcionarios y Empleados 29 32 10% 61

Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 851 730 -14% 1,581

Quebrantos(405) (71)82%(476)

Recuperaciones 3 3 0% 6

Resultado en Venta de Bienes Adjudicados 22 8 -64% 30

Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 135 178 32% 313

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses6 meses

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%30 jun

2022

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios1,430(391)> -100%1,039

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 4 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

En el segundo trimestre de 2022, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios se ubicó en \$391 millones, un incremento de \$1,821 millones respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos de reservas en la cartera total.

La Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios acumulada al cierre de junio de 2022 mostró un beneficio de \$1,039 millones, integrado principalmente por menores requerimientos de reservas en la cartera comercial y consumo; compensada parcialmente por mayores requerimientos de reservas en la cartera hipotecaria, tarjeta de crédito y automotriz.

Gastos de Administración y Promoción

3 meses 6 meses

Gastos de Administración y Promoción

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%30 jun

2022

Gastos de Personal (2,402) (1,773) 26% (4,175)

Gastos de Operación (2,072) (2,097) -1% (4,169)

Total de Gastos de Administración y Promoción (4,474) (3,870) 14% (8,344)

Impuestos a la Utilidad

3 meses 6 meses

Scotiabank-Impuestos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%30 jun

2022

Impuesto a la Utilidad Causado (622) (807) -30% (1,429)

Impuesto a la Utilidad Diferido (386) 47 > +100% (339)

Total de Impuestos a la Utilidad (1,008) (760) 25% (1,768)

En el segundo trimestre de 2022, el total de impuestos netos se ubicó en \$760 millones, una disminución de \$248 millones o 25% respecto al trimestre anterior, principalmente por una menor utilidad en el periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de junio 2022 ascendieron a \$1,768 millones, lo que representa una tasa efectiva del periodo de 21.9% principalmente por la Inflación del periodo.

Balance General

Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 183,564 228,718 25%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 426,349 443,593 4%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 16,180 16,428 2%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,599) (15,648) 0%

Otros Activos 42,974 47,430 10%

Total Activo 653,468 720,521 10%

Depósitos 429,019 439,729 2%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 5 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	41,936	41,855	0%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,096	9,052	0%
Otros Pasivos	102,826	154,994	51%
Capital	70,591	74,891	6%
Total Pasivo y Capital	653,468	720,521	10%

Al 30 de junio de 2022, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$720,521 millones, un incremento de \$67,053 millones o 10% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en inversiones en instrumentos financieros en valores gubernamentales (negociables y por cobrar o vender), cartera de crédito con riesgo de crédito (etapa 1 y 2 de comercial y vivienda), un mayor volumen en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico), así como deudores por liquidación de operaciones (en Otros Activos).

El total del pasivo ascendió a \$645,630 millones al 30 de junio de 2022, un incremento de \$62,753 millones o 11% respecto al trimestre anterior. Debido principalmente a mayores volúmenes en Otros Pasivos (acreedores por reporto, valores asignados por liquidar, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones); así como por mayores volúmenes en depósitos.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

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

202230 jun

2022T/T

Δ%

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,150	34,313	0%
---	--------	--------	----

Créditos a la Vivienda	169,766	176,249	4%
------------------------	---------	---------	----

Total Préstamos de Menudeo	203,916	210,562	3%
----------------------------	---------	---------	----

Actividad Empresarial o Comercial	185,275	197,079	6%
-----------------------------------	---------	---------	----

Entidades Financieras	17,720	19,869	12%
-----------------------	--------	--------	-----

Entidades Gubernamentales	19,438	16,083	-17%
---------------------------	--------	--------	------

Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	222,433	233,031	5%
---	---------	---------	----

Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	426,349	443,593	4%
--	---------	---------	----

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de junio de 2022 se ubicaron en \$233,031 millones, un incremento de \$10,598 millones o 5% respecto al trimestre anterior, debido principalmente por créditos de actividad empresarial o comercial.

El total de préstamos de menudeo al 30 de junio de 2022 se ubicó en \$210,562 millones, un incremento de \$6,646 millones o 3% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a créditos a la vivienda.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

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

202230 jun

2022T/T

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	16,180	16,428	2%
--	--------	--------	----

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,599)	(15,648)	0%
---	----------	----

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	581	780	34%
---	-----	-----	-----

Índice de morosidad	3.7%	3.6%	-9 pb
---------------------	------	------	-------

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 6 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Al 30 de junio de 2022 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 se ubicó en \$16,428 millones, un incremento de \$248 millones o 2% respecto al trimestre anterior.

Al 30 de junio de 2022 la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,648 millones, un incremento de \$49 millones respecto al trimestre anterior.

Al 30 de junio de 2022, el índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 95.3%, menor al 96.4% respecto al cierre del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 30 de junio de 2022 fue de 3.6%, una disminución de 9pb respecto al trimestre anterior.

## Depósitos

### Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 31 mar

202230 jun

2022T/T

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 216,843 221,199 2%

    Público en General 187,317 192,935 3%

    Mercado de Dinero 2,302 2,305 0%

Total Depósitos a Plazo 189,619 195,240 3%

Títulos de Crédito Emitidos 21,676 22,355 3%

Cuenta global de captación sin movimientos 881 935 6%

Total de Depósitos 429,019 439,729 2%

Al 30 de junio de 2022, el total de depósitos se ubicó en \$439,729 millones, un incremento de \$10,710 millones o 2% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores depósitos a plazo de público en general por \$5,618 millones o 3%, así como depósitos a la vista y ahorro por \$4,356 millones o 2%.

### Scotiabank

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

(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

EmisorTítulos TasaPlazoImporte

I-BANSAN-22295 11,970,805,0366.40%2811,914

### Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

(millones de pesos al 30 de junio de 2022 valor razonable)

CategoríaDeuda GubernamentalDeuda BancariaInstrumentos de Patrimonio netoOtros títulos de deudaTotal

Instrumentos financieros negociables 69,264 1,179 39 - 70,482

Sin restricción:- - - - -

Restringidos: 69,264 1,179 39 - 70,482

    En operaciones de reporto 58,578 1,179 39 - 59,796

    Préstamos de valores 241 - - 241

    Otros 10,445 - - 10,445

Instrumentos financieros para cobrar o vender 47,018 16,881 - 1,330 65,229

Sin restricción: 32,283 16,881 - 1,330 50,494

Restringidos: 14,735 - - 14,735

    En operaciones de reporto 13,008 - - 13,008

    Otros 1,727 - - 1,727

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés 5,206 - - 5,206

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 7 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Sin restricción 5,206 - - - 5,206  
 Total 121,488,181,060,391,330,140,917

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados  
 (millones de pesos al 30 de junio de 2022; valor razonable)  
 Contratos Adelantados Futuros Opciones Operaciones Estructuradas Swaps Paquetes de  
 Instrumentos Derivados  
 Total activo Total  
 pasivo  
 Posición Posición Posición Posición Posición Posición  
 Con fines de: Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva  
 Pasiva  
 Negociación 1,348,106 -- 1,490,107 152,667 426,792 26,950 -- 30,156 29,757  
 Cobertura ----- 6,298,368 -- 6,298,368

Scotiabank-Montos nacionales en operaciones derivadas  
 (Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de junio de 2022)  
 Contratos adelantados Futuros Operaciones Estructuradas Opciones Swaps Paquetes de  
 instrumentos Derivados  
 Posición Posición Posición Posición Posición Posición  
 Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva  
 Con fines de negociación  
 Posición USD 1,860,148 -----  
 Posición EUR 22  
 Divisas USD ---- 121,240,540 ----  
 Divisas EUR  
 Divisas MXN ----- 110,110 ----  
 Acciones MXN ---- 74,351,311,053 52 ----  
 Índices MXN ---- 3,787,789 ----  
 Tasa de interés  
 Pesos ----- 28,417 27,741 356,631 358,407 --  
 Dólares ----- 340 339,134 81,654 --  
 Euros ----- 23 --  
 Pesos Colombianos ----- 177,500 ---  
 Con fines de cobertura  
 Tasa de interés  
 Pesos ----- 39,015 ---  
 Dólares ----- 451 ---  
 Euros -----

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1  
 (millones de pesos al 30 de junio de 2022) Pesos Dólares Total  
 Actividad empresarial o comercial 158,333 38,257 196,590  
 Créditos a entidades financieras 19,654 18 19,672  
 Créditos a entidades gubernamentales 16,061 - 16,061  
 Créditos al consumo 33,685 - 33,685  
 Créditos a la vivienda 173,735 15 173,750  
 Total 401,468 38,290 439,758

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2  
 (millones de pesos al 30 de junio de 2022) Pesos Dólares Total  
 Actividad empresarial o comercial 289 200 489  
 Créditos a entidades financieras 197 - 197  
 Créditos a entidades gubernamentales 22 - 22  
 Créditos al consumo 628 - 628  
 Créditos a la vivienda 2,493 6 2,499

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 8 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Total 3,629 206 3,835

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022) Pesos Dólares Total  
Actividad empresarial o comercial 6,149 1,698 7,847  
Créditos a entidades financieras 91 - 91  
Créditos a entidades gubernamentales 86 - 86  
Créditos al consumo 967 - 967  
Créditos a la vivienda 7,395 42 7,437  
Total 14,688 1,740 16,428

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3  
(millones de pesos)  
Saldo al 31 de marzo de 2022 16,180  
Reestructuras 60  
Recuperaciones (184)  
Castigos y quitas (530)  
Trasposos de y a Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 883  
Fluctuación de tipo de cambio 19  
Saldo al 30 de junio de 2022 16,428

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios  
(millones de pesos)  
Saldo al 31 de marzo de 2022 15,599  
Más: Creación de reservas -  
Calificación 497  
Menos: Liberaciones -  
Cancelaciones -  
Adjudicaciones y otros 9  
Castigos y quitas 521  
Comercial 19  
Hipotecario 47  
Consumo 455  
Fusión CF (63)  
Desliz cambiario (19)  
Saldo al 30 de junio de 2022 15,648

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito 31 mar 2022 30 jun 2022

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Metropolitano	56.1%	57.7%
Noroeste - Centro	12.1%	12.1%
Norte	15.7%	14.8%
Bajío	9.7%	9.2%
Sur	6.4%	6.2%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Metropolitano	40.5%	39.5%
Noroeste - Centro	18.0%	17.8%
Norte	8.1%	8.3%
Bajío	17.0%	16.6%
Sur	16.3%	17.8%

Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 9 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

No. Acreditados / GruposMonto% Capital Básico

112,46819.47%

28,24812.88%

36,43910.05%

Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos 27,155

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia

Al 30 de junio de 2022

(millones de pesos)

Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias

Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas

No RevolventesTarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes

Exceptuada calificada

Riesgo A1 411,854 1,035 109 606 285 2,035

Riesgo A2 27,252 245 30 183 12 470

Riesgo B1 9,568 105 45 57 12 219

Riesgo B2 9,505 86 52 35 56 229

Riesgo B3 5,654 62 16 39 53 170

Riesgo C1 3,076 21 26 73 53 173

Riesgo C2 3,248 16 31 140 207 394

Riesgo D 5,666 339 52 279 1,020 1,690

Riesgo E 11,536 5,932 746 325 1,451 8,454

Total 487,359 7,841 1,107 1,737 3,149 13,834

Exceso1,814

Reservas Constituidas 15,648

## 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 2022.

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 10 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	
-		
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		
25		
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		26
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		1,763
<b>Total</b>	<b>\$ 1,814</b>	

Terminación anticipada de los programas hipotecarios

El 15 y 26 de julio de 2010, se firmó el convenio y se dieron a conocer a través del Diario Oficial de la Federación las Disposiciones de carácter general aplicables en la terminación anticipada a los programas de apoyo para deudores de créditos de vivienda.

Por los descuentos a cargo del Gobierno Federal se reconoció un crédito con vigencia de cinco años pagaderos anualmente, dentro del rubro "Créditos comerciales - Entidades Gubernamentales" formando parte de la cartera de crédito vigente hasta el año 2015.

El Banco recibió hasta el año 2015 cinco pagos anuales por \$366 (\$330 de capital y \$36 de intereses) sobre los descuentos a cargo del Gobierno Federal al amparo del convenio.

Asimismo, los Cetes Especiales que al 30 de junio de 2022 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros - Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

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

Títulos	Importe	Vencimiento
B4	2207073,961,831	54907-jul-22
B4	22080421,792	304-ago-22
B4	27070111,209,686	1,55301-jul-27
BC	220804 3,115	-04-ago-22
BV	2707016-01	-jul-27
<b>Total</b>	<b>15,196,430</b>	<b>2,105</b>

Tasa Promedio

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional	(millones de pesos al 30 de junio de 2022)	Pesos	Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	3.19%	0.35%	-	-
Depósitos a plazo	6.19%	0.00%	-	-

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Vencimiento	Préstamos	Financiamiento	Total
Banca			
Múltiple	Banco de		
México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos
Pesos			
Inmediato	-----		
Mediano	1,182	5,993	3,244 - 10,419

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 11 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Largo-- 16,000 6040 - 22,040  
Total- 1,182 21,993 9,284 - 32,459  
Tasa Promedio0.00%7.75%8.79%7.15%0.00%  
Otros  
Inmediato-----  
Mediano 7,051 - 7 249 10 7,317  
Largo - - - 65 2,014 2,079  
Total 7,051 - 7 314 2,024 9,396  
Tasa Promedio0.31%0.00%3.04%1.83%1.03%  
Total Préstamos Interbancarios7,0511,18222,0009,5982,02441,855

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 2022.

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

31 mar

202230 jun

2022

Depósitos a la Vista53.4%53.2%

Metropolitano21.8%22.5%

Noroeste - Centro11.4%11.4%

Norte8.3%7.6%

Bajío6.1%6.0%

Sur5.8%5.7%

Depósitos Ventanilla46.0%46.2%

Metropolitano18.7%18.0%

Noroeste - Centro6.9%5.8%

Norte9.2%9.4%

Bajío5.6%6.8%

Sur5.6%6.2%

Total de Captación del Público99.4%99.4%

Fondeo Profesional0.6%0.6%

Scotiabank-Impuestos y PTU Diferidos  
(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Perdida de arrastre fiscal 18

Provisión por perdidas de crédito 4,404

Compensación diferida (1,127)

Ingresos diferidos 534

Instalaciones y equipos / depreciación 316

Beneficios a los empleados 563

Provisiones 1,372

Otros (405)

Efecto Neto en Diferido5,675

Al 30 de junio de 2022, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos) 30 junio

2022

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable (124)

Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 12 / 82  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

financieros(7)  
Resultado por valuación de divisas(19)  
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros  
derivados149  
Resultado por compraventa de divisas465  
Costos de transacción-  
Total 464

## Emisión de Certificados Bursátiles

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

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

\* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

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

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

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo (días)	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MX0QSC1N00163	6402	093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MX0QSC1N00245	4603	360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MX0QSC1N0032-3	455,000,000	11.3	
Total de Obligaciones Subordinadas					8,908,000,000

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 13 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## 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	13-19	658,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096 MSFDVTHY INDEX	65,820,000
99-SCOTIAB	05-20	1,930,500	19-feb-2017	19-feb-23	1,094 MSFDVTIG IDEX	193,050,000
99-SCOTIAB	06-20	6,471,910	27-mar-2027	27-mar-23	1,095 MSFDVTIG IDEX	647,191,000
99-SCOTIAB	07-20	7,324,700	14-may-2012	14-may-23	1,093 SPXSRT5E INDEX	732,470,000
99-SCOTIAB	08-20	415,850	11-jun-2009	11-jun-23	1,093 SPXSRT5E INDEX	41,585,000
99-SCOTIAB	01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540 SPDR Fund (XLE)	23,884,500
99-SCOTIAB	02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540 SPDR Fund (XLF)	21,284,500
99-SCOTIAB	03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540 SPDR Fund (XLE)	184,522,000
99-SCOTIAB	04-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080 Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99-SCOTIAB	05-21	4,926,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093 Index (IDBTVER)	492,650,000
99-SCOTIAB	06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093 Index (IDBTVER)	57,230,000
83-SCOTIAB	07-21	1,526,000	11-ago-21	04-ago-22	358 MSFDVTHY Index	152,600,000
99-SCOTIAB	08-21	809,300	12-ago-21	10-ago-23	728 Index (IDBTVER)	80,930,000
99-SCOTIAB	09-21	3,950,200	25-nov-21	22-nov-24	1,093 Index (BNPIUIL5)	395,020,000
99-SCOTIAB	10-21	3,848,100	25-nov-21	22-nov-24	1,093 Index (BNPIUIL5)	384,810,000
99-SCOTIAB	11-21	1,105,530	07-dic-21	01-jun-23	541 MSCI ETF (EZU)	110,553,000
99-SCOTIAB	01-22	543,200	28-feb-22	25-feb-25	1,093 MSFDVTHY Index	54,320,000
99-SCOTIAB	02-22	545,100	28-feb-22	27-feb-24	729 Invesco QQQ Series 1	54,510,000
99-SCOTIAB	03-22	369,750	08-mar-22	05-sep-23	546 iShares MSCI China ETF	36,975,000
99-SCOTIAB	04-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547 SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99-SCOTIAB	05-22	1,255,860	15-jun-22	13-jun-25	1,094 MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	125,586,000
99-SCOTIAB	06-22	1,838,000	15-jun-22	13-jun-25	1,094 MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	183,800,000
99-SCOTIAB	07-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1,093 MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99-SCOTIAB	08-22	1,030,150	16-jun-22	13-jun-25	1,093 MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	103,015,000
99-SCOTIAB	09-22	495,000	23-jun-22	22-dic-23	547 Dólar - Peso (USDMXN)	49,500,000
99-SCOTIAB	10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547 Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
Total Bonos Bancarios al 30 de junio de 2022						4,410,020,000

## Capitalización

Scotiabank

Integración del Capital

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

(millones de pesos al 30 de junio de 2022)

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

1 Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 12,907

2 Resultado de ejercicios anteriores 47,119

3 Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 14,864

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 14 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

(monto permitido en el capital común de nivel 1) No aplica  
6Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 74,890  
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios  
7Ajustes por valuación prudencial No aplica  
8Crédito mercantil  
(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -  
9Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)-  
10 conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)1,509  
11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo-  
12 Reservas 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)-  
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 nacionales8,739  
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 8  
H del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia -  
I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones -  
J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 8,036  
K del cual: Posiciones en Esquemas de Primera Pérdidas -  
L del cual: Participación de los Trabajadores en las Utilidades Diferidas -  
M del cual: Personas Relacionadas Relevantes -  
N del cual: Plan de pensiones por beneficios definidos -  
OSe Deroga -  
P del cual: Inversiones en cámaras de compensación 695  
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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 15 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

deducciones -

28 Ajustes regulatorios totales al capital común 10,248

29 Capital común de nivel 1 (CET1) 64,642

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30 Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,580

31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,580

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 3,580

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

37 conservador Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica

38 conservador Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica

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

40 conservador Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido No aplica

41 Ajustes regulatorios nacionales -

42 Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones No aplica

43 Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -

44 Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,580

45 Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 68,222

Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

46 Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 4,210

47 Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2 -

48 Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2) No aplica

49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica

50 conservador Reservas 1,750

51 Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 5,961

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 16 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

(monto que excede el umbral del 10%)No aplica

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

56 Ajustes regulatorios nacionales-

57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2-

58Capital de nivel 2 (T2) 5,961

59Capital total (TC = T1 + T2) 74,183

60Activos ponderados por riesgo totales 449,638

Razones de capital y suplementos

61Capital Común de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)14.38%

62Capital de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.17%

63Capital Total  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.50%

64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)17.48%

65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%

66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%

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

68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)7.38%

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) 1,750

77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,263

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

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

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

80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradualNo aplica

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 17 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 remediones 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 conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.

12 conservadorReservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

---

Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.

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

14 No aplica.

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

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

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

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

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

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

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

19 conservador

Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 19 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

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

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

21 El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.

22 No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.

23 No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

24 No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

25 No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.

26 Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.

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

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

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

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

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 20 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

las presentes disposiciones.

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

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

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

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

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

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

MM. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

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

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

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

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

29Renglón 6 menos el renglón 28.

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

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

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

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

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

35No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

36Suma de los renglones 30, 33 y 34.

37 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

38 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 21 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 22 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 2022)

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

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de Efectivo 53,235

BG2Cuentas de Margen 811

BG3Inversiones en Instrumentos Financieros 140,917

BG4Deudores por reporto 679

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 23 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BG5Préstamo de valores -  
BG6Instrumentos Financieros Derivados 36,454  
BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(1,256)  
BG8Total de cartera de crédito (neto) 444,373  
BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -  
BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 24,709  
BG11Bienes adjudicados (neto) 197  
BG12Propiedades, mobiliario y equipo (neto) 1,994  
BG13Inversiones permanentes 3,511  
BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los  
propietarios 17  
BG15Activo por impuestos a la utilidad diferidos 5,681  
BG16Pagos Anticipados y Otros activos (neto) 5,090  
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,529  
Activos Intangibles (neto) 4,624  
Pasivo  
BG17Captación tradicional 439,860  
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 41,855  
Valores asignados por liquidar 11,262  
BG19Acreedores por reporto 72,761  
BG20Préstamo de valores -  
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 222  
BG22Instrumentos Financieros Derivados 33,365  
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros 5  
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -  
BG25Otras cuentas por pagar 29,238  
BG26Obligaciones subordinadas en circulación -  
BG27Pasivo por impuesto a la utilidad 1,398  
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,489  
Pasivos por arrendamiento 1,586  
Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,052  
Pasivos por Beneficio a los Empleados 5,582  
Capital contable  
BG29Capital contribuido 12,907  
BG30Capital ganado 61,983  
Cuentas de orden  
BG31Avales otorgados -  
BG32Activos y pasivos contingentes -  
BG33Compromisos crediticios 255,676  
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 421,606  
BG35Agente financiero del gobierno federal -  
BG36Bienes en custodia o en administración 57,829  
BG37Colaterales recibidos por la entidad 11,123  
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad -  
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -  
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida 1,133  
BG41Otras cuentas de registro 1,650,592

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 2022)

IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del  
Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del  
apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos  
regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital NetoReferencia

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 24 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

(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 1,509 BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1,509

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13-

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e  
ilimitado15-

6Inversiones en acciones de la propia institución16-

7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17-

8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18-

9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18-

10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución  
posea más del 10% del capital social emitido19-

11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución  
posea más del 10% del capital social emitido19-

12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21-

13Reservas reconocidas como capital complementario50 1,750 BG 8 Total de cartera de  
crédito (neto) \$1,750

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 8 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 8

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -

20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 8,036 BG 16 Activos Intangibles \$4,625 más  
Gastos de Instalación \$3,411

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

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

23Inversiones en cámara de compensación26-P 695 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 695  
PASIVO

24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil8 -

25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles9 -

26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado15 -

27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por  
beneficios definidos15

28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los  
anteriores21 -

29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R31 3,580 BG 26

Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,580

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

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 4,210 BG 26

Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,210

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 12,907 BG 29 Capital Social \$10,671  
más Prima en Venta de Acciones \$2,236

35Resultado de ejercicios anteriores2 47,119 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 25 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

\$47,119

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3 937 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$937

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 13,928 BG 30 Reservas de Capital \$8,001 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$268) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$117) más Resultado Neto \$6,311

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

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

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

41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -

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

CUENTAS DE ORDEN

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -

CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERALIdentificador

44Reservas pendientes de constituir12 -

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

46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -

47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -

48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

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

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

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

6Cualquier acción propia que la Institución 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 26 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 27 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

- 
- 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 2022)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo

Importe de posiciones equivalentesRequerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 50,428 4,034

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,811 145

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's 3,346 268

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

Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC 56 5

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

Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 2,873 230

Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 2,217 177

Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones 873 70

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 28 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	11	1
Requerimiento de capital por impacto Vega	26	2
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	
Requerimiento de capital		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	36	3
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	575	46
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,659	293
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	2	0
Grupo III (ponderados al 50%)	511	41
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	3,424	274
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	180	14
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	938	75
Grupo VI (ponderados al 20%)	1,604	128
Grupo VI (ponderados al 25%)	1,108	89
Grupo VI (ponderados al 30%)	4,201	336
Grupo VI (ponderados al 40%)	4,606	368
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,253	3,060
Grupo VI (ponderados al 70%)	33	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	19,503	1,560
Grupo VI (ponderados al 85%)	586	47
Grupo VI (ponderados al 100%)	69,889	5,591
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%)	155	12
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	14,060	1,125
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	25	2
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	12,047	964



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 29 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	150,598	12,048
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	27	2
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,527	122
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%)	1,008	81
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	5,684	455
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,029	242
Grupo IX (ponderados al 100%)	17,913	1,433
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,025	242
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	12	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	71	6

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital

Estándar Alternativo 29,708 2,377

Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses

31,677

## Categoría Capitalización

Al 30 de junio de 2022, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 30 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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 regulatorio12,906,542,339

9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales

9AMoneda 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.

15AEventos regulatorios o fiscalesNo

15BPrecio 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 anticipadaSujeto 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-Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

ReferenciaDescripción

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

23Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

24Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

25Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.

26Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.

27Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.

28Tipo de acciones en las que se convierte el título.

29Emisor del instrumento en el que se convierte el título.

30Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.

31Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.

32Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.

33Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.

34Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.

35Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

Jurisdicción Ponderador Jurisdicción Ponderador Jurisdicción Ponderador

Alemania-Francia-Reino Unido-

Arabia Saudita-Holanda-Rusia-

Argentina-Hong Kong-Singapur-

Australia-India-Sudáfrica-

Bélgica-Indonesia-Suecia-

Brasil-Italia-Suiza-

Canadá-Japón-Turquía-

China-Corea-Otras jurisdicciones diferentes a las anteriores-

España-Luxemburgo-

Estados Unidos-México-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 33 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Scotiabank Inverlat aprobó un aumento de capital social por la cantidad de \$800,000,000.00 (Ochocientos millones de pesos 00/100, M.N.), suscritos y pagados en ese mismo acto por Grupo Financiero Scotiabank Inverlat, con lo cual quedó un capital social suscrito y pagado por una cantidad igual a \$8,853,500,000.00 (ocho mil ochocientos cincuenta y tres millones quinientos mil pesos 00/100) M.N.

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

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

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

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

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

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

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

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

---

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 áreas encaminadas a monitorear y mitigar los riesgos a los que está expuesto el Banco; lo anterior para garantizar una gestión adecuada de riesgos tal que se cumpla con el perfil de riesgo deseado y definido por el Consejo de Administración así como para mejorar la calidad, diversificación y composición de los distintos portafolios, optimizando de esta forma la relación riesgo-rendimiento. La UAIR es también responsable de revisar y presentar para aprobación del Comité de Riesgos y/o del Consejo de Administración las diversas metodologías utilizadas para gestionar los riesgos a los que está expuesta la institución, así como el marco de apetito de riesgo, políticas de gestión para los distintos tipos de riesgo, límites globales y específicos de exposición y niveles de tolerancia al riesgo correspondientes. Asimismo, provee a la Alta Dirección información confiable y oportuna para la toma de decisiones, monitoreo y gestión de las líneas de negocio. Finalmente, la gestión de riesgos está en función de mejores prácticas internacionales pues se cuenta con un marco normativo que cumple con la regulación local y con estándares y lineamientos corporativos establecidos por BNS.

#### Riesgo de mercado

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

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

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

La estructura de límites de riesgo de mercado contempla montos volumétricos o nocionales de valor en riesgo (VaR), de sensibilidad, de concentración, límites de estrés y de plazo, entre otros. Para el cálculo del VaR se utiliza la metodología de simulación histórica con 300 días. La política del Grupo Financiero para el cálculo del VaR usa como referencia un 99% de nivel de confianza y un día como período de tiempo. El VaR global de un día para el Banco al cierre del 30 de junio de 2022 fue de \$16.82 y su promedio durante el segundo trimestre de 2022 fue de \$12.6 mismo que corresponde a un 0.017% del capital neto (\$72,274 a mayo 2022, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del segundo trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos) Cierre junio 2022 Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados 896,002 852,169

Mercado de Dinero 58,011 55,991

Tipo de cambio

Cash 129 160

Derivados 119,812 150,020

Capitales

Derivados 21,680 19,587

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 35 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

VaR 1 día (millones de pesos) Cierre junio 2022 (Promedio)

Factor de Riesgo

Tasas de interés 16.4012.59

Tipo de cambio 1.321.35

Capitales 0.03-

VaR Global 16.8212.60

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 2022 muestra una pérdida máxima de \$190.47. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, Mexico 1994 por el denominado "Error de diciembre" y Mexico 1997 por el efecto de la "crisis del Rublo" y la crisis financiera asiática.

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

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos 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 2022 así como el promedio del segundo trimestre de 2022 se muestran a continuación:

Scotiabank Posición	Posición
(millones de pesos)	(Cierre) (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	61,13453,469
Liquidity Buffer	
(bajo métrica CCL)	79,16586,605

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 2022 de 136.55% y 112.12% respectivamente.

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

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

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

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 37 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de junio 2022 y en promedio para el segundo trimestre de 2022 es la siguiente:

Scotiabank Posición	Posición	Cierre	Promedio
(millones de pesos)			
Valor Económico (+100 pbs)	(936)	(830)	
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(405)	(409)	

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

Scotiabank Posición	Posición	
(millones de pesos)	Cierre	Promedio
Instrumentos financieros para cobrar o vender	165,229	61,868
Derivados de Cobertura	48,100	48,919

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 2022 y el promedio del segundo trimestre del 2022 fueron \$3,366 y \$3,002, respectivamente.

## Riesgo de crédito

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

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

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

Para la administración del riesgo de crédito, la información se extrae de los diversos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 38 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

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

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

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

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

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

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

Estados y Municipios.

Admisibilidad de garantes que cuenten con calificación global a largo plazo grado de riesgo 1 y 2.

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

---

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

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

La calificación de crédito del garante u obligado se determina de forma continua y consistente durante la vigencia del crédito. Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo trimestre de 2022 corresponde a \$102; 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)

Durante junio 2022, el Banco canceló el remanente de las reservas adicionales por COVID que se constituyeron en 2020.

En junio 2022, el Banco informó a CNBV sobre la necesidad de llevar a cabo el reconocimiento y registro de reservas adicionales debido a que aún persisten los efectos adversos como resultado de la emergencia sanitaria por COVID-19, el cual sigue afectando el entorno económico y financiero, con la finalidad de cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de cartera crediticia. Lo anterior, una vez analizado el portafolio y las características de los créditos a la vivienda (posible deterioro y requerimientos de provisiones conforme a la política interna de castigos) que derivado de la contingencia por COVID-19 recibieron un programa de apoyo y la cartera comercial principalmente en etapa 3 que se vio afectada de manera directa o indirecta por la

---

contingencia por COVID-19 y que en función del tiempo que esta permanezca afectada requerirá mayores reservas.

Con base en lo anterior, el banco constituyó MXN \$1,855MM de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio y mantiene como remanente al cierre del trimestre \$1,750MM.

#### Información metodológica

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

La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias.

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

#### Métricas Riesgo de Crédito

(Cifras al 30 de junio 2022) Pérdida Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.3% 3.2%

Consumo 4.2% 10.6%

Cartera Comercial 0.7% 4.1%

Total 0.8% 4.2%

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

#### Parámetros de Riesgo

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio 2022) EI 2PISP

Hipotecas 176,249 1.61% 18.60%

Consumo 52,634 5.32% 72.07%

Cartera Comercial 271,143 1.95% 45.84%

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 2022.

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito

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

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

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

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

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

Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de junio 2022 y en promedio durante el segundo trimestre de 2022, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.01% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.10% y 0.11% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

---

---

la metodología aprobada por el Comité de Riesgos.

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

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

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

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

#### Riesgo Operacional

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

#### Metodología general

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

#### Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

#### Evaluación de riesgo operacional

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

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

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

#### Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

---

---

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

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

#### Riesgo Legal

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

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

#### Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

#### Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de abril - junio 2022, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$65.9, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de junio 2022 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$297.5, donde \$16.0 corresponden a riesgo operacional y \$281.5 a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

#### Riesgo Tecnológico

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 44 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: marzo 2022 - junio 2022 (T2 2022)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T2 2022	Calculo Consolidado T2 2022	Calculo Consolidado T1 2022
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES			
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	86,463.86	No aplica
110,177.61			
SALIDAS DE EFECTIVO			
2 Financiamiento minorista no garantizado	177,024.94	14,277.22	177,024.94
165,030.13	12,249.16		
3 Financiamiento estable	98,810.66	666,455.80	98,810.66
4 Financiamiento menos estable	78,214.28	7,821.43	78,214.28
5 Financiamiento mayorista no garantizado	200,884.67	771,586.96	200,884.67
218,277.04	480,412.04		
6 Depósitos operacionales	94,657.20	2022,963.96	94,657.20
7 Depósitos no operacionales	106,227.47	48,623.00	106,227.47
8 Deuda no garantizada	-	-	3,516.39
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	211.54	No aplica
412.49			
10 Requerimientos adicionales:	243,044.80	19,925.73	243,044.80
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	6,779.89	5,189.93	6,779.89
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	236,264.91	14,735.81	236,264.91
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	32.14	32.14	32.14
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	1,508.96	1,508.96	1,508.96
518.43			
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	107,542.55	No aplica
117,433.46			
ENTRADAS DE EFECTIVO			
17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	2,209.85	147,912,209.85	2,209.85
10,641.72	12.23		
18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	45,084.63	31,269.27	45,084.63



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 45 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

31,269.2740,943.4730,244.19  
19Otras entradas de efectivo13,229.1113,229.1113,229.1113,229.1112,836.3312,836.33  
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO60,523.5944,646.3060,523.5944,646.3064,421.5243,292.75  
Importe ajustado  
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES No aplica 86,463.86 No aplica 86,463.86 No  
aplica 110,177.61  
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica 62,896.26 No aplica 62,896.26 No aplica  
74,140.72  
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ No aplica136.55No aplica136.55No aplica148.81  
Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando.  
90 días naturales  
Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)  
y la evolución de sus principales componentes.

Durante junio 2022, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes  
(considerando una ventana de tiempo de 30 días):

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$45,934 y depósitos a  
plazo tradicionales por \$36,768, salidas derivadas de la estimación de Look Back  
Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación  
relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la  
institución en 3 niveles por \$1,701 y \$3,336 respectivamente, salidas por compromisos  
crediticios no dispuestos por \$16,497.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$17,402 y por operaciones de call money de \$15,785 y  
vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,943.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$79,165 en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$42,913 en  
títulos de deuda de nivel 1, \$26,854 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 \$7,650 y \$1,748 en títulos de nivel 2.

Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte;  
Cierre de marzo 2022: 132% - cierre de junio 2022: 138% previo (incremento: 600pb) El  
coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 600pb respecto de marzo 2022, esto  
debido principalmente a:

El fondeo tradicional del banco creció en \$6,721, además, fondeo profesional,  
interbancario y externo crecieron en \$434.

En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$9,960 y los depósitos en bancos  
decrementaron en MXN \$855 MM.

Finalmente, los activos líquidos tuvieron un decremento de \$4,637.

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

Evolución de Activos Líquidos T2-2022AbrilMayoJunio  
Efectivo 10%10%10%  
Reservas en el Banco Central34%30%34%  
Nivel 154%58%54%

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 46 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Nivel 2<sup>a</sup> 2% 2% 2%  
Nivel 2B 0% 0% 0%  
Total de Activos Líquidos Ponderados 100% 100% 100%

La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento Abril Mayo Junio

CAPTACION TRADICIONAL  
Depósitos de exigibilidad inmediata 46% 48% 46%  
Depósitos a plazo  
Del público en general 40% 39% 40%  
Mercado de dinero 0% 0% 0%  
Títulos de crédito emitidos 6% 5% 5%  
Cuenta global de captación sin movimientos 0% 0% 0%  
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS  
De exigibilidad inmediata 0% 0% 0%  
De corto plazo 3% 3% 4%  
De largo plazo 5% 5% 5%  
Total 100% 100% 100%

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

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

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

(Cifras en millones de pesos)

## Exposición Potencial Futura (junio 2022)

Con contrato de compensación 3,032  
Sin contrato de compensación 4,589  
Posibles llamadas de margen (junio 2022)  
Colateral en Tránsito 144  
Downgrade (junio 2022)  
Baja calificación 3 niveles 3,366

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de junio 2022

---

es la siguiente:

Posición Cierre

Scotiabank-Exposición en Derivados

(cifras en millones de pesos)

Factor de Riesgo

Tasas de interés 896,002

Tipo de cambio 119,812

Capitales 21,680

Total 1,037,494

El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el segundo trimestre del 2022, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -3.74% al cierre de junio del 2022 y en promedio durante segundo trimestre del 2022 fue de -3.19%

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

I. Información cuantitativa:

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 48 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Concepto Límite MM

Concentración de Depósitos (MXN) 9,000 MXN

Concentración de Depósitos (USD) 150 USD

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

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

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

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

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

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

#### Descripción Promedio T2 2022 Junio 2022

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM)	1,827	2,253	
Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM)	33,061	31,579	
Horizonte de Supervivencia - Banco (días)	40	40	
Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días)	32		32
Horizonte de Supervivencia - Grupo (días)	40	40	
Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días)	32		32

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 2022 y el promedio del segundo trimestre de 2022 son: Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 61,13453,469

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 79,16586,605

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

## II. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 50 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Cálculo de CCL (Coeficiente de Cobertura de Liquidez)  
Cálculo de CFEN (Coeficiente de Financiamiento Estable Neto)  
Cómputo de Activos Líquidos  
Cálculo de LDR (Loan to Deposit Ratio)  
Monitoreo de la concentración de fondeo profesional  
Monitoreo de Brechas de Liquidez  
Monitoreo de Concentración de Depósitos  
Monitoreo de Depósitos con Bancos  
Monitoreo del Portafolio de Inversión  
Monitoreo de créditos cedidos como garantía de fondeo  
Pruebas de Estrés de Liquidez  
Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez  
Reportes periódicos al Comité de Activos y Pasivos de la Institución  
Reportes periódicos al Comité de Riesgos  
Reportes al Consejo de Administración  
Políticas y Manuales alusivos a la Administración del Riesgo de Liquidez  
Plan de Contingencia para Riesgos de Solvencia y Liquidez  
A efectos de mitigar el riesgo de liquidez, el Banco ha establecido lineamientos, políticas y procedimientos prudentes, poniendo particular atención en:  
Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).  
Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones, prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.  
Mantener fuentes diversificadas de fondeo.  
Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.  
Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.  
Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.  
Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.  
El Plan de Financiamiento de Contingencia de Liquidez incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.  
Una explicación de cómo se utilizan las pruebas de estrés; y  
De acuerdo con la norma vigente estipulada en el anexo 12-B de la Circular Única para Bancos, que requiere la realización de ejercicios de liquidez en escenarios de estrés, el banco realiza pruebas de forma periódica esto con la finalidad de cerciorarse de su capacidad para afrontar escenarios adversos y ser capaz de honrar sus obligaciones de corto plazo basados en un horizonte de supervivencia de 30 días.  
Estos escenarios de estrés contemplan entre otros, los siguientes supuestos:  
Aumento en la pérdida esperada de las carteras de crédito  
Aumento en retiro de los depósitos  
Disposición de líneas de crédito  
Aumento en las obligaciones del Banco por degradación de la calificación de la institución.  
Salida de los principales depositantes del Banco  
Pérdida de Valor de Mercado de los Activos Líquidos de la Institución  
Las pruebas de estrés de liquidez de la institución contemplan distintos escenarios (i.e. idiosincrático, sistémico y combinado) con 3 niveles de severidad cada uno. Los resultados de las pruebas de estrés son presentados de manera periódica a los órganos colegiados de la institución.  
Los escenarios de estrés indican una visión sobre las brechas de liquidez, los activos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 51 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.

Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.

Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.

Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.

Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.

Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.

En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de éstas:

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

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

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)  
Periodo Reportado: Segundo trimestre del 2022

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

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

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

Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$160,426 y depósitos a plazo tradicionales por \$129,357, Capital (fundamental y complementario) por \$78,469, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$16,273 y \$6,426

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 52 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$17,164.

Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$316,534 y por operaciones mercado de dinero de \$13,857, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$13,082, deducciones de capital por \$10,223 y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$4,958.

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

Cierre de marzo 2022: 114.6% - cierre de junio 2022: 113.73% (decremento: 84pb) El coeficiente de financiamiento neto decrementó 84pb respecto de marzo 2022, esto debido principalmente a:

El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional ponderado del banco creció en \$2,683, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$9,394.

El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas decrecieron \$3,979, los compromisos crediticios decrementaron en su monto ponderado en \$2,002 y el financiamiento requerido por operación de instrumentos derivados aumentó \$3,909.

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 418,093 412,697 412,361

Financiamiento Estable Requerido 354,101 353,116 362,568

Coeficiente de Fondeo Estable Neto 118.07% 116.87% 113.73%

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 2022 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$20.16 millones de pesos, con una plusvalía de \$0.29 millones de pesos.

Institución Tipo de Cotización Emisora Títulos Importe Valuado Costo Plusvalía / Minusvalía

Scotiabank Pública 1IEWG\* 5,000 2.32 2.35 (0.03)

Scotiabank Pública 1BACHOCOB 69,733 5.05 4.82 0.23

Scotiabank Pública 1EFRES\* 922 0.18 0.22 (0.04)

Scotiabank Pública 1IGDX\* 3,600 1.98 2.03 (0.05)

Scotiabank Pública 1BNAFTRACISHRS 40,000 1.90 2.10 (0.20)

Scotiabank Pública 1NEMAKA 67,922 0.27 0.26 0.01

Scotiabank Pública 41BSMXB 189,293 3.88 4.03 (0.15)

Scotiabank Pública 1IXLC\* 1,700 1.86 1.86 -

Scotiabank Pública 1FEMSAUBD 20,000 2.72 2.78 (0.06)

Total 398,170 20.16 20.45 (0.29)

Al cierre del segundo trimestre del año 2022, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$4.19 millones de pesos.



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 53 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	80,925	0.09	(0.01)	0.08
Scotiabank	Pública	1A-GM-*	7,700	0.09	(0.10)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-GMEXICO-B	34,077	0.07	(0.02)	0.05
Scotiabank	Pública	1-KIMBER-A	635,929	0.56	(0.15)	0.41
Scotiabank	Pública	1I-GLD-*	500	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I-EWG-*	20,111	0.26	(0.06)	0.20
Scotiabank	Pública	1-BACHOCO-B	164,987	0.17	(0.15)	0.02
Scotiabank	Pública	1-PE&OLES-*	84,606	0.44	(0.17)	0.27
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	10,300	0.34	(0.03)	0.31
Scotiabank	Pública	1A-TX-*	4,400	0.33	-	0.33
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	6,268	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	1,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	5,600	0.05	(0.09)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-CHDRAUI-B	10,980	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	7,710	0.18	(0.07)	0.11
Scotiabank	Pública	1I-OIH-*	900	0.35	-	0.35
Scotiabank	Pública	1A-FB-*	4,414	0.56	(0.32)	0.24
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	20,840	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	2,087,817	0.23	(0.17)	0.06
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	270,155	0.06	(0.15)	(0.09)
Scotiabank	Pública	1I-XLC-*	8,841	0.12	(0.16)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	166,294	0.53	(0.43)	0.10
Scotiabank	Pública	1-KOF-UBL	38,917	0.15	-	0.15
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	3,407	0.04	(0.02)	0.02
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	487,515	0.19	(0.03)	0.16
Scotiabank	Pública	1-AMX-L	864,556	0.41	(0.02)	0.39
Scotiabank	Pública	1-CEMEX-CPO	3,448,580	1.38	(0.28)	1.10
Total			8,477,329	6.65	(2.46)	4.19

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 COM8,095	---	---	---	---	---
Total			9,317	---	---	---	---

Al 31 de junio, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$69.87 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$48.55 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$21.32 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	P	O	S	I	C	I	O	N	E	S	Coeficiente de Riesgo de mercado
Requerimiento de capital											
Total Larga	Total	Corta	Valor	Absoluto	de la	posición					
Por Riesgo General	de Mercado	24.04	242.43	218.39	22.23%	48.55					
Por riesgo específico											
Canasta de acciones,	15.35	18.17	33.53	8.00%	2.68						
Índices accionarios	8.68	224.26	232.94	4.00%	9.32						
Requerimiento por riesgos específicos	8.68	224.26	232.94	4.00%	9.32						

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 54 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Total Requerimiento de capital 69.87

Anexo 1-0 Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

REFERENCIARUBROmar-22Jun-22

Exposiciones dentro del balance

1 Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 622,247 685,432

2 (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,029) (10,248)

3 Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 612,217 675,184

Exposiciones a instrumentos financieros derivados

4 Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) 5,839 7,531

5 Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 3,789 3,659

6 Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo

7 (Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) (1,741) (1,663)

8 (Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)

9 Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos

10 (Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)

11 Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 7,887 9,527

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12 Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 3,187 679

13 (Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (1,513) (679)

14 Exposición Riesgo de Contraparte por SFT -

15 Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros -

16 Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 1,674 -

Otras exposiciones fuera de balance

17 Exposición fuera de balance (importe nocional bruto) 276,825 231,456

18 (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (177,660) (154,468)

19 Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 99,164 76,988

Capital y exposiciones totales

20 Capital de Nivel 1 64,042 68,222

21 Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 720,944 761,699

Coefficiente de apalancamiento

22 Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 8.88% 8.96%

Cifras en millones de pesos

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 55 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

REFERENCIADESCRIPCIONMar-22Jun-22

1Activos totales 655,507 722,565

2Ajuste por inversiones en el capital de entidades bancarias, financieras, aseguradoras o comerciales que se consolidan a efectos contables, pero quedan fuera del ámbito de consolidación regulatoria(665) (703)

3Ajuste relativo a activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento

4Ajuste por instrumentos financieros derivados(22,186) (26,927)

5Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores(1,513) (679)

6Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 99,164 76,988

7Otros ajustes(9,364) (9,545)

8Exposición del coeficiente de apalancamiento 720,944 761,699

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

REFERENCIADESCRIPCIONMar-22Jun-22

1Activos totales 655,507 722,565

2Operaciones en instrumentos financieros derivados(30,073) (36,454)

3Operaciones en reporto y prestamos de valores(3,187) (679)

4Activos fiduciarios reconocidos en el balance conforme al marco contable, pero excluidos de la medida de la exposición del coeficiente de apalancamiento

5Exposiciones dentro del Balance 622,247 685,432

TABLA IV.1

PRINCIPALES CAUSAS DE LAS VARIACIONES MÁS IMPORTANTES DE LOS ELEMENTOS

(NUMERADOR Y DENOMINADOR) DE LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

CONCEPTO/PERIODOMar-22Jun-22Variación

Capital Básico 1/ 64,042 68,222 6.5%

Activos Ajustados 2/ 720,944 761,699 5.7%

Razón de Apalancamiento 3/8.88%8.96%0.8%

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 2022.

El indicador se ubicó en 8.96%, 8pb superior respecto al trimestre anterior, debido principalmente a la mejora en el capital de nivel 1 por \$4,180 millones (+55 pb); compensada con el incremento en las exposiciones totales por \$40,755 millones (-47pb).

El Capital de Nivel 1 mostró un incremento trimestral de \$4,180 millones (+55pb), debido principalmente al resultado neto del periodo y a las fusiones llevadas a cabo en junio 2022.

La variación de -47pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente al incremento en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$62,967 millones (-69pb); compensada parcialmente con la disminución en las partidas fuera del balance por \$22,167 millones (+26pb).

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 56 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.

2Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.

5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.

En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.

8No aplica.

9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

de operaciones de reporto y préstamo de valores. El importe no deberá considerar ninguna compensación conforme a los Criterios Contables.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 57 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:

Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.

15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.

Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.

16Suma de las líneas 12 a 15

17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

18Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.

El monto se debe registrar con signo negativo.

19Suma de las líneas 17 y 18

20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

## TABLA II.2

### NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

#### REFERENCIADESCRIPCIÓN

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 58 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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. El monto se debe registrar con signo negativo.

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  
REFERENCIA DESCRIPCIÓN

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 Nacional Largo plazo Corto plazo Perspectiva

Fitch Ratings AAA (mex) F1+ (mex) Estable

Standard & Poor's smx AA mx A-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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 59 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 60 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil doscientas millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, el dividendo de referencia no fue pagado a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V., se llevó a cabo a través de Scotiabank con fecha 20 de diciembre de 2013.

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 30 de junio del 2022, el Banco contaba con las siguientes posiciones de Activos Líquidos para hacer frente a sus requerimientos de liquidez en caso de ser necesario:

Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$69,257 millones de pesos.  
Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$51,075 millones de pesos.

Adicionalmente:

Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$150 millones de dólares.

Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.

Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución. Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

Inversiones relevantes en capital



Al 30 de junio de 2022, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

#### Instrumentos Financieros Derivados

#### I. Información Cualitativa

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

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

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

---

---

emitida por Banco de México.

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

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

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

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

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

---

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

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a 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	condición de Mercado
1.	Flujos de Efectivo	Pagarés con rendimiento	liquidable al vencimiento de tasa fija	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
3.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante	Activa	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
4.	Valor Razonable	Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera	Activa	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
5.	Flujos de Efectivo	Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
6.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)
7.	Flujos de Efectivo	Reportos	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
8.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)
9.	Flujo de Efectivo	Bonos de tasa fija en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos	Cross Currency Interest Rate Swap

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 64 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

(pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

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

Subyacente\*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

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

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 65 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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 2022 y en promedio para el segundo trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 61,13453,469

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 79,16586,605

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

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México).

---

El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2 & Wall Street).

Clase de activoDerivadoTipoBreve descripción

Tasas de interésOpcionesEuropeaCaps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$Cap = \sum_{i=1}^n Caplet_i$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$Floor = \sum_{i=1}^n Floorlet_i$

BinariaLa opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto nominal en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto nominal predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEl intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRSIntercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambioOpcionesEuropeaEn este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

AmericanaEl enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

BinariaSe recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

BarreraUna opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{(t < T)}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

ForwardForward OTCCompra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activoDerivadoTipoBreve descripción

Índices, capitales y metalesOpciones

EuropeaOpción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 67 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

BinariaTipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listadosMexder FuturesIRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activoNombre de productoMetodologíaNotas

FI SecurityBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ CashAccionesLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas Líneas de Crédito

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

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

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 68 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)  
Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos  
Metales

Sujetos de Crédito

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

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

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

Idoneidad del Cliente

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

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

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

Políticas de VaR

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

---



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

#### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

##### Métodos y técnicas de Valuación:

##### Cálculo de Sensibilidades

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

##### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

##### Bonos de Tasa Flotante

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

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

##### Bonos Cupón Cero

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

##### Riesgo de Crédito

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

#### Sensibilidad del Pasivo

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

#### Derivados de Tasas de Interés

##### Swaps de Tasa de Interés

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

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

##### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

##### Futuros de Bono M

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

##### Futuros de CETE

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

#### Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

---

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

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. Al cierre de junio 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

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

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre:

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 72 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

Al cierre de junio de 2022 y promedio del segundo trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 79,16586,605

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 73 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Scotiabank Inverlat.

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

Scotiabank Normal Escenario Posible Escenario Probable Escenario de Estrés  
(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum 61,13457,76857,76857,767

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (3,366) (3,366) (3,367)

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

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 74 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 continúa conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

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

II. Información Cuantitativa

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2022:

0-3 Months3 - 12 Months1 - 3 Years3 - 5 Years5 - 10 Years10 - 30 YearsTotal Today

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

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

PAGINA 75 / 82

CONSOLIDADO

Impresión Final

Swaps 96,859.00 (63,229.00) 283,699.00 (540,239.00) (145,004.00) 1,191.00 (366,723.00)  
 CCS 12.00 168.00 26.00 (237.00) 328.00 (30.00) 267.00  
 Caps & Floors 133.00 1,101.00 97.00 182.00 0.00 0.00 1,513.00  
 Binary Caps & Floors -----  
 TIIE Futures -----  
 Mbonds Futures -----  
 Total DERIVATIVES 97,004.00 (61,960.00) 283,822.00 (540,294.00) (144,676.00) 1,161.00  
 (364,943.00)

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (47.07) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (94.14) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (217.09) Millones de pesos.

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

Tipo	Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable
Shock(+/-)	P&L	Stress 1			
Shock(+/-)	P&L	Stress 2			
Shock(+/-)	P&L				
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	--50-100-200-			
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.36) 6.1350 (18.25) 100 (36.5) 200 (72.99)			
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	0 (0.27) 0.1-0.4-1-			
a FX %	Forwards	14.31288.20.1 (28.82) 0.2 (57.64) 0.5 (144.1)			
a FX %	Opciones Divisa	--0.1-0.2-0.5-			
Total		(47.07) (94.14) (217.09)			

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 30 de junio de 2022 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Delta	Vega	Gamma
Options	IDBTVR	.INDX---
Options	MEXAS5	.INDX---
Options	MEXEZU	.USM---
Options	MEXFR5	.INDX---
Options	MEXFXI	.USM---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 76 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Options MEXGLD.USM---  
Options MEXIL5.INDX1,734,765.009,571.00-  
Options MEXIXM.INDX---  
Options MEXMCH.USM---  
Options MEXMSF.INDX---  
Options MEXMSI.INDX---  
Options NVDA.USM---  
Options TSM.USM---  
TOTAL1,743,199.009,571.00-

## 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 IDBTVR.INDX---  
Options MEXAS5.INDX---  
Options MEXEZU.USM---  
Options MEXFR5.INDX---  
Options MEXFXI.USM---  
Options MEXGLD.USM---  
Options MEXIL5.INDX(173,476.50) (520,429.50) (867,382.50)  
Options MEXIXM.INDX---  
Options MEXMCH.USM---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX(843.40) (2,530.20) (4,217.00)  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
TOTAL(174,319.90) (522,959.70) (871,599.50)

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

### Escenarios a la Alza

0.050.150.2

Options IDBTVR.INDX---  
Options MEXAS5.INDX---  
Options MEXEZU.USM---  
Options MEXFR5.INDX---  
Options MEXFXI.USM---  
Options MEXGLD.USM---  
Options MEXIL5.INDX86,738.25260,214.75346,953.00  
Options MEXIXM.INDX---  
Options MEXMCH.USM---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXAE.INDX421.701,265.101,686.80  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
TOTAL87,159.95261,479.85348,639.80

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:

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 77 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Del EscenarioMonto  
Probable(174,319.90)  
Poco Probable(522,959.70)  
Muy poco Probable(871,599.50)

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre  
Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2022 se tienen los siguientes  
saldos:

Cifras expresadas en pesos

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN	53,400,000	(101,900,000)
CLIENTE 2MXN	232,500,000	(63,100,000)
CLIENTE 3MXN	94,800,000	(82,800,000)
CLIENTE 4MXN	671,600,205	(460,800,000)
CLIENTE 5USD	31,760,000	(32,950,000)
CLIENTE 6USD	223,040,000	(11,400,000)
CLIENTE 7USD	155,700,000	(202,400,000)
CLIENTE 8USD	-	(320,000)
CLIENTE 9USD	4,130,000	(5,650,000)
CLIENTE 10USD	150,000-	
CLIENTE 11USD	26,750,000	(19,790,000)
CLIENTE 12USD	5,700,000	(4,970,000)
CLIENTE 13MXN	373,200,000	(462,200,000)
CLIENTE 14MXN	411,600,000	(277,800,000)
CLIENTE 15MXN	15,500,000	(105,800,000)
CLIENTE 16MXN	1,562,100,000	(1,106,800,000)
CLIENTE 17USD	12,630,000-	
CLIENTE 18MXN	390,200,000	(3,983,400,000)
CLIENTE 19MXN	62,500,000	(62,800,000)
CLIENTE 20USD	6,000,000	(11,510,000)
CLIENTE 21USD	2,790,000	(1,620,000)
CLIENTE 22MXN	-	(105,000,000)
TOTAL	4,336,050,204.71	(7,103,010,000)

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

"Ver ARCHIVO COMPLETO EN PDF"

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 78 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 79 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 80 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 81 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

Cifras expresadas en pesos

Producto	Fecha de evento	Contraparte/	Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	1MXN9,562	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	2MXN136,081	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	3MXN6,886	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	4MXN8,787	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA		
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	5MXN17,050	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA		
Forwards FX	abr-22	Cliente	6MXN145,896	NO ENVIO LOS FONDOS		
Forwards FX	abr-22	Cliente	7MXN223,318	NO ENVIO LOS FONDOS		
Forwards FX	abr-22	Cliente	8MXN72,308	NO ENVIO LOS FONDOS		
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	9MXN579,370	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	10MXN324	NO FONDEO	SU CUENTA	
Forwards FX	abr-22	Cliente	11MXN609,360	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	12MXN612,408	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	13MXN614,868	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	14MXN622,905	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	15MXN627,435	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	16MXN1,264,680	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	17MXN632,070	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	18MXN632,925	PAGO FUERA DE HORARIO		
Forwards FX	abr-22	Cliente	19MXN635,895	PAGO FUERA DE HORARIO		
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	20MXN531,517	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	21MXN24,257	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	22MXN58,443	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	23MXN2,172,412	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	24MXN266,843	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	25MXN2,885	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	26MXN1,376	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	27MXN516,845	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	28MXN585,330	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	29MXN187	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	30MXN2,172,412	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	31MXN203,771	NO FONDEO	SU CUENTA	
FX Options (Vanilla)	jun-22	Cliente	32MXN2,025,000	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	33MXN2,270	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	34MXN(2,874)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN		
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	35MXN69,961	NO ENVIO LOS FONDOS		
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	36MXN99,944	NO ENVIO LOS FONDOS		
Forwards FX	jun-22	Cliente	37USD117,000	NO FONDEO	SU CUENTA	
Forwards FX	jun-22	Cliente	38USD128,000	NO FONDEO	SU CUENTA	
Forwards FX	jun-22	Cliente	39USD137,000	NO FONDEO	SU CUENTA	
Forwards FX	jun-22	Cliente	40USD151,000	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	41MXN389,084	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	42MXN(3,175)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN		
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	43MXN312,150	NO FONDEO	SU CUENTA	
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	44MXN391	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente	45MXN2,172,412	NO FONDEO	SU CUENTA	
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente	46MXN194,068	NO FONDEO	SU CUENTA	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

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

PAGINA 82 / 82

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte  
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(1) Autorización y bases de presentación-

## Autorización

El 15 de Julio de 2022, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

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

La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2021 y 2020.

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

## Bases de presentación

### a) Declaración de cumplimiento

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

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

### b) Uso de juicios y estimaciones

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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

## Juicios

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

## Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

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

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

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

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

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

- Reconocimiento de activos por impuestos y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU) diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos y PTU diferidos.

## c) Moneda funcional y de informe

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

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

## d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

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

## (2) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 3 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, y han sido aplicados consistentemente por el Banco.

## (a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

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

Los ejercicios terminados el 31 de diciembre de 2021 y 2020, son considerados como entorno económico no inflacionario (inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores menor que el 26%), conforme a lo establecido en la NIF B-10 "Efectos de la inflación"; consecuentemente no se reconocen los efectos de la inflación en la información financiera del Banco. En caso de que se vuelva a estar en un entorno inflacionario, se deberán registrar de manera retrospectiva los efectos acumulados de la inflación no reconocidos en los periodos en los que el entorno fue calificado como no inflacionario. El porcentaje de inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores se muestra a continuación:

Inflación	31 de diciembre de	UDIDel año	Acumulada
2021	7.1082337.61%	14.16%	
2020	6.6055973.23%	11.31%	
2019	6.3990182.77%	15.03%	

## (b) Compensación de activos financieros y pasivos financieros-

Los activos y pasivos financieros reconocidos son objeto de compensación de manera que se presente en el balance general consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, si y sólo si, se tiene el derecho contractual de compensar los importes reconocidos, y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

## (c) Bases de consolidación-

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

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se detallan a continuación:

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

## (d) Disponibilidades-

Este rubro se compone de efectivo, saldos bancarios en moneda nacional y dólares, así como operaciones de compraventa de divisas que no se consideren derivados conforme lo

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

establece el Banco Central en la regulación aplicable. Adicionalmente, incluye disponibilidades restringidas conformadas por préstamos interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días (operaciones de "Call Money") y depósitos en el Banco Central, estos últimos incluyen los depósitos de regulación monetaria que el Banco está obligado a mantener conforme a las disposiciones emitidas por el Banco Central con el propósito de regular la liquidez en el mercado de dinero; dichos depósitos carecen de plazo, y generan intereses a la tasa promedio de la captación bancaria, mismos que son reconocidos en resultados conforme se devengan.

Las disponibilidades se reconocen a su valor nominal. En el caso de cuentas bancarias denominadas en dólares, el tipo de cambio utilizado para la conversión es el publicado por el Banco Central. El efecto de valorización y los intereses ganados se registran en resultados, como ingreso o gasto por intereses, según corresponda, conforme se devengan.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Las divisas adquiridas que se pacte liquidar en operaciones de compraventa a 24, 48, 72 y 96 horas, se reconocen como una disponibilidad restringida (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de disponibilidades (divisas a entregar). Los derechos y obligaciones originadas por las ventas y compras

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

de divisas a 24, 48, 72 y 96 horas se registran en cuentas liquidadoras dentro del rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente.

(e) Cuentas de margen-

Los activos financieros otorgados en efectivo requeridos al Banco con motivo de la celebración de operaciones con derivados realizados en mercados o bolsas reconocidos se reconocen a su valor nominal y se presentan en el rubro de "Cuentas de margen". El valor de la cuenta de margen otorgada en efectivo se modifica por las liquidaciones parciales o totales que la cámara de compensación deposita o retira y por las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco.

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

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

(f) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 6 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

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

Títulos disponibles para la venta-

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

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

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

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

La utilidad o pérdida en cambios proviene de los títulos clasificados como disponibles para la venta denominados en moneda extranjera y se reconoce dentro de los resultados del ejercicio.

Títulos conservados al vencimiento-

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

Deterioro del valor de un título-

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

Si en un período posterior, el valor razonable del título se incrementa, y dicho efecto

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 7 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

está relacionado objetivamente con un evento que ocurra después de que el deterioro fue reconocido en los resultados del ejercicio, el deterioro se revierte en los resultados del ejercicio, excepto si se trata de un instrumento de patrimonio.

Al 31 de diciembre de 2021 y 2020, la Administración del Banco no ha identificado que exista evidencia objetiva del deterioro de algún título.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contrapartida deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

Reclasificación entre categorías-

Los Criterios Contables permiten efectuar reclasificaciones de la categoría de títulos conservados al vencimiento hacia títulos disponibles para la venta, siempre y cuando no se tenga la intención o capacidad de mantenerlos hasta el vencimiento. El resultado por valuación correspondiente a la fecha de reclasificación se reconoce en el capital contable. En caso de reclasificaciones hacia la categoría de títulos conservados a vencimiento, o de títulos para negociar hacia disponibles para la venta, se podría efectuar únicamente con autorización expresa de la Comisión Bancaria. Asimismo, en caso de ventas de títulos conservados a vencimiento deberá informarse a la Comisión Bancaria. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2021 y 2020, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías, ni ventas de títulos conservados a vencimiento.

(g) Préstamo de valores-

En la fecha de contratación de las operaciones de préstamo de valores actuando el Banco como prestamista, en lo que se refiere a los valores objeto del préstamo, se reclasifican como restringidos en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores"; mientras que actuando como prestatario se reconocen en cuentas de orden en el rubro de "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

El importe del premio devengado actuando el Banco como prestamista o prestatario se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio, a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación en el rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", respectivamente, contra el rubro de "Préstamo de valores" dentro del activo o pasivo, según corresponda.

En el caso de que el Banco, previo al vencimiento de la operación de préstamo de valores, venda el colateral recibido como prestamista o el valor objeto de la operación como prestatario, reconoce la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como la obligación de restituir dicho colateral al prestatario o el valor objeto de la operación al prestamista dentro del rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", dicha obligación es medida inicialmente al precio pactado y posteriormente se valúa a valor razonable, el efecto por valuación se presenta en resultados dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 8 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

La diferencia entre el precio recibido y el valor razonable del valor objeto de la operación o de los colaterales recibidos, que en su caso exista en el momento de vender, se presenta en el rubro de "Resultado por intermediación".

## (h) Operaciones de reporto-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco actuando como reportada reconoce la entrada del efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar; mientras que actuando como reportadora reconoce la salida de disponibilidades o bien una cuenta liquidadora acreedora, así como una cuenta por cobrar. Tanto la cuenta por pagar como la cuenta por cobrar son medidas inicialmente al precio pactado, lo cual representa la obligación de restituir o el derecho a recuperar el efectivo, respectivamente.

A lo largo de la vigencia del reporto la cuenta por cobrar y por pagar se valúan a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo; dicho interés se reconoce dentro del rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", según corresponda. La cuenta por cobrar y por pagar, así como los intereses devengados se presentan en el rubro de "Deudores por reporto" y "Acreedores por reporto", respectivamente.

El Banco actuando como reportadora reconoce el colateral recibido en cuentas de orden en el rubro "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes". Los activos financieros otorgados como colateral, actuando el Banco como reportada se reclasifican en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores", presentándolos como restringidos.

En caso de que el Banco, actuando como reportadora venda el colateral o lo otorgue en garantía, reconoce los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. Dicha cuenta por pagar se compensa con la cuenta por cobrar que es reconocida cuando el Banco actuando como reportadora se convierte a su vez en reportada y, se presenta el saldo deudor o acreedor en el rubro de "Deudores por reporto" o en el rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", según corresponda.

Adicionalmente, el colateral recibido, entregado o vendido se reconoce en cuentas de orden dentro del rubro de "Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

## (i) Derivados-

Las operaciones con instrumentos financieros derivados comprenden aquellas con fines de negociación y de cobertura; los derivados sin consideración de su intencionalidad se reconocen a valor razonable.

El efecto por valuación de los derivados con fines de negociación se presenta en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados dentro de los rubros "Derivados", en el activo o pasivo, según corresponda, y "Resultado por intermediación", respectivamente. El efecto por el riesgo de crédito (contraparte) de los derivados, debe determinarse de acuerdo a la metodología del área de riesgos, y debe reconocerse en los resultados en el periodo en que ocurra contra la cuenta complementaria.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 9 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

La porción efectiva del resultado por valuación de las coberturas designadas como de flujo de efectivo se reconoce en el capital contable dentro del rubro "Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo", en tanto que la porción inefectiva del cambio en el valor razonable se reconoce de manera inmediata en resultados dentro del rubro "Resultado por intermediación" y la contracuenta con dicho efecto se presenta en el balance general consolidado dentro del rubro de "Derivados". La ganancia o pérdida asociada a la cobertura de la transacción pronosticada que haya sido reconocida en el capital contable, se reclasifica al estado consolidado de resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación de la partida cubierta atribuible al riesgo cubierto, en el mismo periodo durante el cual los flujos de efectivo pronosticados cubiertos afecten los resultados del ejercicio.

En el caso de que el derivado de cobertura de flujo de efectivo expire, sea ejercido, terminado o la cobertura no cumpla con los requisitos para ser considerada como tal, se revoca la designación de cobertura a la vez que la valuación del derivado de cobertura de flujo de efectivo que se encuentra dentro de capital contable permanece en dicho rubro y se reconoce cuando la transacción pronosticada ocurre en los resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación atribuible al riesgo cubierto.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el derivado de cobertura de valor razonable se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Derivados" y en el estado consolidado de resultados en los rubros de "Ingresos por intereses" y "Resultado por intermediación", dado que corresponden a coberturas de tasa de interés de cartera de crédito e inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta, respectivamente. El resultado por valuación de la partida atribuible al riesgo cubierto, se reconoce en el balance general consolidado en el rubro de "Ajustes de valuación por cobertura de activos financieros" y se reconoce en los resultados del ejercicio, tratándose de cartera de crédito, en el rubro de "Ingresos por intereses", mientras que por las inversiones en valores clasificadas como disponibles para la venta se reconocen dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

Derivados implícitos y estructurados

El Banco mantiene derivados implícitos que no se utilizan para cubrir posiciones, sino como estrategia de negociación; dichos derivados se encuentran relacionados a estructuras y/o notas emitidas bajo las siguientes características:

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que, por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente.

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses". Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos-

El colateral es una garantía constituida para asegurar el pago de las contraprestaciones pactadas en contratos con instrumentos financieros derivados en operaciones no realizadas en mercados o bolsas reconocidos.

El otorgamiento de colaterales entregados en efectivo en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se registran como una cuenta por cobrar que se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que los

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

colaterales recibidos en efectivo se registran en el rubro de "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en títulos se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

(j)Compensación de cuentas liquidadoras-

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reporto y/o de operaciones con derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados se registran en cuentas liquidadoras, incluyendo los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día.

Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

Las cuentas liquidadoras se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" o "Acreedores por liquidación de operaciones", según corresponda.

(k)Cartera de crédito-

Representa el saldo de la disposición total o parcial de las líneas de crédito otorgadas a los acreditados más los intereses devengados no cobrados, menos los intereses cobrados por anticipado. La estimación preventiva para riesgos crediticios se presenta deduciendo los saldos de la cartera de crédito.

Las líneas de crédito no dispuestas se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios". El monto que es dispuesto por el acreditado se considerará dentro de la cartera de crédito conforme a la categoría de cartera que le corresponda.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

Cartera INFONAVIT-

La cartera en prórroga se integra por todos aquellos créditos a la vivienda originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT) adquiridos por las entidades financieras, y que en términos de la Ley del INFONAVIT, cuenten con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios, al concluir la prórroga la cartera recibirá el tratamiento que le corresponda de: Régimen Ordinario de Amortización (ROA) o Régimen Especial de Amortización (REA). Lo anterior, siempre y cuando la entidad financiera esté contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos del organismo de referencia.

REA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, prevista por las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del INFONAVIT" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

ROA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

Créditos e intereses vencidos-

Los saldos insolutos de los créditos e intereses se clasifican como vencidos de acuerdo con los siguientes criterios:

1. Se tenga conocimiento de que el acreditado es declarado en concurso mercantil, conforme a la Ley de Concursos Mercantiles.

Se exceptúa de la regla anterior aquellos créditos que continúen recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles, así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley; sin embargo, cuando incurran en los supuestos previstos en el punto 2 siguiente, serán traspasados a cartera vencida.

2. Sus amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, considerando lo siguiente:

a) si los adeudos consisten en créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento y presentan 30 o más días naturales de vencidos;

b) si los adeudos se refieren a créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses y presentan 90 o más días naturales de vencido el pago de intereses respectivo, o bien 30 o más días naturales de vencido el principal;

c) si los adeudos consisten en créditos con pagos periódicos parciales de principal e intereses, incluyendo los créditos a la vivienda, presentan 90 o más días naturales de vencidos;

d) si los adeudos consisten en créditos revolventes y presentan dos periodos mensuales de facturación vencidos o, en caso de que el periodo de facturación sea distinto al mensual, cuando corresponda a 60 o más días naturales de vencidos, y

e) los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes que cuentan con línea de crédito, así como los documentos de cobro inmediato, al momento en el cual se presente dicho evento.

3. Para el caso de cartera en prórroga y créditos a la vivienda, cuando las amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presenten 90 o más días de vencidos:

a) los pagos correspondientes a los créditos que el Banco haya adquirido al INFONAVIT o el Fondo de la Vivienda del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado (FOVISSSTE), conforme a la modalidad de pago correspondiente (REA o ROA), así como

b) los créditos otorgados a personas físicas destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial que estén respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado.

El traspaso al rubro de "Cartera de crédito vencida" de los créditos a que se refiere el numeral 3 del párrafo anterior se sujetará al plazo excepcional de 180 o más días de

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

incumplimiento a partir de la fecha en la que:

- a) los recursos del crédito sean dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
- b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
- c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho periodo representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones contenidas en los incisos a), b) y c) anteriores, no serán excluyentes entre sí.

Cuando un crédito es traspasado a cartera vencida, se suspende la acumulación de intereses devengados y se lleva el registro de los mismos en cuentas de orden. Asimismo, se suspende la amortización en resultados del ejercicio de los ingresos financieros devengados. Cuando dichos intereses son cobrados se reconocen directamente en resultados en el rubro de "Ingresos por intereses". El reconocimiento en resultados de los ingresos por intereses se reanuda cuando la cartera deja de considerarse como vencida.

Por los intereses devengados no cobrados correspondientes a créditos considerados como cartera vencida, se constituye una estimación por el equivalente al total de éstos al momento del traspaso del crédito como cartera vencida. Para los créditos vencidos en los que en su reestructuración se acuerde la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, se constituye una estimación por el total de dichos intereses. La estimación se cancela cuando se cuenta con evidencia de pago sostenido.

El traspaso de créditos de cartera vencida a vigente se realiza cuando los acreditados liquidan la totalidad de los saldos pendientes de pago (principal e intereses, entre otros), excepto los créditos reestructurados o renovados, que se traspasan a cartera vigente cuando éstos cumplen oportunamente con el pago sostenido.

## Pago sostenido

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago sin retraso por el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición.

En los casos de los créditos que el Banco adquiriera al INFONAVIT, en los que esté obligada a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En los créditos con pagos periódicos de principal e intereses cuyas amortizaciones sean menores o iguales a 60 días en los que se modifique la periodicidad del pago a periodos menores derivado de la aplicación de una reestructura, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago de amortizaciones equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema original del crédito.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan la reclasificación al rubro de "Cartera de crédito vencida", para determinar las tres amortizaciones consecutivas requeridas para la existencia de pago sostenido, se deberá considerar el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalga al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando, ocurra alguno de los siguientes supuestos:

a) el acreditado haya cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,

b) se hubiere cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados (amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición), distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido.

En cualquier caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, debe tener a disposición de la Comisión Bancaria evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener lo que se señala a continuación:

- i. probabilidad de incumplimiento intrínseca al acreditado,
- ii. las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- iii. la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- iv. la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

## Reestructuras y renovaciones

Un crédito se considera reestructurado cuando el acreditado solicita al Banco cualquiera de las siguientes situaciones:

1) Ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate, o bien,

2) Modificaciones a las condiciones originales del crédito o al esquema de pagos, entre las que se encuentran:

a) Cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;

b) Cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM o UDI);

c) Concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo COVID, o

d) Prórroga del plazo del crédito.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Los créditos vencidos que se reestructuren o se renueven permanecerán dentro de la cartera vencida, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento que se reestructuren durante el plazo del crédito o se renueven en cualquier momento serán considerados como cartera vencida en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos vigentes que se reestructuren o se renueven, sin que haya transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se considerará que continúan siendo vigentes, únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) cubierto la totalidad de los intereses devengados, y
- ii) cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Los créditos vigentes que se reestructuren o renueven durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere:

- i) liquidado la totalidad de los intereses devengados;
- ii) cubierto la totalidad del monto original del crédito que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
- iii) cubierto el 60% del monto original del crédito.

En caso de no cumplirse todas las condiciones descritas anteriormente serán considerados como vencidos desde el momento en que se reestructuren o renueven y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Aquellos créditos catalogados como revolventes, que se reestructuren o renueven, en cualquier momento se considerarán vigentes únicamente cuando el acreditado hubiere liquidado la totalidad de los intereses devengados, el crédito no presente periodos de facturación vencidos y se cuente con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor.

No se considerarán como tales a aquéllas que a la fecha de la reestructura presenten cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las siguientes condiciones originales del crédito:

- i) Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
- ii) Tasa de interés: cuando se mejore la tasa de interés pactada.
- iii) Moneda: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda.
- iv) Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago deberá permitir la omisión de pago en periodo alguno.

Las reestructuras o renovaciones de créditos de cartera se efectúan en apego a lo establecido en las "Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" y la viabilidad de las mismas es analizada de forma particular.

El Banco evalúa periódicamente si un crédito vencido debe permanecer en el balance general consolidado, o bien, ser castigado, siempre y cuando estén provisionados al 100%. Dicho castigo se realiza cancelando el saldo insoluto del crédito contra la

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

estimación preventiva para riesgos crediticios creada con anterioridad para cada crédito. Cualquier recuperación derivada de créditos previamente castigados o eliminados, deberá reconocerse en los resultados del ejercicio.

Durante el primer trimestre de 2021, la Administración del Banco Actualizó los criterios sobre castigos financieros para créditos hipotecarios, quedando estos a partir de 60 mensualidades vencidas.

Las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos, es decir, el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total, se registran con cargo a la estimación preventiva para riesgos crediticios. En caso de que el importe de éstas exceda el saldo de la estimación asociada al crédito, previamente se constituyen estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

## Comisiones

Las comisiones cobradas por el otorgamiento del crédito se registrarán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante la vida del crédito, excepto las que se originen por créditos revolventes que deberán ser amortizadas por un periodo de 12 meses.

Tratándose de las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos, estas deberán adicionarse a las comisiones que se hubieran originado conforme al párrafo anterior reconociéndose como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses, bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

No entrarán en esta categoría las comisiones que se reconozcan con posterioridad al otorgamiento del crédito, aquellas que se generen como parte del mantenimiento de dichos créditos, ni las que se cobren con motivo de créditos que no hayan sido colocados. En el caso de comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito, ya sea la primera anualidad o subsecuentes por concepto de renovación, se reconocerán como un crédito diferido y serán amortizadas en un periodo de 12 meses contra los resultados del ejercicio en el citado rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Las comisiones cobradas que se originen por el otorgamiento de una línea de crédito que no haya sido dispuesta, en ese momento se reconocerán como un crédito diferido, el cual se amortizará contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta por un periodo de 12 meses. En el caso de que la línea de crédito se cancele antes de que concluya el periodo de 12 meses, el saldo pendiente por amortizar deberá reconocerse directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que ocurra la cancelación de la línea.

Las comisiones y tarifas distintas a las cobradas por el otorgamiento del crédito, se reconocerán contra los resultados de ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que se devenguen. En el caso de que una parte o la totalidad de la contraprestación recibida por el cobro de la comisión o tarifa correspondiente se reciban anticipadamente al devengamiento del ingreso relativo, dicho anticipo deberá reconocerse como un pasivo.

## Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

Los costos y gastos relacionados con el otorgamiento del crédito se reconocen como un cargo diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio dentro del

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 16 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

rubro de "Gastos por intereses", durante el plazo promedio de la vida de los créditos, excepto para las que se originen por créditos revolventes, las cuales son amortizadas en un periodo de 12 meses contra el rubro del gasto que le corresponda de acuerdo a su naturaleza.

Para efectos del párrafo anterior, se entenderán como costos o gastos asociados con el otorgamiento del crédito, únicamente a aquellos que sean incrementales y relacionados directamente con actividades realizadas por las entidades para otorgar el crédito, por ejemplo la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades.

Adquisición de cartera de crédito

En la fecha de adquisición de la cartera se deberá reconocer el valor contractual de la cartera adquirida en el rubro de cartera de crédito, conforme al tipo de cartera que el originador hubiere clasificado; la diferencia que se origine respecto del precio de adquisición se registrará como se muestran a continuación:.

a) cuando el precio de adquisición sea menor al valor contractual de la misma, en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", hasta por el importe de la estimación preventiva para riesgos crediticios que, en su caso, se constituya conforme a lo indicado en el párrafo siguiente y el excedente como un crédito diferido, el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

b) cuando el precio de adquisición de la cartera sea mayor a su valor contractual, como un cargo diferido el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

c) cuando provenga de la adquisición de créditos revolventes, se llevará dicha diferencia directamente a los resultados del ejercicio en la fecha de adquisición.

Criterios Contables Especiales (CCE), derivado de la contingencia sanitaria por COVID-19

Mediante oficios número P-285/2020 y 026/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Bancaria determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la Comisión Bancaria indicó lo siguiente:

- Los CCE serán aplicados de manera general a los clientes que se hayan visto afectados y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo 2020.
- El plazo para realizar los trámites de reestructuración o renovación deberán concluir a más tardar el 31 de julio de 2020.

Los programas de apoyo consisten en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 4 meses y con posibilidad de extenderlo a 2 meses adicionales, otorgando un período de gracia total hasta de 6 meses. Será de 18 meses tratándose de créditos otorgados a los sectores primarios agrícola, ganadero, forestal y pesquero; y a los sectores industrial, comercial y servicios que estén integrados los citados sectores primarios.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Lo anterior será aplicable a los siguientes tipos de crédito y para clientes que se encuentren clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo de 2020:

- a. Créditos para la construcción de vivienda.
- b. Créditos individuales con garantía hipotecaria.
- c. Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).
- d. Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial.
- e. Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.
- f. Microcréditos individuales o grupales.

Para los CCE no se consideran como reestructuras y/o renovaciones y serán consideradas como cartera vigente los siguientes:

1. Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento", que sean reestructurados o renovados, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 79 del Criterio Contable B-6 "Cartera de Crédito" (el "Criterio Contable B-6") contenido en el Anexo 33 de la Circular única de Bancos, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

2. Para créditos con "pagos periódicos de principal e intereses", que se reestructuren o renueven, podrán considerarse como vigentes al momento en que se lleve a cabo dicho acto, sin que sea aplicable lo que establecen los párrafos 82 y 84 del Criterio Contable B-6, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

3. Los créditos que desde su inicio se estipule su carácter revolvente, que se reestructuren o renueven, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 80 y 81 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

En relación con los créditos citados en los numerales anteriores, estos no se considerarán como reestructurados conforme lo que establece el párrafo 40 del Criterio Contable B-6.

4. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

Mediante oficio número 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la Comisión Bancaria extendió el plazo hasta el 30 de septiembre de 2020 para que el Banco pudiera aplicar los planes de reestructura o renovación para aquellos clientes ya inscritos en el programa de apoyo al 31 de julio de 2020, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los CCE, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

(1) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Se mantiene una estimación para riesgos crediticios, la cual, a juicio de la administración del Banco, es suficiente para cubrir cualquier pérdida que pudiera surgir tanto de los préstamos incluidos en su cartera de créditos, como otros riesgos crediticios de avales y compromisos irrevocables de conceder préstamos.

Cartera comercial - Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los acreditados y su clasificación, en apego a las "Disposiciones de carácter general aplicables a la metodología de calificación de la cartera crediticia de las instituciones de crédito" (las "Disposiciones"), establecidas por la Comisión Bancaria. La cartera crediticia estará sujeta a calificación, sin incluir aquellos créditos con garantía otorgada por Entidades de la Administración Pública Federal bajo control presupuestario directo, empresas productivas del Estado o aquellas señaladas en la fracción VI del artículo 112 de las Disposiciones, en los cuales el porcentaje de reserva será igual a 0.5%.

Las Disposiciones utilizan una metodología en la cual se clasifica a la cartera en diferentes grupos: en entidades federativas y municipios, proyectos de inversión con fuente de pago propia, fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, entidades financieras y personas morales y físicas con actividad empresarial no incluidas en los grupos anteriores, a su vez, este último grupo deberá dividirse en dos subgrupos: personas morales y físicas con actividad empresarial con ingresos o ventas netas anuales mayores a 14 millones de UDIS y menores a 14 millones de UDIS. Para efectos de la calificación de proyectos con fuente de pago propia establece que la calificación se calculará mediante al análisis del riesgo del proyecto de inversión de acuerdo a su etapa de construcción u operación y mediante el sobrecosto de obra y los flujos de efectivo del proyecto. Para los demás grupos se establece una metodología de pérdida esperada por riesgo de crédito, considerando la probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Para la cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales iguales o mayores a 14 millones de UDIS, el Banco utiliza la metodología descrita en el Anexo 22 de las Disposiciones de la Comisión Bancaria.

La cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales menores a 14 millones de UDIS es calificada mediante la aplicación de la metodología descrita en el Anexo 21 de las Disposiciones, y para el caso de créditos con entidades financieras se utiliza la metodología descrita en el Anexo 20 de las mismas, en donde establece el concepto de probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Las estimaciones realizadas al 31 de diciembre de 2021 y 2020 se determinaron conforme al grado de riesgo y los porcentajes de estimación preventiva siguientes:

Rangos de porcentaje de  
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.90%  
A20.9011.50%  
B11.5012.00%  
B22.0012.50%  
B32.5015.00%  
C15.00110.00%  
C210.00115.50%  
D15.50145.00%



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

EMayor a 45.00%

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

La reserva para créditos a la vivienda, se determina utilizando los saldos correspondientes al último día de cada mes. Asimismo, se consideran factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) días de atraso, vi) denominación del crédito e vii) integración del expediente. Adicionalmente, para los créditos adquiridos al INFONAVIT se consideran factores tales como: viii) ROA, ix) REA y x) prórroga. El monto total a constituir de cada crédito evaluado, es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento.

Para la determinación de la severidad de la pérdida es utilizado el componente de tasa de recuperación del crédito, la cual se ve afectada si el crédito cuenta con un fideicomiso de garantía o convenio judicial clasificando por regiones a las entidades federativas a las que pertenezcan dichos tribunales.

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se muestran a continuación:

Rangos de porcentaje de  
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.50%  
A20.5010.75%  
B10.7511.00%  
B21.0011.50%  
B31.5012.00%  
C12.0015.00%  
C25.00110.00%  
D10.00140.00%  
E40.001100.00%

Cartera de consumo-

Para determinar la reserva de la cartera de consumo, ésta es separada en dos grupos: a) tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, y b) créditos no revolventes descritas en los Artículos 91 y 92 de las Disposiciones. Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, así como viii) antigüedad del acreditado en el Banco.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a créditos no revolventes considera lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) días de atraso, (iv) plazo total,

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

(v) plazo remanente, (vi) importe original del crédito, (vii) valor original del bien, (viii) el saldo del crédito y (ix) tipo de crédito.

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2021 y 2020, se muestran a continuación:

Rango de porcentaje de estimación preventiva  
Tarjeta de crédito  
y otros créditos  
Grado de riesgo No revolventes / revolventes

A10.002.0% - 0.003.00%  
A22.013.0% - 3.015.00%  
B13.014.0% - 5.016.50%  
B24.015.0% - 6.518.00%  
B35.016.0% - 8.0110.00%  
C16.018.0% - 10.0115.00%  
C28.0115.0% - 15.0135.00%  
D15.0135.0% - 35.0175.00%  
E35.01100.0% - Mayores a 75.01%

Cartera emproblemada - El Banco para propósitos de las revelaciones en los estados financieros consolidados, considera emproblemados aquellos créditos comerciales respecto de los cuales determina que existe una probabilidad considerable de que no se podrían recuperar en su totalidad, sin excluir las mejoras en los grados de riesgo derivadas de la parte del crédito cubierto por garantías, así como créditos que aún y cuando se encuentren vigentes provengan de una negociación en la cual se autorizó una condonación, quita o bonificación al final del plazo pactado, o son a cargo de personas a las cuales se les ha clasificado como clientela indeseable.

Reservas adicionales identificadas - Son establecidas para aquellos créditos que, en la opinión de la administración, podrían verse emproblemados en el futuro dada la situación del cliente, la industria o la economía. Además, incluye estimaciones para partidas como intereses ordinarios devengados no cobrados y otras partidas cuya realización se estima podrían resultar en una pérdida para el Banco, así como reservas mantenidas por regulación normativa.

Castigos- El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos (6 y 35 meses, respectivamente) que determinan la imposibilidad práctica de recuperación; los castigos cancelan el saldo del crédito contra la estimación preventiva previamente constituida. Cuando el crédito a castigar excede el saldo de su estimación asociada, antes de efectuar el castigo, dicha estimación se incrementa hasta por el monto de la diferencia. Cualquier recuperación derivada de los créditos previamente castigados, se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro de estimación preventiva para riesgos crediticios.

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión Bancaria, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(n)Otras cuentas por cobrar-

Los derechos de cobro y las cuentas por cobrar relativas a deudores identificados cuyo vencimiento se pacte desde su origen a un plazo mayor a 90 días naturales, son evaluados por la Administración del Banco para determinar su valor de recuperación estimado, y en su caso constituir las reservas correspondientes. Los saldos de las demás partidas deudoras se reservan con cargo a los resultados del ejercicio a los 90 días siguientes a su registro inicial cuando correspondan a saldos identificados y a los 60 días si corresponden a saldos no identificados, independientemente de su posibilidad de recuperación, con excepción de los relativos a saldos por recuperar de impuestos e impuesto al valor agregado acreditable.

Tratándose de cuentas liquidadoras, en los casos en que el monto por cobrar no se realice a los 90 días naturales siguientes a partir de la fecha en que se haya registrado en cuentas liquidadoras, se registra como adeudo vencido y se constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por el importe total del mismo.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes, que no cuenten con una línea de crédito para tales efectos, se clasificarán como adeudos vencidos y las instituciones deberán constituir simultáneamente a dicha clasificación una estimación por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

(o)Bienes adjudicados o recibidos como dación en pago-

Los bienes adquiridos mediante adjudicación judicial se registran en la fecha en que cause ejecutoria el auto aprobatorio del remate mediante el cual se decretó la adjudicación.

Los bienes recibidos en dación en pago se registran en la fecha en que se firmó la escritura de dación, o en la que se haya dado formalidad a la transmisión de la propiedad del bien.

El reconocimiento contable de un bien adjudicado considera el valor del bien (costo o valor razonable deducido de los costos y gastos estrictamente indispensables que se eroguen en su adjudicación, el que sea menor) así como el valor neto del activo que da origen a la adjudicación. Cuando el valor neto del activo que dio origen a la adjudicación es superior al valor del bien adjudicado, la pérdida se reconoce en los resultados del ejercicio, en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto"; en caso contrario, el valor del bien adjudicado se ajusta al valor neto del activo.

El valor del activo que dio origen a la misma y la estimación preventiva que se tenga constituida a esa fecha, se dan de baja del balance general consolidado.

Los bienes adjudicados prometidos en venta se reconocen como restringidos a valor en libros, los cobros que se reciben a cuenta del bien se registran como un pasivo; en la fecha de enajenación se reconoce en resultados la utilidad o pérdida generada dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Los bienes adjudicados se valúan de acuerdo al tipo de bien de que se trate, registrando dicha valuación (bajas de valor) contra resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El Banco constituye provisiones adicionales que

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 22 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

reconocen los indicios de deterioro por las potenciales pérdidas de valor por el paso del tiempo en los bienes adjudicados, contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", las cuales se determinan multiplicando el porcentaje de reserva que corresponda por el valor de los bienes adjudicados, con base en las disposiciones por tenencia de bienes adjudicados o recibidos en dación de pago de la Comisión Bancaria, conforme se muestra a continuación:

Porcentaje de reserva  
Bienes muebles,  
Meses transcurridos a partir de laderechos de cobro e  
adjudicación o dación en pagoBienes inmueblesinversiones en valores

Hasta 6 0%0%  
Más de 6 y hasta 12 10%10%  
Más de 12 y hasta 18 20%20%  
Más de 18 y hasta 24 45%45%  
Más de 24 y hasta 30 60%60%  
Más de 30 y hasta 36 100%100%  
Más de 36 y hasta 42 100%100%  
Más de 42 y hasta 48 100%100%  
Más de 48 y hasta 54 100%100%  
Más de 54 y hasta 60 100%100%  
Más de 60 100%100%

(p) Inmuebles, mobiliario y equipo-

Los inmuebles, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de los inmuebles, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichos inmuebles, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de los inmuebles, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

(q) Activos de larga duración disponibles para su venta-

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 23 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
- b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
- c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.
- d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que el Banco celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del periodo de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control del Banco y existen evidencias suficientes de que el Banco se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
- e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
- f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores, se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

## (r) Inversiones permanentes-

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

## (s) Otros activos-

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

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.

(t) Impuestos a la utilidad y Participación de los Trabajadores en la Utilidad (PTU)-

Los impuestos a la utilidad y PTU causados en el año se determinan conforme a las disposiciones fiscales y en su caso, laborales vigentes.

El impuesto causado se presenta dentro del balance general consolidado como un pasivo; cuando los anticipos realizados exceden el impuesto determinado del ejercicio, el exceso generado constituye una cuenta por cobrar.

Los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por pérdidas fiscales por recuperar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso, reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos, incluyendo PTU diferida se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

La PTU causada y diferida se presenta dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción", en el estado consolidado de resultados.

(u) Arrendamientos capitalizables (actuando como arrendatario)-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(v) Captación tradicional-

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general, los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses". Por aquellos títulos colocados a un precio diferente al valor nominal, la diferencia entre el valor nominal del título y el monto de efectivo recibido por el mismo, se reconoce como un cargo o crédito diferido y se amortiza bajo el método de línea recta contra resultados durante el plazo del título que le dio origen.

Los depósitos e inversiones y sus intereses de los instrumentos de captación que no tengan una fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven de forma automática, así como las transacciones o las inversiones vencidas y no reclamadas se registraran en el rubro de "Cuenta global de captación sin movimientos". Los depósitos e inversiones y sus intereses sin movimiento en el transcurso de 3 años contados a partir de que estos últimos se depositen en la cuenta global, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública. El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto en este.

#### (w) Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

#### (x) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

#### (y) Beneficios a los empleados-

##### Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

##### Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida ver nota 17) y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del balance general más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediones se reconocen en resultados en el período en que se

---

---

devengan.

#### Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo por beneficios por terminación y un costo o gasto cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuenta.

#### Beneficios Post-Empleo

##### Plan de contribución definida

A partir del 1° de julio de 2021, fecha de la Fusión con SECOSA, la obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. Hasta el 30 de junio de 2021, el Banco solo mantenía un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo.

##### Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos, se realiza anualmente por actuarios certificados en pasivos laborales contingentes, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones generadas resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

(z) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(aa) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

(bb) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ae) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 29 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

#### (4) Cambios contables-

Utilización del tipo de cambio de cierre de jornada de operación para transacciones en moneda extranjera y operaciones extranjeras, en sustitución del tipo de cambio FIX.

El 15 de diciembre de 2021, fue publicada en el DOF la "Resolución que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" de aplicación inmediata a su publicación, en el cual se establecen cambios en el criterio contable A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33 "Criterios contables", referentes a la aplicación del tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central en su página de internet [www.banxico.org.mx](http://www.banxico.org.mx) para la aplicación de la NIF B-15 "Conversión de monedas extranjeras".

Asimismo, se modifica el criterio contable B-4 "Estado de flujos de efectivo", que establece el uso del tipo de cambio de cierre de jornada a la fecha de cierre para la determinación de la utilidad o pérdida en cambios originadas por cambios en el tipo de cambio que no son flujos de efectivo, así como para la conversión de los flujos de efectivo de una operación extranjera y la conversión de saldos o flujos de efectivo en moneda extranjera.

La aplicación del tipo de cambio de cierre de jornada de operación no generó cambios contables importantes en los estados financieros consolidados.

#### Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

Mediante publicación en Diario Oficial de fecha 4 de diciembre de 2020, la Comisión Bancaria dió a conocer la obligatoriedad a partir del 1 de enero de 2022, para la adopción de las siguientes Normas de información financiera (NIF) emitidas por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera (CINIF):

- B-5, Información financiera por segmentos
  - B-12, Compensación de activos y pasivos financieros
  - B-17, Determinación del valor razonable
  - C-2, Inversión en instrumentos financieros
  - C-3, Cuentas por cobrar
  - C-9, Provisiones, contingencias y compromisos
  - C-13, Partes relacionadas
  - C-14, Transferencia y baja de activos financieros
  - C-10, Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura
  - C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar
  - C-19, Instrumentos financieros por pagar
  - C-20, Instrumentos financieros para cobrar principal e interés
  - D-1, Ingresos por contratos con clientes
  - D-2, Costos por contratos con clientes y
-

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 30 / 87  
CONSOLIDADO  
Impresión Final

•D-5, Arrendamientos

La Administración reconoció el efecto inicial por la entrada en vigor de esta norma, el cual considera inmaterial para efectos de los estados financieros consolidados en su conjunto.

Entre otros cambios relevantes y que entraron en vigor el 1 de enero de 2022 fueron a los Criterios Contables del Anexo 33 de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito:

- Criterio Contable B-1 Efectivo y equivalentes de efectivo (antes Disponibilidades).
- Criterio Contable B-3 Reportos
- Criterio Contable B-6 Cartera de Crédito
- Criterio Contable B-7 Bienes adjudicados
- Se derogan los criterios contables B-2 Inversiones en valores, B-5 Derivados y operaciones de cobertura, B-11 Derechos de cobro, C-1 Reconocimiento y baja de activos financieros, C-3 Partes relacionadas y C-4 Información por segmentos.

De acuerdo a los artículos transitorios mencionados en las Disposiciones, y como una solución práctica, las instituciones de crédito en la aplicación de los criterios de contabilidad contenidos en el Anexo 33 que se modifican, podrán reconocer en la fecha de aplicación inicial, es decir, el 1 de enero de 2022, el efecto acumulado de los cambios contables.

Asimismo, los estados financieros básicos (consolidados) trimestrales y anuales que sean requeridos a las instituciones, de conformidad con las Disposiciones correspondientes al periodo concluido el 31 de diciembre de 2022, no deberán presentarse comparativos con cada trimestre del ejercicio 2021 y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditos Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Acumulado Actual  
Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Tipo de Crédito / Institución Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]  
Desglose de créditos [partidas]  
Bancarios [sinopsis]  
BANCO DE MEXICO No 05/02/2021 26/01/2023 35.26 Variable MXN TOB CMP 1,182,129,055.56

TOTAL - 1,182,129,055.56 - - - - - - - - - -  
Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - -  
Banca comercial  
Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 23/06/2022 20/12/2022 22.9745



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 32 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202029/11/20228.1245	Tasa Fija 579,245.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202015/11/20237.3855	Tasa Fija 1,295,517.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202128/04/20268.118	Tasa Fija 2,061,539.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83	Tasa Fija 212,069.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83	Tasa Fija 1,641,638.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202109/09/20267.3627	Tasa Fija 142,570,386.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/09/202126/05/20268.1125	Tasa Fija 8,611,681.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/01/202126/01/20248.118	Tasa Fija 7,925,228.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202130/04/20245.87	Tasa Fija 153,415,952.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/08/202021/08/20235.69	Tasa Fija 3,507,191.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/09/202029/09/20235.78	Tasa Fija 2,119,053.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/09/202029/09/20235.78	Tasa Fija 7,822,790.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/09/202029/09/20235.59	Tasa Fija 9,224,037.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/03/201830/11/20228.09	Tasa Fija 177,880.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202128/02/20258.26	Tasa Fija 3,073,899.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20268.1125	Tasa Fija 11,425,772.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/04/201930/09/20238.1245	Tasa Fija 6,520,095.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/04/202107/04/20257.342	Tasa Fija 13,871,897.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/03/201715/03/20226.3256	Tasa Fija 2,359.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/201911/07/20227.3715	Tasa Fija 463,537.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/11/201826/06/20238.1125	Tasa Fija 293,471.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202021/04/20237.3335	Tasa Fija 3,687,155.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202014/03/20237.38	Tasa Fija 2,044,137.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202014/03/20237.38	Tasa Fija 227,200.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/05/202008/01/20247.3465	Tasa Fija 3,445,469.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/201730/11/20228.07	Tasa Fija 63,340.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/12/201817/10/20238.1245	Tasa Fija 11,146,621.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/201926/06/20238.1125	Tasa Fija 428,822.39

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 33 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201826/06/20238.1125 Tasa Fija 539,835.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/201817/08/20237.5825 Tasa Fija 1,211,373.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202113/12/20227.3715 Tasa Fija 10,036,857.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/20247.3335 Tasa Fija 508,106.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 2,392,197.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202030/05/20235.38 Tasa Fija 3,132,404.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/20257.342 Tasa Fija 4,396,414.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa Fija 6,277,775.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20232.13614 Tasa Fija 14,862,655.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201830/01/20232.13614 Tasa Fija 22,293,972.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/02/201830/01/20232.17614 Tasa Fija 52,019,338.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa Fija 15,798,921.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa Fija 4,000,109.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/20248.1125 Tasa Fija 1,941,428.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/20248.1125 Tasa Fija 3,525,284.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201809/02/20237.3627 Tasa Fija 945,430.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202104/05/20238.1245 Tasa Fija 10,002,256.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/05/202115/05/20257.3855 Tasa Fija 697,176.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/11/201731/10/20228.1245 Tasa Fija 2,122,278.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202107/07/20238.1245 Tasa Fija 11,002,482.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 13,305,438.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa Fija 11,888,785.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20227.635 Tasa Fija 981,410.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20227.635 Tasa Fija 2,224,529.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/11/202129/07/20227.635 Tasa Fija 3,268,347.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/04/201928/04/20238.1255 Tasa Fija 2,355,021.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/20268.1245 Tasa Fija 108,824,554.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/202111/07/20227.3715 Tasa Fija 903,317.18

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 34 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/20248.1245	Tasa Fija 5,401,218.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/20267.3855	Tasa Fija 279,070,787.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/20247.3335	Tasa Fija 782,447.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202118/02/20267.43	Tasa Fija 42,629,895.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202109/09/20228.1245	Tasa Fija 18,754,231.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202122/09/20227.455	Tasa Fija 5,009,318.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202105/09/20257.3855	Tasa Fija 869,919.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/20248.1245	Tasa Fija 2,760,484.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/10/201930/09/20228.1245	Tasa Fija 1,667,042.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/20248.1125	Tasa Fija 2,005,442.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202108/07/20228.1245	Tasa Fija 18,754,231.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/20267.43	Tasa Fija 235,533,515.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66	Tasa Fija 4,059,221.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202129/07/20228.3905	Tasa Fija 2,587,602.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202129/07/20228.3905	Tasa Fija 1,586,369.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202118/07/20227.43	Tasa Fija 902,043.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/20237.4375	Tasa Fija 14,561,476.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202021/03/20237.4375	Tasa Fija 1,451,968.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20268.1245	Tasa Fija 12,002,708.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20268.1245	Tasa Fija 8,001,805.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20268.1245	Tasa Fija 8,001,805.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/20268.1245	Tasa Fija 66,476,537.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/20247.4225	Tasa Fija 6,182,707.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/201729/07/20227.45	Tasa Fija 38,859.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/20258.1245	Tasa Fija 76,207,670.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202105/08/20228.1245	Tasa Fija 18,754,231.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28	Tasa Fija 8,584,830.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/201830/11/20238.1245	Tasa Fija 43,019,706.61

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 35 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/20257.3335	Tasa Fija 63,160,387.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa	Fija 13,960,065.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4 Tasa	Fija 37,513,487.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/07/202115/07/20257.3855	Tasa Fija 3,093,454.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa	Fija 1,494,567.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38 Tasa	Fija 2,304,211.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/09/202102/09/20267.33 Tasa	Fija 15,390,342.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/201823/05/20238.1245	Tasa Fija 24,484,707.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/11/202129/07/20227.635 Tasa	Fija 2,023,214.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/201824/05/20237.4913	Tasa Fija 2,609,057.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/20237.3855	Tasa Fija 455,824.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/20287.3465	Tasa Fija 145,820,927.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202119/11/20259.1245	Tasa Fija 102,025,852.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/20287.3465	Tasa Fija 55,739,577.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa	Fija 45,009,237.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39 Tasa	Fija 45,009,237.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202024/11/20258.1125	Tasa Fija 154,540,217.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202030/11/20227.635 Tasa	Fija 1,141,488.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201829/09/20238.1245	Tasa Fija 5,001,128.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202031/10/20227.2394	Tasa Fija 128,645.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201809/02/20237.3627	Tasa Fija 953,609.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202024/11/20258.1125	Tasa Fija 6,021,047.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/11/202024/11/20258.1125	Tasa Fija 120,420,948.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/05/202031/05/20238.1245	Tasa Fija 149,476.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202028/02/20237.635 Tasa	Fija 209,846.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/20248.1245	Tasa Fija 424,801.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/20268.1255	Tasa Fija 15,480,669.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/12/20228.3905	Tasa Fija 143,346.84

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 36 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28 Tasa Fija 8,084,743.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202031/01/20237.2394 Tasa Fija 130,500.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/12/20238.3905 Tasa Fija 209,503.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/11/202015/11/20247.3855 Tasa Fija 606,149.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202204/07/20227.3335 Tasa Fija 5,025,463.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202030/06/20238.1245 Tasa Fija 19,638,309.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/20247.635 Tasa Fija 432,730.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202028/02/20237.595 Tasa Fija 293,238.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/11/202030/06/20238.1245 Tasa Fija 10,964,012.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/20247.635 Tasa Fija 618,150.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/09/20238.3905 Tasa Fija 1,454,884.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/12/202113/07/20227.3715 Tasa Fija 903,317.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/20248.1245 Tasa Fija 28,830,034.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/01/202204/07/20227.3335 Tasa Fija 5,025,463.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/20237.325 Tasa Fija 2,012,208.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/20247.595 Tasa Fija 527,924.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201830/01/20238.1245 Tasa Fija 4,190,134.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/20238.1245 Tasa Fija 7,627,315.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/20237.38 Tasa Fija 741,776.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/20247.3335 Tasa Fija 321,266.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/20237.38 Tasa Fija 2,689,223.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/20257.367 Tasa Fija 30,129,069.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/11/201931/05/20248.1245 Tasa Fija 10,016,843.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 177,490,715.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 194,846,461.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa Fija 4,398,379.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14 Tasa Fija 219,482,967.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202129/05/20268.1245 Tasa Fija 37,748,630.23

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 37 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07 Tasa Fija 7,189,060.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/12/20227.3335 Tasa Fija 36,220,562.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202008/12/20237.3465 Tasa Fija 244,142.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/202008/12/20237.3465 Tasa Fija 75,352.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/09/20228.3905 Tasa Fija 213,580.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202030/06/20238.3905 Tasa Fija 685,371.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202015/12/20228.3905 Tasa Fija 2,344,371.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/20248.1125 Tasa Fija 5,657,199.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/20238.1245 Tasa Fija 7,627,315.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372 Tasa Fija 80,301.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/06/202019/11/20247.43 Tasa Fija 2,724,922.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372 Tasa Fija 34,540.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/20257.455 Tasa Fija 6,011,182.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/20258.1245 Tasa Fija 14,131,243.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/20248.1125 Tasa Fija 4,714,092.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202023/01/20257.4775 Tasa Fija 5,796,282.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202130/06/20268.1245 Tasa Fija 8,001,805.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202130/06/20268.1245 Tasa Fija 8,001,805.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/12/202120/07/20227.43 Tasa Fija 902,043.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/20258.1245 Tasa Fija 370,924,441.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/20238.1245 Tasa Fija 112,435,518.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/11/201902/06/20237.33 Tasa Fija 308,789.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20253.04614 Tasa Fija 8,596,516.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/20258.1245 Tasa Fija 125,030,710.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20253.04614 Tasa Fija 1,648,022.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/20237.43 Tasa Fija 8,874,268.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20253.04614 Tasa Fija 801,321.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/20248.1245 Tasa Fija 2,800,631.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20252.23614 Tasa Fija 775,812.91

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 38 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20252.56614	Tasa Fija 703,261.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/20258.1125	Tasa Fija 12,010,816.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202023/06/20238.1125	Tasa Fija 20,018,027.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 3,409,202.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 16,043,210.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 2,085,127.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 1,221,508.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/01/202205/07/20228.1372	Tasa Fija 10,342.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 446,952.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 4,299,314.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 12,353,566.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202205/08/20227.3335	Tasa Fija 1,012,128.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/20248.1125	Tasa Fija 7,256,535.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202029/09/20238.1245	Tasa Fija 26,452,958.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/20257.4375	Tasa Fija 68,140,486.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/01/201929/09/20238.1245	Tasa Fija 2,500,564.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20258.1125	Tasa Fija 32,479,250.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202105/08/20227.3335	Tasa Fija 70,356,489.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20258.1245	Tasa Fija 33,007,447.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20258.1125	Tasa Fija 33,029,745.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/20258.1125	Tasa Fija 33,029,745.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202108/07/20227.3465	Tasa Fija 904,224.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/202121/07/20227.4375	Tasa Fija 300,619.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/201827/04/20238.1125	Tasa Fija 9,209,627.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/20257.3855	Tasa Fija 1,463,120.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54	Tasa Fija 5,724,489.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/201720/12/20237.62	Tasa Fija 5,290,950.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/12/202029/12/20228.1245	Tasa Fija 1,361,217.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/20248.1245	

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 39 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 16,474,305.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/202115/07/20227.3855	
Tasa Fija 902,954.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20227.38	Tasa
Fija 9,722,640.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20227.38	Tasa
Fija 7,557,370.87	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20227.38	Tasa
Fija 40,326,173.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20227.38	Tasa
Fija 21,418,258.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202102/06/20238.1245	
Tasa Fija 14,003,159.54	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/20247.3335	
Tasa Fija 529,344.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/07/202130/06/20268.1245	
Tasa Fija 6,401,444.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202113/01/20257.3715	
Tasa Fija 170,703,784.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/20267.4775	
Tasa Fija 1,958,248.48	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 16,474,305.34	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/201830/11/20228.1245	
Tasa Fija 15,174,011.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/12/201915/12/20237.3855	
Tasa Fija 683,987.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/20257.367	Tasa
Fija 5,453,871.11	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/20268.1255	
Tasa Fija 14,706,635.85	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202130/06/20268.1245	
Tasa Fija 1,600,357.79	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 6,551,986.90	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/20247.4225	
Tasa Fija 4,270,793.59	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 4,530,433.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77	Tasa
Fija 25,373,936.93	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/20258.1125	
Tasa Fija 7,387,605.45	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/20258.1245	
Tasa Fija 21,090,325.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/20248.1245	
Tasa Fija 7,251,636.20	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/201915/11/20227.3855	
Tasa Fija 55,971.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/20268.1245	
Tasa Fija 7,876,777.27	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/20267.33	Tasa
Fija 14,753,269.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51	Tasa
Fija 5,147,454.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202109/06/20238.1245	

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Tasa Fija 10,002,256.83	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/20267.3335
Tasa Fija 107,879,950.72	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/201815/06/20237.3855
Tasa Fija 39,210,297.40	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/20248.1255
Tasa Fija 125,157,931.14	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202117/06/20266.29 Tasa
Fija 18,017,298.13	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/09/202029/08/20238.1255
Tasa Fija 10,635,751.23	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 2,409,074.63	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 3,100,021.24	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/20257.4375
Tasa Fija 6,513,428.81	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/10/201729/07/20227.55 Tasa
Fija 46,024.99	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202012/01/20247.3715
Tasa Fija 19,375,610.82	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa
Fija 1,260,089.23	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/20257.4375
Tasa Fija 6,513,428.81	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/20237.33 Tasa
Fija 1,257,380.79	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/201902/06/20237.33 Tasa
Fija 276,623.73	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/20257.4913
Tasa Fija 19,369,183.67	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/20257.4025
Tasa Fija 36,854,063.15	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/20252.66271
Tasa Fija 20,852,292.26	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/20247.3335
Tasa Fija 10,553,473.38	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202015/03/20237.3855
Tasa Fija 10,032,824.45	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/06/201902/06/20237.33 Tasa
Fija 1,005,904.83	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/201714/09/20227.54 Tasa
Fija 264,094.76	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/20248.1125
Tasa Fija 2,773,330.97	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 1,608,783.85	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 13,179,443.89	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202118/02/20267.43 Tasa
Fija 37,791,402.63	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201829/12/20238.1245
Tasa Fija 17,703,994.60	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201829/12/20238.1245
Tasa Fija 30,006,770.41	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/20247.4225

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 41 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 3,864,723.12	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/20257.3855	
Tasa Fija 1,598,981.37	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/201809/02/20237.3627	
Tasa Fija 730,559.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/202103/03/20238.1245	
Tasa Fija 10,002,256.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/20248.1125	
Tasa Fija 8,249,534.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/201730/11/20227.62 Tasa	
Fija 22,622,145.37	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/12/201730/11/20227.62 Tasa	
Fija 19,924,491.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202103/03/20238.1245	
Tasa Fija 10,002,256.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/20247.3335	
Tasa Fija 647,930.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202130/06/20268.1245	
Tasa Fija 8,001,805.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/03/201830/11/20228.1245	
Tasa Fija 23,410,330.06	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/06/202130/06/20268.1245	
Tasa Fija 9,202,076.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20242.46514	
Tasa Fija 20,150,467.52	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20252.80429	
Tasa Fija 11,553,307.74	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/20267.4775	
Tasa Fija 13,531,113.54	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/20248.1245	
Tasa Fija 2,778,539.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/201831/07/20238.39 Tasa	
Fija 2,080,484.77	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/20248.1245	
Tasa Fija 9,251,248.73	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/20258.1245	
Tasa Fija 73,268,468.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201831/01/20238.1245	
Tasa Fija 44,801,757.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/20257.3335	
Tasa Fija 8,543,288.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/20237.38 Tasa	
Fija 5,913,871.57	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/20257.4025	
Tasa Fija 9,145,220.44	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/20257.4025	
Tasa Fija 8,073,702.31	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/20248.1125	
Tasa Fija 5,254,732.29	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 1,293,310.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 3,755,817.04	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8 Tasa	
Fija 3,036,449.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/06/201931/05/20248.1245	

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Tasa Fija 56,841,992.00				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo07/07/202101/03/20238.1245	
Tasa Fija 14,003,159.54				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo09/02/201809/02/20237.3627	
Tasa Fija 1,339,359.34				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo17/08/201809/02/20237.3627	
Tasa Fija 833,379.38				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo17/08/201809/02/20237.3627	
Tasa Fija 744,088.72				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo08/07/202103/07/20238.1245	
Tasa Fija 18,004,062.25				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo21/12/201829/12/20238.1245	
Tasa Fija 75,829,609.38				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo07/05/202107/05/20267.342	Tasa
Fija 39,358,374.49				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo07/05/202115/04/20257.3855	
Tasa Fija 3,908,621.19				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo28/06/201914/12/20237.38	Tasa
Fija 4,086,784.45				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo02/03/201828/02/20238.1245	
Tasa Fija 8,001,805.45				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo03/07/201901/07/20227.3355	
Tasa Fija 1,676,175.59				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo09/03/201830/11/20228.1245	
Tasa Fija 6,333,693.06				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo09/03/201830/11/20228.1245	
Tasa Fija 6,787,795.49				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo04/07/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 51,851,560.00				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo14/03/201809/02/20237.3627	
Tasa Fija 1,362,060.29				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo19/07/201927/06/20248.1245	
Tasa Fija 6,606,731.11				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo19/07/201927/06/20248.1245	
Tasa Fija 5,560,569.93				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo19/07/201927/06/20248.1245	
Tasa Fija 1,213,608.19				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo19/07/201927/06/20248.1245	
Tasa Fija 21,426,944.38				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo11/09/201831/08/20238.1245	
Tasa Fija 248,976.18				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo11/09/201831/08/20238.1245	
Tasa Fija 166,077.42				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo25/07/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 4,872,524.96				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo20/09/201831/08/20238.54	Tasa
Fija 259,341.54				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo07/08/201928/06/20248.1245	
Tasa Fija 5,518,662.44				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo27/09/201829/12/20238.1245	
Tasa Fija 16,503,723.72				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa
Fija 60,858.92				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa
Fija 60,858.92				
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS	EN RELACIÓN	CON LA	AGRICULTURANo01/10/201815/09/20229.39	Tasa



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 43 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Fija 60,858.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/201829/09/20238.1245  
Tasa Fija 12,502,821.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/20248.1245  
Tasa Fija 833,521.47  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201809/02/20237.3627  
Tasa Fija 811,342.73  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/08/201929/08/20238.1245  
Tasa Fija 55,096,491.49  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/201915/09/20237.3855  
Tasa Fija 1,139,979.63  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 526,723.25  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 12,169,123.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 12,714,010.26  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 3,632,574.34  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 3,632,574.34  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/20247.3855  
Tasa Fija 3,632,574.34  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/201931/05/20248.1245  
Tasa Fija 28,996,125.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201828/04/20239.29 Tasa  
Fija 6,601,703.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201828/04/20239.29 Tasa  
Fija 1,400,361.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202205/08/20227.3335  
Tasa Fija 19,599,307.81  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202204/08/20227.3335  
Tasa Fija 20,101,854.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202208/08/20227.3465  
Tasa Fija 11,064,793.07  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/01/202203/08/20227.3355  
Tasa Fija 10,057,053.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/01/202201/07/20228.0907 Tasa Fija 14,972.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/01/202211/07/20228.0626 Tasa Fija 3,584,270.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202212/07/20228.0626 Tasa Fija 365,737.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 1,808,697.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 563,502.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/01/202207/07/20228.0626 Tasa Fija 1,426,986.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/01/202218/01/20237.43 Tasa  
Fija 20,045,405.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/01/202230/12/20228.1245  
Tasa Fija 8,001,805.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202218/07/20228.1536 Tasa Fija 1,668,167.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202207/07/20228.1536 Tasa Fija 134,562.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202205/07/20228.1536 Tasa Fija 28,714.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202214/07/20228.1351 Tasa Fija 904,289.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202214/07/20228.1351 Tasa Fija 216,351.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202215/07/20228.1351 Tasa Fija 139,265.43  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/01/202220/07/20227.43 Tasa  
Fija 17,038,594.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202222/08/20227.455 Tasa

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 44 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Fija 3,506,523.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202222/07/20227.455 Tasa Fija 17,031,683.76  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/01/202223/08/20227.4775 Tasa Fija 3,505,815.83  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202225/07/20228.1125 Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202225/07/20228.1125 Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202225/07/20228.1125 Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202225/07/20228.1125 Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202225/07/20228.1125 Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/01/202224/08/20227.4913 Tasa Fija 2,002,913.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/01/202223/09/20228.1245 Tasa Fija 18,754,231.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202214/07/20228.1446 Tasa Fija 186,581.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/01/202205/07/20228.1446 Tasa Fija 36,589.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202221/07/20228.1802 Tasa Fija 1,900,659.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802 Tasa Fija 6,950.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802 Tasa Fija 37,891.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/01/202226/07/20228.1802 Tasa Fija 44,815.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/01/202212/07/20228.1335 Tasa Fija 73,949.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202205/07/20228.1536 Tasa Fija 46,694.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/01/202219/07/20228.1351 Tasa Fija 26,804.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/01/202212/07/20228.1334 Tasa Fija 57,548.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202212/07/20228.1536 Tasa Fija 142,215.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/01/202222/07/20228.1108 Tasa Fija 219,403.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202225/07/20228.2557 Tasa Fija 10,783,091.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/01/202229/06/20228.1536 Tasa Fija -  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202222/07/20228.2557 Tasa Fija 42,985.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202221/06/20228.2557 Tasa Fija 129,387.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202229/07/20228.2557 Tasa Fija 5,915,415.69  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/02/202229/07/20228.1255 Tasa Fija 2,701,218.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/02/202221/07/20228.2729 Tasa Fija 489,944.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/02/202201/08/20227.325 Tasa Fija 1,423,637.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202226/07/20228.293 Tasa Fija 151,360.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202205/07/20228.293 Tasa Fija 109,221.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/02/202226/07/20228.293 Tasa Fija 64,132.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908 Tasa Fija 28,084.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202201/07/20228.2908 Tasa Fija 140,496.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908 Tasa Fija 24,926.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908 Tasa Fija 188,061.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202228/07/20228.2908 Tasa Fija 2,007,386.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202221/07/20228.2908 Tasa Fija 2,759,686.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908 Tasa Fija 30,664.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202214/07/20228.2908 Tasa Fija 1,038,301.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202202/08/20228.2908 Tasa Fija 21,205.01  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202229/07/20228.2908 Tasa Fija 1,024,321.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/02/202218/07/20228.2908 Tasa Fija 1,447,073.32  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/02/202203/08/20227.3335

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 45 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 12,068,446.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07 Tasa Fija 61,375,778.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/01/202229/07/20228.2557 Tasa Fija 1,939,864.79  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202202/08/20228.3001 Tasa Fija 5,654.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/02/202205/07/20228.3001 Tasa Fija 289,732.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202219/07/20228.3342 Tasa Fija 60,447.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/02/202208/08/20228.3342 Tasa Fija 119,272.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202205/08/20228.364 Tasa Fija 2,100,662.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202208/08/20228.364 Tasa Fija 894,844.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/02/202225/07/20228.364 Tasa Fija 667,885.20  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202208/09/20227.3465  
Tasa Fija 4,018,774.39  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 79,843,597.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202230/12/20228.1245  
Tasa Fija 4,000,902.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 35,427,653.81  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 14,330,631.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202209/08/20228.4097 Tasa Fija 66,579.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 8,434,014.05  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 71,409,583.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202210/08/20228.4097 Tasa Fija 52,276.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202226/07/20228.4097 Tasa Fija 415,196.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097 Tasa Fija 3,245,878.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097 Tasa Fija 1,270,280.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202209/08/20228.4097 Tasa Fija 67,019.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/02/202204/08/20228.4097 Tasa Fija 426,600.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/02/202204/08/20228.4282 Tasa Fija 1,005,811.42  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202214/02/20237.38 Tasa Fija 40,139,400.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202212/02/20277.38 Tasa Fija 93,658,599.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202212/07/20228.546 Tasa Fija 139,025.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/02/202202/08/20228.546 Tasa Fija 19,106.71  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202221/09/20228.1245  
Tasa Fija 15,003,385.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202215/08/20228.5537 Tasa Fija 315,977.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202215/07/20228.5537 Tasa Fija 165,352.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/02/202216/08/20228.5537 Tasa Fija 67,963.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202226/07/20228.5179 Tasa Fija 300,954.95  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202216/08/20228.5179 Tasa Fija 9,102.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202216/08/20228.5179 Tasa Fija 22,548.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 2,715,073.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 798,331.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202221/07/20228.5179 Tasa Fija 1,296,841.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/02/202211/08/20228.5179 Tasa Fija 3,466,835.30  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/20277.4225  
Tasa Fija 38,552,038.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202222/07/20228.5309 Tasa Fija 598,189.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309 Tasa Fija 9,286.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309 Tasa Fija 15,366.61

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 46 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202216/08/20228.5309	Tasa Fija	6,860.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202220/12/20287.4	Tasa Fija	32,067,564.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202210/08/20228.5309	Tasa Fija	63,647.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202217/08/20228.5309	Tasa Fija	92,751.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/02/202226/07/20228.5309	Tasa Fija	9,596.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202215/08/20228.5787	Tasa Fija	858,103.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202209/08/20228.5787	Tasa Fija	108,220.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/02/202219/08/20228.5787	Tasa Fija	95,321.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/02/202219/08/20228.5787	Tasa Fija	127,752.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/02/202219/09/20228.1245	Tasa Fija	15,003,385.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202209/08/20228.5802	Tasa Fija	5,683.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202212/07/20228.5802	Tasa Fija	23,709.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802	Tasa Fija	31,042.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802	Tasa Fija	245,574.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/02/202223/08/20228.5802	Tasa Fija	32,645.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202216/08/20228.5764	Tasa Fija	2,107.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202223/08/20228.5764	Tasa Fija	161,031.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202216/08/20228.5764	Tasa Fija	1,188,439.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202224/08/20228.5764	Tasa Fija	73,379.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/08/20228.5764	Tasa Fija	2,126,601.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/02/202218/08/20228.5764	Tasa Fija	2,072,930.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202216/01/20237.4025	Tasa Fija	10,030,843.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202226/01/20238.1125	Tasa Fija	15,013,520.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202231/01/20238.1245	Tasa Fija	15,003,385.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/02/202220/02/20237.43	Tasa Fija	2,004,540.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202208/07/20228.5997	Tasa Fija	104,027.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202224/08/20228.5997	Tasa Fija	162,904.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202218/08/20228.5997	Tasa Fija	665,745.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/02/202223/08/20228.5997	Tasa Fija	27,393.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202226/08/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/02/202226/08/20228.1125	Tasa Fija	6,005,408.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/03/202226/08/20228.634	Tasa Fija	1,309,994.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/03/202229/08/20228.1255	Tasa Fija	10,004,514.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/03/202229/08/20228.1255	Tasa Fija	8,003,611.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija	1,886,257.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202226/08/20228.6173	Tasa Fija	1,018,200.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija	149,618.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202225/08/20228.6173	Tasa Fija	2,520,199.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/03/202223/08/20228.6173	Tasa Fija	6,027.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202224/06/20227.6937	Tasa Fija	292.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202215/07/20228.6437	Tasa Fija	133,851.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202225/08/20228.6437	Tasa Fija	919,237.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437	Tasa Fija	293,304.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437	Tasa Fija	42,619.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202225/08/20228.6437	Tasa Fija	528,234.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202231/08/20228.6437	Tasa Fija	265,194.30

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 47 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202230/08/20228.6437 Tasa Fija	28,499.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/03/202218/08/20228.6437 Tasa Fija	1,543,449.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/03/202231/08/20228.1245 Tasa Fija	8,001,805.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202231/08/20228.6786 Tasa Fija	102,772.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/03/202229/08/20228.6786 Tasa Fija	391,123.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202202/09/20227.33 Tasa Fija	15,088,570.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/03/202228/02/20237.635 Tasa Fija	1,509,861.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202202/09/20228.7265 Tasa Fija	1,061,685.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202223/08/20228.7265 Tasa Fija	20,359.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202202/09/20227.33 Tasa Fija	5,029,523.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/03/202216/08/20228.7265 Tasa Fija	77,764.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/03/202202/09/20227.33 Tasa Fija	3,017,714.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202205/07/20227.6805 Tasa Fija	204,872.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/03/202205/09/20228.7962 Tasa Fija	509,634.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202224/06/20227.685 Tasa Fija	66,039.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202206/07/20227.685 Tasa Fija	2,450,348.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202206/09/20227.3335 Tasa Fija	5,025,463.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202206/09/20228.8791 Tasa Fija	133,741.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202208/07/20227.685 Tasa Fija	732,236.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/03/202223/08/20228.8791 Tasa Fija	308,353.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202209/12/20227.367 Tasa Fija	8,602,811.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202217/05/20227.7225 Tasa Fija	407,228.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202230/05/20227.7225 Tasa Fija	131,630.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225 Tasa Fija	1,542,251.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225 Tasa Fija	2,500.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225 Tasa Fija	1,140,236.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225 Tasa Fija	771,708.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565 Tasa Fija	1,590,966.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565 Tasa Fija	1,311,939.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202220/02/20237.43 Tasa Fija	4,009,081.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202208/07/20227.3465 Tasa Fija	1,004,693.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225 Tasa Fija	1,487,390.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202204/07/20227.7225 Tasa Fija	990,504.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202206/07/20227.7225 Tasa Fija	27,699.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565 Tasa Fija	497,942.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202205/07/20227.7225 Tasa Fija	6,938.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/03/202201/09/20228.8565 Tasa Fija	1,466,309.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202213/01/20237.3715 Tasa Fija	3,350,277.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202206/09/20227.3335 Tasa Fija	20,101,854.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202201/07/20227.7075 Tasa Fija	1,436,428.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202204/07/20227.7075 Tasa Fija	250,648.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906 Tasa Fija	174,412.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906 Tasa Fija	30,712.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906 Tasa Fija	10,120.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202201/09/20228.906 Tasa Fija	1,250,980.72

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 48 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202206/09/20228.906	Tasa Fija	725,232.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/03/202209/09/20228.906	Tasa Fija	129,771.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/03/202209/09/20227.3627	Tasa Fija	5,022,497.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202206/07/20227.7412	Tasa Fija	37,691.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202209/09/20228.9277	Tasa Fija	5,538.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202209/09/20228.9277	Tasa Fija	168,192.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202219/08/20228.9277	Tasa Fija	11,697.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202206/09/20228.9277	Tasa Fija	125,317.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/03/202212/07/20227.7412	Tasa Fija	2,046,017.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202220/02/20237.43	Tasa Fija	1,002,270.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202228/02/20237.635	Tasa Fija	1,006,574.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/03/202209/12/20227.367	Tasa Fija	2,008,595.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202201/07/20227.761	Tasa Fija	350,890.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202226/05/20227.761	Tasa Fija	293,270.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202206/07/20227.761	Tasa Fija	6,307,234.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202229/07/20228.9798	Tasa Fija	95,979.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202216/08/20228.9798	Tasa Fija	94,299.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202204/07/20227.761	Tasa Fija	33,162.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/03/202204/07/20227.761	Tasa Fija	16,591.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202212/10/20227.3715	Tasa Fija	10,036,857.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202212/09/20227.3715	Tasa Fija	5,018,428.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202214/07/20227.38	Tasa Fija	1,003,485.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/03/202212/09/20228.1245	Tasa Fija	40,253,110.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202213/07/20227.7641	Tasa Fija	137,808.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	105,084.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202216/08/20228.9767	Tasa Fija	67,270.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202215/07/20227.7641	Tasa Fija	15,461.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	17,963.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202204/07/20227.7641	Tasa Fija	25,480.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202222/08/20228.9767	Tasa Fija	814,269.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202215/07/20227.3855	Tasa Fija	601,969.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/03/202212/09/20228.9767	Tasa Fija	176,505.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202213/10/20227.3715	Tasa Fija	7,025,800.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202213/10/20227.3715	Tasa Fija	3,011,057.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/03/202209/09/20227.3627	Tasa Fija	20,089,988.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202208/07/20227.8025	Tasa Fija	19,961.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/07/20227.8025	Tasa Fija	51,337.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/06/20227.8025	Tasa Fija	78,685.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716	Tasa Fija	72,888.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716	Tasa Fija	936,435.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716	Tasa Fija	3,074,886.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/07/20227.8025	Tasa Fija	284,114.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025	Tasa Fija	238,702.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202207/07/20227.8025	Tasa Fija	134,452.45

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716 Tasa Fija	143,567.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202208/09/20228.9716 Tasa Fija	264,318.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/03/202214/09/20227.38 Tasa Fija	5,017,425.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/03/202215/07/20227.3855 Tasa Fija	1,003,282.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025 Tasa Fija	1,213.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202211/07/20227.8025 Tasa Fija	36,679.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202213/09/20228.9716 Tasa Fija	10,029.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/03/202214/09/20228.9716 Tasa Fija	205,183.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202201/07/20227.805 Tasa Fija	1,013,762.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/07/20227.805 Tasa Fija	131,364.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202213/06/20227.805 Tasa Fija	2,219,319.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija	1,999,490.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija	1,122,929.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202211/07/20227.805 Tasa Fija	479,415.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202204/07/20227.805 Tasa Fija	149,951.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202206/07/20227.805 Tasa Fija	142,656.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202215/09/20227.3855 Tasa Fija	5,016,412.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/03/202215/09/20228.9365 Tasa Fija	184,413.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202214/09/20227.38 Tasa Fija	20,069,700.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202220/07/20227.43 Tasa Fija	4,009,081.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202208/07/20227.845 Tasa Fija	99,134.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202211/07/20227.845 Tasa Fija	12,040.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202220/07/20227.845 Tasa Fija	1,006,543.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202213/07/20227.845 Tasa Fija	5,711,904.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202209/09/20229.0675 Tasa Fija	2,263,604.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202208/09/20229.0675 Tasa Fija	1,344,096.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202205/07/20227.845 Tasa Fija	29,018.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202215/09/20229.0675 Tasa Fija	379,231.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202226/08/20229.0675 Tasa Fija	11,273.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202208/09/20229.0675 Tasa Fija	1,285,205.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202219/09/20227.43 Tasa Fija	5,011,351.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202221/07/20227.4375 Tasa Fija	1,002,065.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202208/07/20227.845 Tasa Fija	49,052.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202220/07/20227.845 Tasa Fija	47,684.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202212/09/20229.0675 Tasa Fija	1,036,616.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/03/202219/09/20229.0675 Tasa Fija	625,210.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202221/07/20227.4375 Tasa Fija	4,008,263.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/03/202213/01/20237.3715 Tasa Fija	2,028,529.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202213/07/20227.845 Tasa Fija	98,171.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202225/05/20227.845 Tasa Fija	37,265.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202211/07/20227.845 Tasa Fija	61,025.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202205/08/20229.191 Tasa Fija	291,501.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202209/09/20229.191 Tasa Fija	697,154.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202222/07/20227.455 Tasa Fija	1,001,863.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/03/202211/07/20227.845 Tasa Fija	255,124.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202220/10/20227.43 Tasa	

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 50 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Fija 5,011,351.39  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/03/202220/09/20227.43 Tasa  
Fija 2,505,675.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202217/06/20227.8594 Tasa Fija 15,937.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202231/05/20227.8594 Tasa Fija 46,387.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20227.8594 Tasa Fija 96,723.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202213/07/20227.8594 Tasa Fija 1,181,342.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20227.8594 Tasa Fija 4,685.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/07/20227.8594 Tasa Fija 121,176.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202207/07/20227.8594 Tasa Fija 1,271,666.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202207/09/20229.2148 Tasa Fija 78,036.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202215/09/20229.2148 Tasa Fija 3,219,621.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202215/09/20229.2148 Tasa Fija 1,710,983.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202208/07/20227.8594 Tasa Fija 280,865.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/07/20227.8594 Tasa Fija 1,194,677.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202220/09/20229.2148 Tasa Fija 13,757.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202208/09/20229.2148 Tasa Fija 756,644.12  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20227.4375  
Tasa Fija 5,010,329.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija 793,382.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija 283,502.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202222/07/20227.455 Tasa  
Fija 1,001,863.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202218/07/20227.8594 Tasa Fija 143,640.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202201/09/20229.2148 Tasa Fija 766,342.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/03/202211/07/20222.78971 Tasa Fija 393,907.88  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20227.4375  
Tasa Fija 20,041,319.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202221/09/20227.4375  
Tasa Fija 2,505,164.93  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202222/07/20227.455 Tasa  
Fija 1,001,863.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202214/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/03/202231/08/20258.765 Tasa  
Fija 25,188,690.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202211/07/20222.82586 Tasa Fija 42,305.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202222/06/20228.165 Tasa Fija 230,275.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165 Tasa Fija 1,752,177.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202222/07/20228.165 Tasa Fija 2,042,639.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165 Tasa Fija 1,702,517.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202230/08/20229.1478 Tasa Fija 17,827.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478 Tasa Fija 74,721.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202215/09/20229.1478 Tasa Fija 2,289,346.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478 Tasa Fija 95,776.87  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202220/07/20228.165 Tasa Fija 2,585.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202220/09/20229.1478 Tasa Fija 213,916.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202223/09/20227.4775  
Tasa Fija 5,008,308.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202220/06/20228.165 Tasa Fija 116,633.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/03/202218/07/20228.165 Tasa Fija 1,697.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202213/01/20237.3715  
Tasa Fija 2,008,071.71  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202223/09/20227.4775  
Tasa Fija 5,789,898.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202223/06/20228.1725 Tasa Fija 116,751.50

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 51 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202218/07/20228.1725	Tasa Fija	15,919.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202208/07/20228.1725	Tasa Fija	70,463.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202223/09/20229.2807	Tasa Fija	531,581.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202221/09/20229.2807	Tasa Fija	40,469.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202209/09/20229.2807	Tasa Fija	313,393.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202223/08/20229.2807	Tasa Fija	41,476.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202227/07/20228.1125	Tasa Fija	1,000,901.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202209/08/20229.2807	Tasa Fija	3,661,918.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202219/09/20229.2807	Tasa Fija	244,729.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/03/202230/08/20229.2807	Tasa Fija	177,590.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202227/07/20228.1125	Tasa Fija	1,000,901.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202219/07/20228.1245	Tasa Fija	1,000,225.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/03/202223/09/20227.4775	Tasa Fija	4,197,964.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202206/07/20228.1765	Tasa Fija	20,928.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202220/07/20228.1765	Tasa Fija	2,701,716.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/03/202215/07/20228.1765	Tasa Fija	155,087.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	2,983,016.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	3,002,029.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	3,002,029.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	3,002,029.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	3,002,029.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	3,002,029.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202226/09/20228.0125	Tasa Fija	2,447,176.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202226/10/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202208/08/20227.3465	Tasa Fija	10,046,935.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202210/08/20227.367	Tasa Fija	10,042,974.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202212/08/20227.3715	Tasa Fija	10,036,857.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202215/08/20227.3855	Tasa Fija	10,032,824.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202217/08/20227.4225	Tasa Fija	10,028,865.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202225/07/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	5,003,382.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202228/07/20228.118	Tasa Fija	5,003,382.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202226/07/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/03/202227/07/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 52 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202215/07/20228.1765 Tasa Fija 2,012,628.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202227/07/20228.1765 Tasa Fija 444,947.55  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 1,000,451.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202218/07/20228.1765 Tasa Fija 5,056.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202209/09/20229.2343 Tasa Fija 933,577.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/03/202206/09/20229.2343 Tasa Fija 5,541.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202229/08/20228.1255  
Tasa Fija 10,004,514.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202222/08/20227.455 Tasa  
Fija 10,018,637.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202202/09/20227.33 Tasa  
Fija 10,059,047.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202224/08/20227.4913  
Tasa Fija 10,014,566.42  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202226/08/20228.1125  
Tasa Fija 10,009,013.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202207/09/20227.342 Tasa  
Fija 10,048,946.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202219/08/20227.43 Tasa  
Fija 10,022,702.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202205/09/20227.3335  
Tasa Fija 10,050,927.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202227/09/20228.1125  
Tasa Fija 2,502,253.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202220/07/20228.17 Tasa Fija 218,205.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202211/07/20228.17 Tasa Fija 13,854.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202227/09/20229.2343 Tasa Fija 248,793.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202222/09/20229.2343 Tasa Fija 343,381.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202222/09/20229.2343 Tasa Fija 1,990,919.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202227/09/20229.2343 Tasa Fija 4,355.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202220/07/20228.17 Tasa Fija 80,804.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202215/09/20229.2343 Tasa Fija 1,764,451.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202222/09/20229.2343 Tasa Fija 507,502.31  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 1,000,451.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202204/07/20228.17 Tasa Fija 424,500.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202225/07/20228.17 Tasa Fija 33,223.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202219/09/20229.2343 Tasa Fija 54,801.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202211/07/20228.17 Tasa Fija 508,411.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202225/07/20228.17 Tasa Fija 218,239.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202222/09/20229.2343 Tasa Fija 1,137,791.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/04/202227/09/20229.2343 Tasa Fija 103,590.06  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 53 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202229/07/20228.1255  
Tasa Fija 5,002,257.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202226/09/20228.1125  
Tasa Fija 5,004,506.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202219/09/20227.43 Tasa  
Fija 10,022,702.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202212/09/20227.3715  
Tasa Fija 10,036,857.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202209/09/20227.3627  
Tasa Fija 10,044,994.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202228/09/20228.118 Tasa  
Fija 2,451,657.43  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202227/09/20228.1125  
Tasa Fija 20,018,027.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202227/06/20228.165 Tasa Fija 4,065,645.01  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202204/07/20228.165 Tasa Fija 196,227.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202225/07/20228.165 Tasa Fija 130,387.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202225/07/20228.165 Tasa Fija 1,283,883.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202225/07/20228.165 Tasa Fija 4,382,084.79  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202211/07/20228.165 Tasa Fija 185,497.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202225/07/20228.165 Tasa Fija 37,863.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202227/06/20228.165 Tasa Fija 92,076.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202225/07/20228.165 Tasa Fija 761.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202227/07/20228.165 Tasa Fija 197,788.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202208/08/20229.1857 Tasa Fija 1,350,195.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/04/202229/07/20228.165 Tasa Fija 281,038.26  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202202/08/20227.33 Tasa  
Fija 20,118,094.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202223/09/20227.4775  
Tasa Fija 5,826,064.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/04/202229/09/20228.1255  
Tasa Fija 2,381,074.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202214/07/20228.165 Tasa Fija 402,783.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202218/07/20228.165 Tasa Fija 79,688.01  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202211/07/20228.165 Tasa Fija 260,598.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202221/07/20228.165 Tasa Fija 1,330,688.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202213/09/20229.2703 Tasa Fija 25,252.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202220/07/20228.165 Tasa Fija 202,870.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202227/09/20229.2703 Tasa Fija 28,952.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202220/07/20228.165 Tasa Fija 410,830.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202230/08/20229.2703 Tasa Fija 90,513.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202230/09/20229.2703 Tasa Fija 367,286.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202201/07/20227.015 Tasa  
Fija 2,483,445.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202201/07/20228.165 Tasa Fija 945,927.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/04/202204/07/20228.165 Tasa Fija 81,542.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202204/07/20227.3335  
Tasa Fija 2,512,731.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202230/09/20228.1245  
Tasa Fija 20,004,513.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202230/09/20228.1245  
Tasa Fija 50,011,284.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202225/07/20222.89271 Tasa Fija 240,250.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202227/07/20228.1575 Tasa Fija 226,237.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202212/08/20229.2635 Tasa Fija 131,308.46

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 54 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202205/07/20228.1575	Tasa Fija	28,438.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202225/07/20228.1575	Tasa Fija	71,890.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202203/08/20228.1575	Tasa Fija	129,889.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202203/08/20228.1575	Tasa Fija	22,872.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202228/09/20229.2635	Tasa Fija	413,890.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202225/07/20228.1575	Tasa Fija	122,718.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202211/07/20228.1575	Tasa Fija	13,065.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202218/07/20228.1575	Tasa Fija	64,983.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202228/09/20229.2635	Tasa Fija	41,969.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/04/202225/07/20228.1575	Tasa Fija	28,948.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202203/10/20227.3355	Tasa Fija	5,028,526.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202205/07/20227.3335	Tasa Fija	408,193.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202205/07/20227.3335	Tasa Fija	467,870.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202205/07/20227.3335	Tasa Fija	453,548.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202205/07/20227.3335	Tasa Fija	2,512,731.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202227/07/20228.1245	Tasa Fija	1,000,225.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202203/10/20227.3355	Tasa Fija	2,514,263.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/04/202204/08/20227.3335	Tasa Fija	1,005,092.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202203/11/20227.3355	Tasa Fija	5,028,526.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202226/07/20228.1637	Tasa Fija	13,751.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202227/07/20228.1637	Tasa Fija	152,195.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202225/07/20228.1637	Tasa Fija	15,421.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202211/07/20228.1637	Tasa Fija	1,906,851.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202213/09/20229.2937	Tasa Fija	13,912.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202203/08/20228.1637	Tasa Fija	126,027.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202201/07/20228.1637	Tasa Fija	48,273.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202218/07/20228.1637	Tasa Fija	153,791.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202204/08/20228.1637	Tasa Fija	701,731.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202227/07/20228.1637	Tasa Fija	132,750.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202205/08/20227.3335	Tasa Fija	402,037.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202225/07/20228.1637	Tasa Fija	88,260.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202211/07/20228.1637	Tasa Fija	1,547,986.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/04/202227/07/20228.1637	Tasa Fija	14,187.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202228/07/20228.1245	Tasa Fija	1,000,225.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202205/07/20227.0137	Tasa Fija	1,587,936.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202206/07/20227.3335	Tasa Fija	439,941.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202206/07/20227.3335	Tasa Fija	426,335.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202206/07/20227.3335	Tasa Fija	422,038.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202206/07/20227.3335	Tasa Fija	453,548.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202206/07/20227.3335	Tasa Fija	

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 55 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 2,512,731.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202205/08/20227.3335  
Tasa Fija 1,005,092.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202225/07/20222.90171 Tasa Fija 26,323.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202217/06/20228.1718 Tasa Fija 2,253,887.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202204/08/20228.1718 Tasa Fija 313,074.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202201/07/20228.1718 Tasa Fija 251,918.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202211/07/20228.1718 Tasa Fija 290,104.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202212/08/20229.306 Tasa Fija 13,215.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202204/10/20229.306 Tasa Fija 60,048.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202229/09/20229.306 Tasa Fija 2,996,527.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202229/09/20229.306 Tasa Fija 5,925,265.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202204/10/20229.306 Tasa Fija 41,949.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202227/07/20228.1718 Tasa Fija 615,404.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202205/08/20228.1718 Tasa Fija 1,344,462.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202225/07/20228.1718 Tasa Fija 22,177.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202220/07/20228.1718 Tasa Fija 17,435.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202203/10/20229.306 Tasa Fija 104,692.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202227/09/20229.306 Tasa Fija 8,388.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202229/09/20229.306 Tasa Fija 689,074.88  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202204/10/20227.3335  
Tasa Fija 20,101,854.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202225/07/20228.1718 Tasa Fija 1,222,871.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202211/07/20228.1718 Tasa Fija 13,280.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202211/07/20228.1718 Tasa Fija 43,711.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202201/08/20228.1718 Tasa Fija 14,746.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202223/09/20229.306 Tasa Fija 298,217.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202225/07/20228.1718 Tasa Fija 29,851.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202203/10/20229.306 Tasa Fija 579,975.16  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202206/07/20227.0218  
Tasa Fija 1,587,628.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/04/202205/08/20228.1718 Tasa Fija 1,528,260.78  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202207/07/20227.342 Tasa  
Fija 502,447.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202205/08/20227.3335  
Tasa Fija 1,005,092.71  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202202/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202207/07/20227.342 Tasa  
Fija 426,251.20  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202207/07/20227.342 Tasa  
Fija 453,458.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/04/202207/07/20227.342 Tasa  
Fija 453,458.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202229/07/20228.166 Tasa Fija 68,953.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202221/07/20228.166 Tasa Fija 381,752.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202206/07/20228.166 Tasa Fija 181,801.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202201/08/20228.166 Tasa Fija 2,579,036.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202201/08/20228.166 Tasa Fija 1,926,966.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202230/09/20229.3179 Tasa Fija 1,624,552.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202201/08/20228.166 Tasa Fija 2,172,842.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202211/07/20228.166 Tasa Fija 45,162.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202211/07/20228.166 Tasa Fija 105,702.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202220/07/20228.166 Tasa Fija 114,727.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202202/08/20228.166 Tasa Fija 5,933,092.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202208/09/20229.3179 Tasa Fija 14,745.87

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 56 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202215/07/20228.166	Tasa Fija	3,053,674.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202201/08/20228.166	Tasa Fija	1,022,784.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/04/202204/07/20228.166	Tasa Fija	27,804.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202208/07/20227.016	Tasa Fija	1,785,540.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202207/10/20228.1245	Tasa Fija	7,207,319.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202208/07/20227.3465	Tasa Fija	2,511,733.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/04/202206/10/20227.3335	Tasa Fija	20,101,854.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202220/06/20222.41071	Tasa Fija	683,363.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202205/08/20228.175	Tasa Fija	150,727.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202207/07/20228.175	Tasa Fija	206,641.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202204/07/20228.175	Tasa Fija	39,883.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202211/07/20228.175	Tasa Fija	133,095.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202203/08/20228.175	Tasa Fija	420,978.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202219/08/20229.3179	Tasa Fija	126,976.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202207/10/20227.342	Tasa Fija	5,024,473.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202207/10/20229.3179	Tasa Fija	102,044.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202211/07/20227.3715	Tasa Fija	401,474.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202204/07/20228.175	Tasa Fija	26,992.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202211/07/20228.175	Tasa Fija	29,916.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202207/10/20229.3179	Tasa Fija	1,534,900.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/04/202227/09/20229.3179	Tasa Fija	1,195,713.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202207/07/20227.025	Tasa Fija	1,389,235.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202208/08/20228.1775	Tasa Fija	1,138,868.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202207/10/20229.3425	Tasa Fija	1,454,904.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202229/07/20228.1775	Tasa Fija	211,063.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202229/07/20228.1775	Tasa Fija	357,080.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202212/07/20228.1775	Tasa Fija	86,022.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202211/07/20228.1775	Tasa Fija	201,874.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202227/09/20229.3425	Tasa Fija	6,273.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202207/10/20229.3425	Tasa Fija	307,754.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202207/10/20229.3425	Tasa Fija	10,601.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202207/10/20229.3425	Tasa Fija	14,967.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202212/07/20228.1775	Tasa Fija	70,774.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202211/07/20228.1775	Tasa Fija	202,584.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202201/08/20228.1775	Tasa Fija	104,394.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202207/10/20229.3425	Tasa Fija	106,436.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202210/10/20227.367	Tasa Fija	5,021,487.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202208/07/20228.1775	Tasa Fija	385,558.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202211/07/20228.1775	Tasa Fija	34,415.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202231/08/20229.3425	Tasa Fija	4,675,314.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202212/07/20227.3715	Tasa Fija	2,509,214.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202210/10/20227.367	Tasa Fija	20,085,948.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202211/07/20227.0275	Tasa Fija	1,586,101.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202209/08/20228.1245	Tasa Fija	1,000,225.68

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 57 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202210/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202211/07/20228.1775 Tasa Fija 252,026.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202210/10/20227.367 Tasa  
Fija 3,515,040.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202211/08/20227.3715  
Tasa Fija 10,036,857.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/04/202209/12/20227.367 Tasa  
Fija 4,261,233.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202218/07/20228.2137 Tasa Fija 118,801.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202212/07/20228.2137 Tasa Fija 19,377.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202212/07/20228.2137 Tasa Fija 140,246.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202208/08/20228.2137 Tasa Fija 1,722,785.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202211/07/20228.2137 Tasa Fija 419,013.87  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202210/10/20229.3309 Tasa Fija 483,066.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202201/08/20228.2137 Tasa Fija 375,406.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202212/07/20228.2137 Tasa Fija 54,543.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202208/08/20228.2137 Tasa Fija 440,226.41  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202203/08/20228.2137 Tasa Fija 7,902.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202205/07/20228.2137 Tasa Fija 714,442.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/04/202225/07/20228.2137 Tasa Fija 65,749.18  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/04/202213/10/20227.3715  
Tasa Fija 5,018,428.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202209/08/20228.2305 Tasa Fija 263,479.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202208/08/20228.2305 Tasa Fija 1,665,012.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202214/10/20229.3826 Tasa Fija 1,468,697.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202229/07/20228.2305 Tasa Fija 5,223.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202214/07/20228.2305 Tasa Fija 223,570.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202216/08/20228.2305 Tasa Fija 10,833.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202208/08/20228.2305 Tasa Fija 62,185.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202205/08/20228.2305 Tasa Fija 21,220.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202210/08/20228.2305 Tasa Fija 60,974.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202211/07/20228.2305 Tasa Fija 60,366.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202210/10/20229.3826 Tasa Fija 423,051.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202210/10/20229.3826 Tasa Fija 36,524.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202218/07/20227.43 Tasa  
Fija 4,009,081.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202218/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,500,338.52  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202214/10/20227.38 Tasa  
Fija 5,017,425.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202215/07/20227.0805  
Tasa Fija 990,680.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202218/07/20227.43 Tasa  
Fija 400,908.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/20267.58 Tasa  
Fija 16,521,510.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202201/07/20222.46271 Tasa Fija 64,409.60  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202215/07/20228.2475 Tasa Fija 403,653.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202204/07/20228.2475 Tasa Fija 19,620.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202205/08/20228.2475 Tasa Fija 466,242.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202210/08/20228.2475 Tasa Fija 213,415.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202210/08/20228.2475 Tasa Fija 340,981.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202201/08/20228.2475 Tasa Fija 39,785.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202211/10/20229.3882 Tasa Fija 276,827.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202201/08/20228.2475 Tasa Fija 15,969.68

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 58 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202204/07/20228.2475 Tasa Fija 1,223,242.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/202217/10/20227.4225  
Tasa Fija 5,014,432.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202201/08/20228.2475 Tasa Fija 23,612.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202211/07/20228.2475 Tasa Fija 14,916.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202210/08/20228.2475 Tasa Fija 31,020.30  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/202219/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,250,282.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/202230/12/20228.1245  
Tasa Fija 8,501,918.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/202211/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/04/202223/09/20227.4775  
Tasa Fija 1,780,253.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202211/07/20222.49829 Tasa Fija 375,532.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202217/08/20228.244 Tasa Fija 61,054.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202216/08/20228.244 Tasa Fija 152,337.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202219/07/20228.244 Tasa Fija 52,196.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202225/07/20228.244 Tasa Fija 221,934.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202225/07/20228.244 Tasa Fija 69,175.93  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202203/08/20228.244 Tasa Fija 63,707.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202214/09/20229.4041 Tasa Fija 63,581.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202206/10/20229.4041 Tasa Fija 317,175.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202222/07/20228.244 Tasa Fija 10,941.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202208/08/20228.244 Tasa Fija 4,124.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202208/08/20228.244 Tasa Fija 8,832.01  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202208/08/20228.244 Tasa Fija 113,262.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202208/08/20228.244 Tasa Fija 106,860.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202207/10/20229.4041 Tasa Fija 2,748,180.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202220/09/20229.4041 Tasa Fija 6,725,798.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202230/06/20226.8525  
Tasa Fija 5,067,538.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202218/07/20227.094 Tasa  
Fija 1,980,036.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202220/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,250,282.10  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202219/08/20227.43 Tasa  
Fija 1,002,270.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/04/202212/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202218/08/20228.275 Tasa Fija 82,037.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202219/07/20228.275 Tasa Fija 57,374.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202225/07/20228.275 Tasa Fija 1,084,859.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202210/08/20228.275 Tasa Fija 99,861.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202218/10/20229.4099 Tasa Fija 231,190.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202206/10/20229.4099 Tasa Fija 2,041,591.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202213/10/20229.4099 Tasa Fija 5,797,865.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202218/10/20229.4099 Tasa Fija 66,641.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202208/07/20228.275 Tasa Fija 270,993.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202205/08/20228.275 Tasa Fija 485,578.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202219/08/20228.275 Tasa Fija 1,020,428.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202225/07/20228.275 Tasa Fija 17,712.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202207/10/20229.4099 Tasa Fija 142,797.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202213/10/20229.4099 Tasa Fija 751,047.14  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202221/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,500,338.52

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 59 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202216/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202205/08/20228.275 Tasa Fija 142,993.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202201/07/20228.275 Tasa Fija 750,670.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202205/08/20228.275 Tasa Fija 119,995.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202215/08/20228.275 Tasa Fija 4,337,136.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202203/08/20228.275 Tasa Fija 281,633.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/04/202215/08/20228.275 Tasa Fija 2,039,630.26  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202220/07/20227.125 Tasa  
Fija 2,473,840.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202219/08/20227.43 Tasa  
Fija 1,002,270.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202218/10/20227.43 Tasa  
Fija 20,045,405.56  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/04/202219/10/20228.1245  
Tasa Fija 8,501,918.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202201/07/20228.295 Tasa Fija 1,684,439.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202228/07/20228.295 Tasa Fija 126,453.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202220/07/20228.295 Tasa Fija 158,225.63  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202215/08/20228.295 Tasa Fija 293,863.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202225/07/20228.295 Tasa Fija 133,648.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202225/07/20228.295 Tasa Fija 43,986.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202219/10/20229.4748 Tasa Fija 266,092.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202218/10/20229.4748 Tasa Fija 290,679.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202215/08/20228.295 Tasa Fija 926,511.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202205/07/20228.295 Tasa Fija 156,888.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202216/08/20228.295 Tasa Fija 16,189.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202210/08/20228.295 Tasa Fija 147,534.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202214/09/20229.4748 Tasa Fija 111,631.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202218/10/20229.4748 Tasa Fija 10,791.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202215/08/20228.295 Tasa Fija 136,735.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202225/07/20228.295 Tasa Fija 66,425.64  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202222/07/20228.1245  
Tasa Fija 2,000,451.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/04/202221/10/20228.1245  
Tasa Fija 15,003,385.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202219/08/20228.3175 Tasa Fija 1,580,607.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202219/08/20228.3175 Tasa Fija 339,815.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202215/08/20228.3175 Tasa Fija 132,736.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202217/08/20228.3175 Tasa Fija 397,145.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202202/09/20229.6403 Tasa Fija 58,573.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202218/10/20229.6403 Tasa Fija 4,745.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202204/07/20222.61371 Tasa Fija 387,940.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202225/07/20222.61371 Tasa Fija 418,269.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202202/08/20223.22371 Tasa Fija 280,496.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202208/08/20223.22371 Tasa Fija 201,176.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202210/08/20228.3175 Tasa Fija 131,283.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202221/10/20229.6403 Tasa Fija 75,288.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202203/08/20228.3175 Tasa Fija 16,550.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202207/07/20228.3175 Tasa Fija 71,379.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202229/07/20228.3175 Tasa Fija 976,408.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202204/10/20229.6403 Tasa Fija 4,482.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/04/202225/07/20228.1125  
Tasa Fija 350,315.49  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/04/202222/07/20227.1675  
Tasa Fija 1,088,203.41

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 60 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/04/202225/07/20228.1245  
Tasa Fija 2,000,451.36

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/04/202228/02/20238.3905  
Tasa Fija 1,000,233.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202226/07/20228.34 Tasa Fija 137,049.65

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202217/08/20228.34 Tasa Fija 129,491.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202225/07/20228.34 Tasa Fija 495,383.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202221/10/20229.6118 Tasa Fija 228,384.45

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202219/08/20228.34 Tasa Fija 86,814.04

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202203/08/20228.34 Tasa Fija 107,875.36

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202225/07/20228.34 Tasa Fija 10,001.77

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202207/07/20228.34 Tasa Fija 1,545,975.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202214/10/20229.6118 Tasa Fija 461,161.87

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202221/10/20229.6118 Tasa Fija 266,738.39

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202217/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202221/07/20228.34 Tasa Fija 13,729.57

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202224/10/20228.1245  
Tasa Fija 11,502,595.33

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202225/08/20228.1125  
Tasa Fija 1,000,901.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202204/07/20222.63814 Tasa Fija 537,729.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202226/07/20228.3356 Tasa Fija 57,580.25

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202220/07/20228.3356 Tasa Fija 33,745.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202225/07/20228.3356 Tasa Fija 381,102.55

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202210/08/20228.3356 Tasa Fija 153,913.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202217/08/20228.3356 Tasa Fija 156,961.41

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202228/09/20229.61 Tasa Fija 2,853.98

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202220/10/20229.61 Tasa Fija 75,631.68

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202226/08/20228.1125  
Tasa Fija 1,000,901.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202222/07/20228.3356 Tasa Fija 782,423.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202220/10/20229.61 Tasa Fija 3,418,873.31

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202218/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202225/07/20227.1856  
Tasa Fija 2,471,503.10

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202225/10/20228.1125  
Tasa Fija 4,353,921.04

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202225/08/20228.1125  
Tasa Fija 58,752,911.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202215/08/20223.22629 Tasa Fija 58,395.99

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202204/07/20222.63886 Tasa Fija 212,779.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202226/07/20228.38 Tasa Fija 27,208.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202225/07/20228.38 Tasa Fija 223,028.95

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202210/08/20228.38 Tasa Fija 490,628.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202224/10/20229.6331 Tasa Fija 126,634.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202225/10/20229.6331 Tasa Fija 194,869.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202220/10/20229.6331 Tasa Fija 392,450.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202224/08/20228.38 Tasa Fija 530,700.28

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202223/08/20228.38 Tasa Fija 210,428.49

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202220/10/20229.6331 Tasa Fija 1,681,733.85

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202225/10/20229.6331 Tasa Fija 169,721.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202219/08/20228.38 Tasa Fija 3,116.44

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202217/08/20228.38 Tasa Fija 329,264.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202225/07/20228.38 Tasa Fija 1,106,898.39

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 61 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202224/08/20228.38	Tasa Fija	95,608.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202221/10/20229.6331	Tasa Fija	316,150.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/04/202226/08/20228.1125	Tasa Fija	1,000,901.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202224/08/20228.38	Tasa Fija	366,677.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202222/07/20228.38	Tasa Fija	148,299.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202227/07/20228.38	Tasa Fija	15,197.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202208/08/20228.38	Tasa Fija	13,077.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202224/08/20228.38	Tasa Fija	28,161.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202214/10/20229.6331	Tasa Fija	1,177,418.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202218/10/20229.6331	Tasa Fija	24,294.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/04/202226/10/20228.1245	Tasa Fija	18,507,373.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/04/202225/10/20228.1125	Tasa Fija	20,018,027.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/04/202225/10/20228.6331	Tasa Fija	23,409,638.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202218/07/20228.3894	Tasa Fija	211,402.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202225/07/20228.3894	Tasa Fija	332,296.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202225/07/20228.3894	Tasa Fija	2,593,954.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202201/08/20228.3894	Tasa Fija	17,055.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/08/20228.3894	Tasa Fija	2,236,100.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202215/07/20228.3894	Tasa Fija	2,380,818.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202201/07/20227.9025	Tasa Fija	7,062.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/07/20228.3894	Tasa Fija	135,698.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202226/08/20228.3894	Tasa Fija	59,498.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/08/20228.3894	Tasa Fija	231,981.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202208/08/20228.3894	Tasa Fija	22,067.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202211/10/20229.6424	Tasa Fija	1,074.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202228/10/20229.6424	Tasa Fija	181,393.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202225/10/20229.6424	Tasa Fija	211,743.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/08/20228.3894	Tasa Fija	139,733.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202224/08/20228.3894	Tasa Fija	32,339.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/08/20228.3894	Tasa Fija	187,965.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202210/08/20228.3894	Tasa Fija	5,122.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202222/08/20228.3894	Tasa Fija	1,989,395.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/05/202229/07/20227.2394	Tasa Fija	1,086,768.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202212/08/20228.43	Tasa Fija	924,090.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202230/08/20228.43	Tasa Fija	294,210.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202218/07/20228.43	Tasa Fija	27,586.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202212/08/20228.43	Tasa Fija	6,098.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202213/07/20228.43	Tasa Fija	742,196.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202225/07/20228.43	Tasa Fija	59,439.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202217/08/20228.43	Tasa Fija	19,968.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/05/202224/08/20228.43	Tasa Fija	105,858.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202201/08/20227.325	Tasa Fija	201,220.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202231/08/20228.1245	Tasa Fija	3,000,677.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202201/09/20228.45	Tasa Fija	557,487.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202216/08/20228.45	Tasa Fija	16,199.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202225/07/20228.45	Tasa Fija	24,170.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202225/07/20228.45	Tasa Fija	1,031,804.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202201/08/20228.45	Tasa Fija	85,610.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202209/08/20228.45	Tasa Fija	152,062.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202222/08/20228.45	Tasa Fija	260,653.71

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 62 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202214/07/20228.45 Tasa Fija 704,103.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202230/11/20228.1245  
Tasa Fija 2,000,451.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202201/09/20227.325 Tasa  
Fija 1,006,104.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202201/08/20227.3 Tasa  
Fija 1,875,771.82  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202231/10/20228.1245  
Tasa Fija 15,003,385.21  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202228/04/20238.1245  
Tasa Fija 18,754,231.51  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202203/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,006,327.76  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202213/01/20237.3715  
Tasa Fija 2,190,175.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202213/01/20237.3715  
Tasa Fija 1,338,440.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202213/01/20237.3715  
Tasa Fija 1,326,272.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202225/07/20228.4691 Tasa Fija 1,316,250.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202226/08/20228.4691 Tasa Fija 3,623,577.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202227/09/20229.6539 Tasa Fija 131,486.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202202/09/20228.4691 Tasa Fija 658,716.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202224/08/20228.4691 Tasa Fija 13,619.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202224/08/20228.4691 Tasa Fija 320,125.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202210/08/20228.4691 Tasa Fija 145,205.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202212/08/20228.4691 Tasa Fija 262,629.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202201/08/20228.4691 Tasa Fija 17,045.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202215/08/20228.4691 Tasa Fija 9,874.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202218/07/20228.4691 Tasa Fija 81,808.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202210/08/20228.4691 Tasa Fija 11,523.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202225/07/20228.4691 Tasa Fija 20,137.86  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202222/08/20228.4691 Tasa Fija 841,950.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202204/08/20228.1245  
Tasa Fija 1,000,225.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202204/07/20227.3335  
Tasa Fija 2,010,185.42  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202228/04/20238.1245  
Tasa Fija 7,501,692.60  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202202/09/20227.33 Tasa  
Fija 1,005,904.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202201/11/20227.325 Tasa  
Fija 2,012,208.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202220/06/20227.915 Tasa Fija 25,407.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202226/08/20228.475 Tasa Fija 1,198,090.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202231/08/20228.475 Tasa Fija 29,924.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202225/07/20228.475 Tasa Fija 398,282.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202222/08/20228.475 Tasa Fija 192,953.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202210/08/20228.475 Tasa Fija 33,728.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202210/08/20228.475 Tasa Fija 248,798.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202210/08/20228.475 Tasa Fija 115,372.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202230/09/20229.5975 Tasa Fija 222,215.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202231/10/20229.5975 Tasa Fija 204,510.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202201/11/20229.5975 Tasa Fija 189,517.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202201/11/20229.5975 Tasa Fija 10,525.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/05/202218/07/20228.475 Tasa Fija 86,451.43

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 63 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202203/08/20228.475	Tasa Fija	203,090.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202222/08/20228.475	Tasa Fija	1,037,973.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202231/08/20228.475	Tasa Fija	629,457.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202230/08/20228.475	Tasa Fija	166,066.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202201/09/20228.475	Tasa Fija	946,604.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202224/08/20228.475	Tasa Fija	86,443.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202227/10/20229.5975	Tasa Fija	3,502,523.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202208/09/20229.5975	Tasa Fija	929,947.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202225/07/20228.475	Tasa Fija	7,745.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202231/08/20228.475	Tasa Fija	1,629,317.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202228/07/20228.475	Tasa Fija	7,443.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202222/08/20228.475	Tasa Fija	103,987.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202206/10/20229.5975	Tasa Fija	611,375.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202201/11/20229.5975	Tasa Fija	2,141.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202202/09/20227.33		Tasa Fija	1,005,904.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202215/07/20227.3855		Tasa Fija	12,039,389.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202201/11/20227.325		Tasa Fija	2,012,208.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202215/08/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202219/08/20228.475	Tasa Fija	89,855.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202201/08/20228.475	Tasa Fija	17,156,475.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202219/07/20228.475	Tasa Fija	598,281.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202202/09/20228.475	Tasa Fija	278,625.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202205/08/20228.475	Tasa Fija	661,248.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202224/08/20228.475	Tasa Fija	44,200.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202231/08/20228.475	Tasa Fija	339,845.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202221/10/20229.5975	Tasa Fija	715,568.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202223/09/20229.5975	Tasa Fija	151,368.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202204/08/20227.3335		Tasa Fija	402,037.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202219/08/20228.475	Tasa Fija	283,569.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/05/202229/07/20228.475	Tasa Fija	9,243.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202204/08/20228.1245		Tasa Fija	2,000,451.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/05/202228/10/20228.118		Tasa Fija	20,013,530.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202204/07/20227.915	Tasa Fija	955,355.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202201/09/20228.5	Tasa Fija	29,388.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202210/08/20228.5	Tasa Fija	524,481.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	3,757,157.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202231/10/20229.5634	Tasa Fija	430,349.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202201/11/20229.5634	Tasa Fija	137,004.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202201/11/20229.5634	Tasa Fija	147,076.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202206/06/20227.915	Tasa Fija	523.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202202/09/20228.5	Tasa Fija	133,268.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	6,051,604.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202206/09/20228.5	Tasa Fija	826,211.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202210/08/20228.5	Tasa Fija	7,426.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	144,855.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202204/10/20229.5634	Tasa Fija	7,900.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202226/08/20228.5	Tasa Fija	322,509.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202226/08/20228.5	Tasa Fija	192,434.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No09/05/202204/08/20228.5	Tasa Fija	95,572.86

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 64 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	238,622.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202231/08/20228.5	Tasa Fija	57,807.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202220/07/20228.5	Tasa Fija	1,334,086.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202225/07/20228.5	Tasa Fija	70,323.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	1,018,120.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202225/10/20229.5634	Tasa Fija	7,406.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202204/11/20229.5634	Tasa Fija	374,981.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202219/08/20228.1245	Tasa Fija	1,006,327.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202229/08/20228.5	Tasa Fija	37,339.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202206/09/20228.5	Tasa Fija	108,266.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202205/12/20227.3335	Tasa Fija	547,775.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/05/202224/08/20228.5	Tasa Fija	30,929.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202202/08/20228.535	Tasa Fija	18,275.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202211/07/20228.535	Tasa Fija	67,210.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202229/08/20228.535	Tasa Fija	170,361.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202227/07/20228.535	Tasa Fija	517,231.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202219/07/20228.535	Tasa Fija	23,728.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202205/08/20228.535	Tasa Fija	39,515.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202222/08/20228.535	Tasa Fija	671,612.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202201/11/20229.6003	Tasa Fija	13,907.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202202/09/20228.535	Tasa Fija	93,393.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202211/07/20228.535	Tasa Fija	1,010,775.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202224/10/20229.6003	Tasa Fija	1,084,802.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202205/08/20227.385	Tasa Fija	1,973,657.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202231/08/20228.535	Tasa Fija	27,382.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202228/07/20228.535	Tasa Fija	3,312,425.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202222/08/20228.1245	Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202225/07/20228.1125	Tasa Fija	8,007,211.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202209/12/20227.367	Tasa Fija	6,666,065.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/05/202204/11/20227.3335	Tasa Fija	251,273.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202202/09/20228.55	Tasa Fija	259,675.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202229/08/20228.55	Tasa Fija	8,926.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202231/08/20228.55	Tasa Fija	592,746.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202220/10/20229.5917	Tasa Fija	76,831.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202229/08/20228.55	Tasa Fija	99,870.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202224/08/20228.55	Tasa Fija	152,415.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202204/11/20229.5917	Tasa Fija	1,069,837.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202229/08/20228.55	Tasa Fija	441,276.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202210/08/20228.55	Tasa Fija	59,146.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/05/202223/08/20228.1245	Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/05/202208/09/20227.3465	Tasa Fija	10,046,935.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202210/08/20228.55	Tasa Fija	3,656.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202208/08/20228.55	Tasa Fija	201,936.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/05/202208/08/20227.4	Tasa Fija	1,380,052.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/05/202207/11/20227.342	Tasa Fija	2,009,789.33

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 65 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202201/07/20227.9575	Tasa Fija	531,653.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202204/07/20227.9575	Tasa Fija	23,261.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202202/09/20228.575	Tasa Fija	1,121,041.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202209/08/20228.575	Tasa Fija	28,476.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202205/08/20228.575	Tasa Fija	810,718.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202210/08/20228.575	Tasa Fija	117,112.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202217/08/20228.575	Tasa Fija	40,514.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202229/08/20228.575	Tasa Fija	21,541.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202219/08/20228.575	Tasa Fija	163,433.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202231/08/20228.575	Tasa Fija	371,245.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202229/08/20228.575	Tasa Fija	95,578.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202211/07/20227.9575	Tasa Fija	26,616.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202226/08/20228.575	Tasa Fija	23,978.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202225/07/20228.575	Tasa Fija	1,704,973.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202212/08/20228.575	Tasa Fija	219,445.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202209/08/20228.575	Tasa Fija	45,996.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/05/202208/11/20229.5881	Tasa Fija	509,471.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/05/202209/09/20227.3627		Tasa Fija	1,004,499.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/05/202210/08/20227.425		Tasa Fija	1,970,766.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/05/202226/07/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/05/202208/11/20227.3465		Tasa Fija	2,009,387.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202204/07/20227.9699	Tasa Fija	10,034.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202211/07/20227.9699	Tasa Fija	6,328.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202209/08/20228.6225	Tasa Fija	345,083.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202201/08/20228.6225	Tasa Fija	284,826.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202225/07/20228.6225	Tasa Fija	586,049.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202210/08/20228.6225	Tasa Fija	1,174,367.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202231/08/20228.6225	Tasa Fija	26,208.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202212/08/20228.6225	Tasa Fija	720,911.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202208/11/20229.5992	Tasa Fija	279,783.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202208/11/20229.5992	Tasa Fija	37,199.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202208/11/20229.5992	Tasa Fija	10,533.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202229/07/20228.6225	Tasa Fija	755,231.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202214/07/20228.6225	Tasa Fija	3,676.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202207/09/20228.6225	Tasa Fija	10,090,847.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202210/08/20228.6225	Tasa Fija	97,125.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202207/09/20228.6225	Tasa Fija	69,626.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202211/08/20227.3715		Tasa Fija	501,842.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202211/07/20227.9699	Tasa Fija	4,918.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202205/09/20228.6225	Tasa Fija	1,013,497.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202221/07/20228.6225	Tasa Fija	947,014.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202212/08/20228.6225	Tasa Fija	685,385.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202210/08/20228.6225	Tasa Fija	90,214.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202210/08/20228.6225	Tasa Fija	423,296.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202208/11/20229.5992	Tasa Fija	7,057.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202203/11/20229.5992	Tasa Fija	3,051,747.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202227/10/20229.5992	Tasa Fija	3,778,217.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202211/07/20227.9699	Tasa Fija	291,330.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202210/08/20228.6225	Tasa Fija	178,510.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202215/08/20228.6225	Tasa Fija	57,922.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/05/202207/09/20228.6225	Tasa Fija	1,162,007.80

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 66 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/05/202207/09/20228.6225 Tasa Fija 1,091,309.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202229/07/20228.1245  
Tasa Fija 1,006,327.76  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202210/08/20227.4725  
Tasa Fija 492,633.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202209/09/20227.3627  
Tasa Fija 1,004,499.43  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202208/11/20227.3465  
Tasa Fija 30,140,807.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202209/11/20227.3627  
Tasa Fija 2,008,998.86  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/05/202209/11/20228.1245  
Tasa Fija 7,551,703.89  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202213/06/20228.385 Tasa Fija 37,894.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202202/09/20228.74 Tasa Fija 1,656,682.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202215/08/20228.74 Tasa Fija 3,958.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202210/08/20228.74 Tasa Fija 121,953.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202205/09/20228.74 Tasa Fija 2,207,106.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202210/08/20228.74 Tasa Fija 11,192.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202213/10/20229.6924 Tasa Fija 244,928.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202206/07/20228.385 Tasa Fija 180,992.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202207/09/20228.74 Tasa Fija 169,591.48  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202204/11/20229.6924 Tasa Fija 691,072.54  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202205/09/20228.74 Tasa Fija 107,456.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202207/09/20228.74 Tasa Fija 143,461.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202223/08/20228.74 Tasa Fija 16,183.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202210/08/20228.74 Tasa Fija 8,696.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202211/11/20229.6924 Tasa Fija 117,435.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202218/10/20229.6924 Tasa Fija 1,748.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202216/08/20228.74 Tasa Fija 1,268,484.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202211/07/20228.385 Tasa Fija 162,317.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202226/07/20228.74 Tasa Fija 338,713.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202205/09/20228.74 Tasa Fija 2,487,676.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202207/11/20229.6924 Tasa Fija 149,833.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202207/09/20228.74 Tasa Fija 14,649.08  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202210/11/20227.367 Tasa  
Fija 2,812,032.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202212/08/20227.59 Tasa  
Fija 984,794.60  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202215/05/20267.3855  
Tasa Fija 1,964,761.45  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202211/11/20227.3715  
Tasa Fija 2,007,371.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202211/07/20228.368 Tasa Fija 143,347.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202209/09/20228.7325 Tasa Fija 540,599.05  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202212/08/20228.7325 Tasa Fija 202,284.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202205/09/20228.7325 Tasa Fija 882,873.61  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202213/09/20228.7325 Tasa Fija 26,634.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202211/10/20229.7809 Tasa Fija 97,277.87  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202227/10/20229.7809 Tasa Fija 78,863.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202209/09/20228.7325 Tasa Fija 105,299.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202205/09/20228.7325 Tasa Fija 95,294.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202210/08/20228.7325 Tasa Fija 23,333.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202205/09/20228.7325 Tasa Fija 70,075.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202212/07/20228.368 Tasa Fija 155,323.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202231/08/20228.7325 Tasa Fija 333,238.11

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 67 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202212/09/20228.7325	Tasa Fija	1,017,991.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202207/09/20228.7325	Tasa Fija	352,290.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202205/09/20228.7325	Tasa Fija	16,408.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202203/08/20228.7325	Tasa Fija	539,700.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202211/07/20228.368	Tasa Fija	702.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202213/07/20228.368	Tasa Fija	26,540.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202201/08/20228.7325	Tasa Fija	3,395.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202227/07/20228.7325	Tasa Fija	1,722,183.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202231/08/20228.7325	Tasa Fija	44,739.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202207/11/20229.7809	Tasa Fija	693,363.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/05/202210/08/20228.7325	Tasa Fija	56,967.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202211/11/20227.3715		Tasa Fija	2,007,371.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202228/02/20237.5825		Tasa Fija	1,009,478.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202215/08/20227.3855		Tasa Fija	451,477.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202215/08/20227.5825		Tasa Fija	1,772,164.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202201/07/20228.3587	Tasa Fija	19,352.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202211/07/20228.3587	Tasa Fija	34,502.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202212/08/20228.7219	Tasa Fija	33,596.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202215/08/20228.7219	Tasa Fija	46,711.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202205/09/20228.7219	Tasa Fija	120,415.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202211/07/20228.3587	Tasa Fija	44,505.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202228/10/20229.8017	Tasa Fija	91,132.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202211/11/20229.8017	Tasa Fija	151,796.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202211/11/20229.8017	Tasa Fija	487,821.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202207/09/20228.7219	Tasa Fija	99,578.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202207/09/20228.7219	Tasa Fija	409,079.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No18/05/202201/08/20228.7219	Tasa Fija	71,918.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202218/07/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202220/07/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202221/07/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202211/11/20227.3715		Tasa Fija	901,309.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/20238.1245		Tasa Fija	41,676,070.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202228/04/20238.1245		Tasa Fija	41,676,070.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202208/07/20228.355	Tasa Fija	120,244.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202205/08/20228.725	Tasa Fija	657,126.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202225/08/20228.725	Tasa Fija	32,273.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202216/08/20228.725	Tasa Fija	49,257.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202210/08/20228.725	Tasa Fija	38,042.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202229/08/20228.725	Tasa Fija	125,285.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202204/07/20228.355	Tasa Fija	2,149.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202207/09/20228.725	Tasa Fija	1,398,567.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202208/08/20228.725	Tasa Fija	3,184.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202226/08/20228.725	Tasa Fija	245,097.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202203/08/20228.725	Tasa Fija	176,535.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202230/08/20228.725	Tasa Fija	526,493.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/05/202211/07/20228.355	Tasa Fija	22,770.46

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 68 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202230/08/20228.725	Tasa Fija	23,529.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202227/07/20228.725	Tasa Fija	752,814.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202210/08/20228.725	Tasa Fija	1,170,402.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202215/12/20227.3855	Tasa Fija	300,984.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202215/11/20228.1245	Tasa Fija	100,632,776.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202215/11/20221.78614	Tasa Fija	59,460,575.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202215/11/20227.3855	Tasa Fija	15,049,236.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202211/07/20228.353	Tasa Fija	88,231.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202202/09/20228.7185	Tasa Fija	156,569.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202217/08/20228.7185	Tasa Fija	78,948.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202210/08/20228.7185	Tasa Fija	41,286.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202210/08/20228.7185	Tasa Fija	106,800.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202225/08/20228.7185	Tasa Fija	102,117.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202215/11/20229.823	Tasa Fija	332,335.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202210/11/20229.823	Tasa Fija	2,776,568.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202215/11/20229.823	Tasa Fija	23,593.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202228/10/20229.823	Tasa Fija	1,007,782.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202218/07/20228.353	Tasa Fija	43,091.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202206/09/20228.7185	Tasa Fija	112,313.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202211/07/20228.353	Tasa Fija	4,153.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202229/08/20228.7185	Tasa Fija	119,159.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202219/08/20228.7185	Tasa Fija	379,642.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202210/08/20228.7185	Tasa Fija	1,600.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202231/08/20228.7185	Tasa Fija	4,951,125.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202216/11/20227.4025	Tasa Fija	4,012,337.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202229/08/20228.7185	Tasa Fija	176,559.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202210/11/20229.823	Tasa Fija	554,738.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202215/08/20228.7185	Tasa Fija	1,179,328.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/05/202222/08/20228.7185	Tasa Fija	821,334.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202215/09/20227.3855	Tasa Fija	1,003,282.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202218/08/20227.43	Tasa Fija	501,135.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202216/11/20227.4025	Tasa Fija	15,046,265.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202215/07/20228.352	Tasa Fija	18,441.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202218/07/20228.352	Tasa Fija	248,051.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202220/06/20228.352	Tasa Fija	61,369.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202220/06/20228.352	Tasa Fija	160,402.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202205/08/20228.7155	Tasa Fija	126,763.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202212/09/20228.7155	Tasa Fija	3,525,522.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202215/09/20228.7155	Tasa Fija	1,514,162.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202222/08/20228.7155	Tasa Fija	84,640.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202212/09/20228.7155	Tasa Fija	1,291,824.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202230/09/20229.8233	Tasa Fija	24,643.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202218/10/20229.8233	Tasa Fija	10,586.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202218/07/20228.352	Tasa Fija	3,275.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202208/07/20228.352	Tasa Fija	97,826.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202218/07/20228.352	Tasa Fija	2,052,391.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202209/09/20228.7155	Tasa Fija	1,510,785.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202212/09/20228.7155	Tasa Fija	46,304.67

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 69 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202211/07/20228.352	Tasa Fija	1,734,133.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202212/09/20228.7155	Tasa Fija	822,330.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202218/07/20228.352	Tasa Fija	1,007,706.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202215/08/20228.7155	Tasa Fija	129,363.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202228/07/20228.7155	Tasa Fija	1,368,604.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202222/08/20228.7155	Tasa Fija	112,252.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/05/202227/10/20229.8233	Tasa Fija	11,236.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202218/11/20228.1245		Tasa Fija	20,126,555.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202217/11/20227.4225		Tasa Fija	5,014,432.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202219/08/20228.1245		Tasa Fija	1,066,240.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202218/08/20228.7075	Tasa Fija	76,441.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202218/08/20228.7075	Tasa Fija	200,183.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202212/09/20228.7075	Tasa Fija	54,844.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202217/08/20228.7075	Tasa Fija	7,866.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202212/09/20228.7075	Tasa Fija	1,699.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202227/10/20229.9139	Tasa Fija	162,403.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202222/08/20228.7075	Tasa Fija	210,719.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202201/08/20228.7075	Tasa Fija	270,463.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202210/08/20228.7075	Tasa Fija	11,147.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202212/09/20228.7075	Tasa Fija	59,109.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/05/202218/10/20229.9139	Tasa Fija	26,820.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202222/08/20227.455		Tasa Fija	300,559.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202222/08/20227.455		Tasa Fija	200,372.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/05/202217/08/20227.5575		Tasa Fija	984,041.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202215/07/20228.3687	Tasa Fija	2,489.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202220/09/20228.71	Tasa Fija	755,640.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202225/07/20228.71	Tasa Fija	99,731.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202219/08/20228.71	Tasa Fija	71,346.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202221/09/20228.71	Tasa Fija	283,869.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202214/09/20228.71	Tasa Fija	3,987,538.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202220/10/20229.9129	Tasa Fija	260,561.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202201/07/20228.3687	Tasa Fija	312,122.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202214/09/20228.71	Tasa Fija	1,660,613.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202223/08/20228.1245		Tasa Fija	1,000,225.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202211/07/20228.3687	Tasa Fija	11,280.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202201/07/20228.3687	Tasa Fija	599,970.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202212/09/20228.71	Tasa Fija	136,558.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202210/08/20228.71	Tasa Fija	33,240.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202214/09/20228.71	Tasa Fija	479,070.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202211/11/20229.9129	Tasa Fija	861,305.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202209/09/20228.71	Tasa Fija	65,456.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202201/08/20228.71	Tasa Fija	901,018.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/05/202216/11/20229.9129	Tasa Fija	254,567.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202212/07/20228.1245		Tasa Fija	1,006,327.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202225/07/20228.3607	Tasa Fija	234,730.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202221/09/20228.71	Tasa Fija	173,415.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202212/09/20228.71	Tasa Fija	66,191.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202210/08/20228.71	Tasa Fija	109,092.27

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 70 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202205/09/20228.71	Tasa Fija	237,446.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202211/07/20228.3607	Tasa Fija	13,849.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202223/09/20228.71	Tasa Fija	554,790.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202210/08/20228.71	Tasa Fija	2,287.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202213/07/20228.1245		Tasa Fija	1,000,225.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202201/07/20228.3607	Tasa Fija	12,964.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202201/07/20228.3607	Tasa Fija	61,652.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202209/09/20228.71	Tasa Fija	101,691.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202205/09/20228.71	Tasa Fija	25,659.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202211/07/20228.3607	Tasa Fija	22,967.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202219/08/20228.71	Tasa Fija	260,841.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202213/09/20228.71	Tasa Fija	709,764.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/05/202212/08/20228.71	Tasa Fija	382,716.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202225/07/20228.357	Tasa Fija	114,547.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202219/08/20228.706	Tasa Fija	7,841.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202223/08/20228.706	Tasa Fija	22,679.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202225/08/20228.706	Tasa Fija	374,857.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/10/20229.9022	Tasa Fija	211,128.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202222/11/20229.9022	Tasa Fija	46,192.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202222/11/20229.9022	Tasa Fija	11,200.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202202/09/20228.706	Tasa Fija	116,474.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202209/09/20228.706	Tasa Fija	313,095.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202223/08/20228.706	Tasa Fija	32,076.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202229/08/20228.706	Tasa Fija	210,147.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/09/20228.706	Tasa Fija	5,189,345.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202225/08/20228.706	Tasa Fija	28,378.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202207/09/20228.706	Tasa Fija	139,799.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/09/20228.706	Tasa Fija	65,826.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202220/10/20229.9022	Tasa Fija	2,355,742.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202222/11/20229.9022	Tasa Fija	2,126.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202220/07/20228.357	Tasa Fija	65,943.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202201/07/20228.357	Tasa Fija	87,399.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202212/09/20228.706	Tasa Fija	18,733.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/09/20228.706	Tasa Fija	1,391,358.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202214/09/20228.706	Tasa Fija	2,602.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202222/11/20229.9022	Tasa Fija	57,174.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202222/11/20229.9022	Tasa Fija	13,327.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202225/08/20228.1245		Tasa Fija	1,181,246.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202224/08/20227.556		Tasa Fija	1,670,308.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202217/06/20228.357	Tasa Fija	16,278.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202225/07/20228.357	Tasa Fija	185,391.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202225/07/20228.357	Tasa Fija	56,833.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202207/07/20228.357	Tasa Fija	461,792.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202223/09/20228.706	Tasa Fija	1,286,316.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202219/09/20228.706	Tasa Fija	1,043,758.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/09/20228.706	Tasa Fija	698,248.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202208/08/20228.706	Tasa Fija	645,303.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202221/09/20228.706	Tasa Fija	554,655.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202211/08/20228.706	Tasa Fija	1,531,766.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202214/09/20228.706	Tasa Fija	9,825.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/05/202210/11/20229.9022	Tasa Fija	1,853,979.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202225/08/20228.1125		Tasa Fija	450,405.63

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 71 / 87

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202225/08/20228.1125	
Tasa Fija 15,013,520.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202225/08/20228.1125	
Tasa Fija 2,502,253.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202224/08/20227.4913	
Tasa Fija 2,503,641.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202223/11/20227.4775	
Tasa Fija 5,008,308.33	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202223/08/20227.4775	
Tasa Fija 2,504,154.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202223/11/20227.4775	
Tasa Fija 5,003,300.03	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202227/06/20228.365	Tasa Fija 383,288.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202224/08/20228.745	Tasa Fija 186,704.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/08/20228.745	Tasa Fija 72,626.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202222/08/20228.745	Tasa Fija 3,892,777.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/10/20229.966	Tasa Fija 210,843.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/07/20228.365	Tasa Fija 527,878.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202219/09/20228.745	Tasa Fija 142,141.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/08/20228.745	Tasa Fija 167,010.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/08/20228.745	Tasa Fija 55,277.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202219/09/20228.745	Tasa Fija 2,970,008.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202218/10/20229.966	Tasa Fija 10,586.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202219/09/20228.745	Tasa Fija 160,784.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202215/08/20228.745	Tasa Fija 284,923.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/08/20228.745	Tasa Fija 56,657.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202219/09/20228.745	Tasa Fija 19,775.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202222/11/20229.966	Tasa Fija 131,977.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202222/11/20229.966	Tasa Fija 236,717.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202226/08/20228.1125	
Tasa Fija 10,009,013.89	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202226/08/20228.1125	
Tasa Fija 2,502,253.47	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202227/09/20228.1125	
Tasa Fija 20,018,027.78	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/07/20228.365	Tasa Fija 605,234.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202205/07/20228.365	Tasa Fija 22,740.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/07/20228.365	Tasa Fija 162,580.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202226/08/20228.745	Tasa Fija 248,638.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202222/08/20228.745	Tasa Fija 116,578.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202208/08/20228.745	Tasa Fija 529,358.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202225/08/20228.745	Tasa Fija 85,603.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202214/09/20228.745	Tasa Fija 65,982.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202219/09/20228.745	Tasa Fija 3,225.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202208/07/20228.365	Tasa Fija 18,780.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202221/09/20228.745	Tasa Fija 161,896.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202221/09/20228.745	Tasa Fija 51,274.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202225/11/20228.1125	
Tasa Fija 5,504,957.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202223/11/20227.4775	
Tasa Fija 3,505,815.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202218/11/20228.1245	
Tasa Fija 5,001,128.40	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202225/11/20228.1245	
Tasa Fija 5,001,128.40	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202219/09/20228.785	Tasa Fija 21,936.40

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 72 / 87  
**CONSOLIDADO**  
**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202225/08/20228.785	Tasa Fija	62,964.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202226/08/20228.785	Tasa Fija	1,064,722.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202209/09/20228.785	Tasa Fija	151,838.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202221/09/20228.785	Tasa Fija	43,069.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202221/09/20228.785	Tasa Fija	34,262.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202218/11/202210.0555	Tasa Fija	943,827.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202211/07/20228.3725	Tasa Fija	35,767.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202230/08/20228.785	Tasa Fija	11,870.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202217/08/20228.785	Tasa Fija	8,535.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202219/09/20228.785	Tasa Fija	12,721.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202214/09/20228.785	Tasa Fija	50,270.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202219/09/20228.785	Tasa Fija	22,538.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202229/08/20228.1255	Tasa Fija	500,225.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202229/08/20228.785	Tasa Fija	16,070.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202209/08/20228.785	Tasa Fija	715,317.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202207/09/20228.785	Tasa Fija	3,219,893.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202221/10/202210.0555	Tasa Fija	376,229.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202224/11/20227.4913	Tasa Fija	3,505,098.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202225/11/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202225/11/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202225/11/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202225/11/20221.76357	Tasa Fija	40,281,179.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202226/08/20228.785	Tasa Fija	482,185.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202221/09/20228.785	Tasa Fija	7,093,660.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202230/09/202210.0555	Tasa Fija	293,098.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202222/11/202210.0555	Tasa Fija	1,257,874.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202225/07/20228.375	Tasa Fija	23,622.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202201/07/20228.375	Tasa Fija	49,576.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202215/08/20228.785	Tasa Fija	47,095.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202224/08/20228.785	Tasa Fija	979,543.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202201/08/20228.785	Tasa Fija	1,180,643.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202216/11/202210.0555	Tasa Fija	1,845,719.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202230/08/20228.1245	Tasa Fija	1,594,318.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202225/11/20228.1125	Tasa Fija	5,004,506.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202222/08/20228.785	Tasa Fija	98,130.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202225/08/20228.785	Tasa Fija	3,816.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202221/09/20228.785	Tasa Fija	31,717.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202228/09/20228.785	Tasa Fija	27,708.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202228/11/20228.118	Tasa Fija	5,003,382.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202228/11/20228.118	Tasa Fija	5,003,382.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202227/09/20228.785	Tasa Fija	275,180.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202229/09/20228.0245	Tasa Fija	-
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202229/09/20228.1245	Tasa Fija	-
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202229/09/20228.1245	Tasa Fija	-

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 73 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija -  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202229/09/20228.1245  
Tasa Fija -  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202229/09/20228.1245  
Tasa Fija -  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202223/11/20227.4775  
Tasa Fija 15,024,925.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202223/11/20227.4775  
Tasa Fija 9,014,955.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202222/11/20227.455 Tasa  
Fija 15,027,956.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202205/09/20228.8275 Tasa Fija 200,921.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202219/09/20228.8275 Tasa Fija 1,016.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202219/08/20228.8275 Tasa Fija 28,412.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202231/08/20228.8275 Tasa Fija 14,692.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202211/07/20228.38 Tasa Fija 53,148.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202219/09/20228.8275 Tasa Fija 430,042.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202221/09/20228.8275 Tasa Fija 5,449,544.84  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202225/07/20228.38 Tasa Fija 69,270.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202214/07/20228.38 Tasa Fija 238,575.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202216/08/20228.8275 Tasa Fija 416,903.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202221/09/20228.8275 Tasa Fija 234,431.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202210/08/20228.8275 Tasa Fija 747,716.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202210/08/20228.8275 Tasa Fija 1,131,023.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202210/08/20228.8275 Tasa Fija 121,938.96  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202221/09/20228.8275 Tasa Fija 99,074.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202201/07/20228.38 Tasa Fija 153,708.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202219/08/20228.8275 Tasa Fija 82,669.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202208/07/20228.38 Tasa Fija 157,314.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202217/06/20228.38 Tasa Fija 116,523.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202223/09/20228.8275 Tasa Fija 2,781,027.52  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202201/07/20228.38 Tasa Fija 95,087.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202219/07/20228.38 Tasa Fija 74,666.02  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202220/09/20228.8275 Tasa Fija 22,751.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202207/09/20228.8275 Tasa Fija 25,730.15  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202226/08/20227.6775  
Tasa Fija 982,005.85  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202201/08/20227.33 Tasa  
Fija 1,005,904.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202201/08/20227.33 Tasa  
Fija 2,011,809.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202229/12/20228.1255  
Tasa Fija 2,000,902.83  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202229/11/20228.1255  
Tasa Fija 3,001,354.25  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202229/11/20228.1255  
Tasa Fija 20,009,028.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202208/07/20228.3855 Tasa Fija 13,543.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202225/07/20228.3855 Tasa Fija 104,715.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202201/08/20228.3855 Tasa Fija 65,445.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202201/07/20228.3855 Tasa Fija 814,849.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202229/09/20228.8325 Tasa Fija 683,812.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202222/09/20228.8325 Tasa Fija 960,063.64  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202212/09/20228.8325 Tasa Fija 268,468.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202221/09/20228.8325 Tasa Fija 1,122,186.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No03/06/202219/09/20228.8325 Tasa Fija 802,054.39

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 74 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202228/10/202210.0942	Tasa Fija	185,649.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202220/10/202210.0942	Tasa Fija	2,641,991.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202228/09/20228.8325	Tasa Fija	2,289,087.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202201/07/20228.3855	Tasa Fija	8,972,976.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202209/09/20228.8325	Tasa Fija	941,790.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202228/09/20228.8325	Tasa Fija	1,275,167.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/11/202210.0942	Tasa Fija	575,406.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202227/10/202210.0942	Tasa Fija	323,291.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202201/09/20227.3355		Tasa Fija	1,186,732.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/07/20228.3855	Tasa Fija	375,793.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202221/07/20228.3855	Tasa Fija	601,745.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202219/09/20228.8325	Tasa Fija	1,343,746.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202228/09/20228.8325	Tasa Fija	696,460.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202211/08/20228.8325	Tasa Fija	481,158.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202205/08/20228.8325	Tasa Fija	343,103.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/09/20228.8325	Tasa Fija	57,451.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202223/09/20228.8325	Tasa Fija	121,502.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202213/09/20228.8325	Tasa Fija	48,962.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/08/20228.8325	Tasa Fija	1,415,202.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202228/09/20228.8325	Tasa Fija	165,731.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202230/09/20228.8325	Tasa Fija	273,868.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/09/20228.8325	Tasa Fija	473,410.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/11/202210.0942	Tasa Fija	54,140.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/06/202229/11/202210.0942	Tasa Fija	28,294.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	5,001,128.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	5,001,128.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202201/09/20227.3355		Tasa Fija	502,852.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	5,028,636.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	5,001,128.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	4,996,127.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202230/11/20228.1245		Tasa Fija	5,001,128.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/20277.5055		Tasa Fija	20,116,752.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202201/08/20228.3835	Tasa Fija	192,216.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202225/07/20228.3835	Tasa Fija	347,881.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202204/07/20228.3835	Tasa Fija	180,753.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202226/09/20228.86	Tasa Fija	5,931,684.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202228/09/20228.86	Tasa Fija	483,701.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202225/08/20228.86	Tasa Fija	334,766.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202225/08/20228.86	Tasa Fija	136,564.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202212/09/20228.86	Tasa Fija	410,666.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202219/09/20228.86	Tasa Fija	13,803.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202226/09/20228.86	Tasa Fija	438,280.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202228/09/20228.86	Tasa Fija	205,243.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202204/10/20228.86	Tasa Fija	62,450.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202229/11/202210.077	Tasa Fija	201,242.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/06/202202/09/20227.3335		Tasa Fija	1,483,742.98

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 75 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202218/07/20228.3835	Tasa Fija	697,604.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202212/07/20228.3835	Tasa Fija	114,082.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202218/07/20228.3835	Tasa Fija	1,286,315.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202228/09/20228.86	Tasa Fija	721,502.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202215/08/20228.86	Tasa Fija	1,464,665.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202226/09/20228.86	Tasa Fija	4,820,317.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/06/202208/09/20228.86	Tasa Fija	222,723.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/06/202202/09/20227.71		Tasa Fija	1,470,394.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/06/202202/12/20227.3335		Tasa Fija	7,035,648.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/06/202202/12/20227.3335		Tasa Fija	5,025,463.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202205/08/20228.392	Tasa Fija	490,098.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202231/08/20228.885	Tasa Fija	121,640.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202221/09/20228.885	Tasa Fija	394,664.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202226/09/20228.885	Tasa Fija	223,682.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202208/09/20228.885	Tasa Fija	1,004,828.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202202/09/20228.885	Tasa Fija	116,119.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202226/09/20228.885	Tasa Fija	110,458.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202229/08/20228.885	Tasa Fija	467.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202222/11/202210.1063	Tasa Fija	33,521.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202216/08/20228.885	Tasa Fija	217,269.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202202/09/20228.885	Tasa Fija	969,130.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202226/09/20228.885	Tasa Fija	7,093.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202201/07/20228.392	Tasa Fija	79,509.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202213/09/20228.885	Tasa Fija	10,619.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202205/09/20227.342		Tasa Fija	452,202.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/06/202225/11/202210.1063	Tasa Fija	889,212.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202231/08/20227.735		Tasa Fija	980,866.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202205/10/20227.342		Tasa Fija	15,073,420.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202202/12/20228.1245		Tasa Fija	10,302,402.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202202/12/20228.1245		Tasa Fija	1,396,869.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202202/12/20228.1245		Tasa Fija	25,122,910.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202225/07/20228.3965	Tasa Fija	9,583.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202209/08/20228.91	Tasa Fija	294,899.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202210/08/20228.91	Tasa Fija	171,638.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202225/08/20228.91	Tasa Fija	56,496.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202228/09/20228.91	Tasa Fija	47,951.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202205/08/20228.3965	Tasa Fija	43,559.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202219/08/20228.91	Tasa Fija	63,456.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202205/09/20228.91	Tasa Fija	209,988.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202226/09/20228.91	Tasa Fija	702,269.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202226/09/20228.91	Tasa Fija	168,894.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202212/07/20228.3965	Tasa Fija	5,477,688.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202208/07/20228.3965	Tasa Fija	1,484,252.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202218/10/202210.1252	Tasa Fija	5,293.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202228/07/20228.3965	Tasa Fija	922,184.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202205/12/202210.1252	Tasa Fija	327,559.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No08/06/202222/11/202210.1252	Tasa Fija	378,836.70

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 76 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202205/12/20228.1245  
Tasa Fija 11,303,046.10

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202202/06/20238.1245  
Tasa Fija 18,838,410.16

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202204/04/20237.3465  
Tasa Fija 50,234,679.86

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202222/07/20221.73629  
Tasa Fija 20,144,040.13

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202229/07/20228.4127 Tasa Fija 147,121.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202201/08/20228.4127 Tasa Fija 703,555.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202226/08/20228.93 Tasa Fija 1,836,721.52

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202225/08/20228.93 Tasa Fija 73,082.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202226/09/20228.93 Tasa Fija 39,190.82

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202209/09/20228.93 Tasa Fija 7,840,852.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202227/10/202210.1123 Tasa Fija 45,311.81

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202208/07/20228.4127 Tasa Fija 1,129,778.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202215/07/20228.4127 Tasa Fija 1,120,028.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202230/09/20228.93 Tasa Fija 399,842.05

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202230/08/20228.93 Tasa Fija 37,122.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202226/08/20228.93 Tasa Fija 835,658.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202212/09/20228.93 Tasa Fija 30,234.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202226/09/20228.93 Tasa Fija 50,047.19

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202224/08/20228.93 Tasa Fija 13,457.62

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202212/09/20228.93 Tasa Fija 488,468.00

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202218/10/202210.1123 Tasa Fija 5,293.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202225/07/20228.4127 Tasa Fija 39,242.91

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202207/10/20228.93 Tasa Fija 685,721.77

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202210/08/20228.93 Tasa Fija 2,860.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202214/09/20228.93 Tasa Fija 78,569.13

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202207/09/20227.3627  
Tasa Fija 1,482,867.17

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202210/08/20228.93 Tasa Fija 786,403.01

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202210/08/20228.93 Tasa Fija 919,219.06

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/12/20227.3627  
Tasa Fija 20,089,988.56

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202231/05/20238.1245  
Tasa Fija 45,843,677.02

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/20257.4927  
Tasa Fija 50,228,943.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202211/07/20228.417 Tasa Fija 249,493.83

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202208/08/20228.417 Tasa Fija 251,003.94

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202209/09/20228.9475 Tasa Fija 962,754.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202210/08/20228.9475 Tasa Fija 82,291.96

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202226/09/20228.9475 Tasa Fija 559,783.07

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202212/09/20228.9475 Tasa Fija 350,303.96

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202228/09/20228.9475 Tasa Fija 225,021.51

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202226/09/20228.9475 Tasa Fija 134,696.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202206/12/202210.1406 Tasa Fija 569,942.58

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202206/12/202210.1406 Tasa Fija 70,235.08

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202201/08/20228.417 Tasa Fija 141,081.33

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202208/08/20228.417 Tasa Fija 108,646.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202201/08/20228.417 Tasa Fija 509,814.90

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202207/09/20228.9475 Tasa Fija 46,642.16

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202229/08/20228.9475 Tasa Fija 297,223.27

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202226/09/20228.9475 Tasa Fija 103,317.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202206/12/202210.1406 Tasa Fija 61,724.00

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 77 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202208/09/20227.367 Tasa Fija 451,933.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202225/07/20228.417 Tasa Fija 569,236.31

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202228/07/20228.417 Tasa Fija 633,451.79

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202208/07/20228.417 Tasa Fija 809,471.31

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202213/09/20228.9475 Tasa Fija 42,346.73

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202222/08/20228.9475 Tasa Fija 569,103.12

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202228/09/20228.9475 Tasa Fija 22,897.18

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202218/08/20228.9475 Tasa Fija 828,148.83

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202209/09/20228.9475 Tasa Fija 966,602.92

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202212/09/20228.9475 Tasa Fija 6,271.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202211/11/202210.1406 Tasa Fija 2,259,375.40

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202225/07/20221.73357 Tasa Fija 20,140,643.51

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202207/12/20227.367 Tasa Fija 1,300,565.15

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202206/09/20227.7975 Tasa Fija 2,448,443.34

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202222/07/20228.4215 Tasa Fija 73,204.09

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202225/07/20228.4215 Tasa Fija 78,811.58

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202211/07/20228.4215 Tasa Fija 113,874.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202204/08/20228.4215 Tasa Fija 746,594.74

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202230/09/20228.9455 Tasa Fija 451,542.50

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202205/09/20228.9455 Tasa Fija 3,927,173.71

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202208/09/20228.9455 Tasa Fija 1,377,404.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202212/09/20228.9455 Tasa Fija 123,267.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202214/10/202210.1329 Tasa Fija 18,682.56

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202206/12/202210.1329 Tasa Fija 116,314.23

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202210/11/202210.1329 Tasa Fija 2,451,644.39

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202203/10/20228.9455 Tasa Fija 329,619.59

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202205/10/20228.9455 Tasa Fija 128,847.32

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202206/10/20228.9455 Tasa Fija 634,010.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202205/10/20228.9455 Tasa Fija 89,005.89

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202220/10/202210.1329 Tasa Fija 85,476.14

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202209/09/20227.3715 Tasa Fija 1,185,031.69

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202218/07/20228.4215 Tasa Fija 5,233,005.47

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202208/09/20228.9455 Tasa Fija 106,754.64

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202210/10/20228.9455 Tasa Fija 622,773.22

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202229/09/20228.9455 Tasa Fija 192,670.80

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202218/07/20228.4215 Tasa Fija 36,189.92

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202205/09/20228.9455 Tasa Fija 2,815,723.83

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202229/07/20228.4215 Tasa Fija 23,478.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202204/07/20228.4215 Tasa Fija 209,670.75

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202218/07/20228.4215 Tasa Fija 153,596.78

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202210/08/20228.4215 Tasa Fija 55,100.53

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202201/07/20228.4215 Tasa Fija 41,805.11

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202226/08/20228.9455 Tasa Fija 445,350.84

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202226/09/20228.9455 Tasa Fija 36,359.23

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202218/08/20228.9455 Tasa Fija 1,405,634.10

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202225/08/20228.9455 Tasa Fija 19,848.86

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202216/11/202210.1329 Tasa Fija 88,188.46

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/06/202205/12/202210.1329 Tasa Fija 352,804.14

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202209/09/20227.7955 Tasa Fija 1,468,236.42

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/06/202208/08/20228.417 Tasa Fija 1,919,986.66

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 78 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/06/202226/09/20228.9475	Tasa Fija	29,255.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202225/07/20228.43	Tasa Fija	1,187,572.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202209/09/20228.9525	Tasa Fija	105,311.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202211/10/20228.9525	Tasa Fija	100,261.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202228/09/20228.9525	Tasa Fija	42,839.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202205/09/20228.9525	Tasa Fija	2,987,252.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202205/12/202210.2775	Tasa Fija	554,440.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202205/08/20228.43	Tasa Fija	4,301.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202213/07/20228.43	Tasa Fija	7,162.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202219/09/20228.9525	Tasa Fija	23,413.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202205/10/20228.9525	Tasa Fija	33,350.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202206/09/20228.9525	Tasa Fija	24,113.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202203/10/20228.9525	Tasa Fija	424,051.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202228/09/20228.9525	Tasa Fija	60,336.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202214/10/202210.2775	Tasa Fija	11,057.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202208/11/202210.2775	Tasa Fija	9,608.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202223/09/20228.9525	Tasa Fija	1,724,389.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202203/10/20228.9525	Tasa Fija	48,341.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202222/11/202210.2775	Tasa Fija	110,603.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202206/12/202210.2775	Tasa Fija	333,922.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/06/202212/09/20227.38		Tasa Fija	501,742.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202205/08/20228.43	Tasa Fija	806,902.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202212/09/20228.9525	Tasa Fija	201,528.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202209/09/20228.9525	Tasa Fija	288,188.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202226/09/20228.9525	Tasa Fija	28,977.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202207/09/20228.9525	Tasa Fija	449,269.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/06/202229/07/20221.76229		Tasa Fija	20,137,271.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202203/10/20228.99	Tasa Fija	219,855.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202205/10/20228.99	Tasa Fija	3,557,031.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202212/09/20228.99	Tasa Fija	510,150.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202209/09/20228.99	Tasa Fija	40,832.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202228/09/20228.99	Tasa Fija	174,491.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202213/10/20228.99	Tasa Fija	1,003,614.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202206/12/202210.349	Tasa Fija	124,549.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202220/07/20228.4355	Tasa Fija	221,541.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202223/08/20228.99	Tasa Fija	257,977.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202205/10/20228.99	Tasa Fija	1,901,187.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202202/12/202210.349	Tasa Fija	1,255,128.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202209/12/20227.3855		Tasa Fija	2,006,564.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202201/08/20228.4355	Tasa Fija	8,111.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202207/09/20228.99	Tasa Fija	335,674.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202205/10/20228.99	Tasa Fija	1,556,235.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202203/10/20228.99	Tasa Fija	307,873.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202212/09/20227.84		Tasa Fija	977,832.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202213/09/20227.3855		Tasa Fija	1,481,070.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202213/09/20227.3855		Tasa Fija	217,310.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202213/09/20227.3855		Tasa Fija	516,113.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202209/12/20227.3855		Tasa Fija	40,131,297.78

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 79 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202201/07/20228.4525	Tasa Fija	34,291.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202208/08/20228.4525	Tasa Fija	57,211.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202225/07/20228.4525	Tasa Fija	13,974.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202225/07/20228.4525	Tasa Fija	58,442.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202207/10/20229.005	Tasa Fija	826,631.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202212/09/20229.005	Tasa Fija	20,391.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202229/08/20222.74112	Tasa Fija	288,743.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202226/09/20223.33506	Tasa Fija	1,526,839.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202201/07/20228.4525	Tasa Fija	95,415.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202215/08/20228.4525	Tasa Fija	335,466.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202201/07/20228.4525	Tasa Fija	1,085,625.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202210/08/20228.4525	Tasa Fija	394,478.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202206/09/20229.005	Tasa Fija	132,426.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202225/08/20229.005	Tasa Fija	557,812.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202225/08/20229.005	Tasa Fija	459,288.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202212/08/20228.4525	Tasa Fija	1,717.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202208/08/20228.4525	Tasa Fija	666,976.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202222/07/20228.4525	Tasa Fija	441,549.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202222/07/20228.4525	Tasa Fija	1,042,065.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202219/09/20229.005	Tasa Fija	86,837.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202203/10/20229.005	Tasa Fija	1,030.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202206/12/202210.4148	Tasa Fija	83,000.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202215/08/20228.4525	Tasa Fija	245,956.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202226/09/20229.005	Tasa Fija	37,696.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202203/10/20229.005	Tasa Fija	68,715.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202209/12/202210.4148	Tasa Fija	236,657.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202214/09/20227.4025		Tasa Fija	1,184,622.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202213/09/20227.855		Tasa Fija	977,589.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202213/12/20227.4025		Tasa Fija	2,006,168.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202214/09/20227.4025		Tasa Fija	374,108.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202214/09/20227.4025		Tasa Fija	362,113.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202215/08/20228.4725	Tasa Fija	159,613.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202220/07/20228.4725	Tasa Fija	44,738.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202218/07/20228.4725	Tasa Fija	86,143.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202214/09/20229.05	Tasa Fija	16,743.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	4,289,706.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202224/08/20229.05	Tasa Fija	2,012,548.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202212/09/20229.05	Tasa Fija	231,782.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202229/08/20229.05	Tasa Fija	93,151.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	3,626,243.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202217/11/202210.3771	Tasa Fija	695,281.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202224/11/202210.3771	Tasa Fija	4,239,219.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202216/08/20228.4725	Tasa Fija	8,628.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202222/07/20228.4725	Tasa Fija	5,229,735.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202210/08/20228.4725	Tasa Fija	1,036,504.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202226/08/20229.05	Tasa Fija	1,076,154.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202207/10/20229.05	Tasa Fija	222,806.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	23,771.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202212/10/20229.05	Tasa Fija	16,117,155.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202214/10/20229.05	Tasa Fija	270,950.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/06/202219/09/20229.05	Tasa Fija	239,145.19

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 80 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202217/11/202210.3771	Tasa Fija	784,338.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202213/12/202210.3771	Tasa Fija	11,340.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202203/10/20223.85756	Tasa Fija	315,379.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202215/09/20227.4225	Tasa Fija	451,298.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202215/08/20228.4725	Tasa Fija	666,272.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202223/08/20229.05	Tasa Fija	13,818.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202212/10/20229.05	Tasa Fija	1,470,957.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202225/08/20229.05	Tasa Fija	803,126.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202214/10/20229.05	Tasa Fija	278,978.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202205/10/20229.05	Tasa Fija	883,720.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	374,221.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202205/10/20229.05	Tasa Fija	54,762.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202227/10/202210.3771	Tasa Fija	36,727.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202213/12/202210.3771	Tasa Fija	206,146.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202213/12/202210.3771	Tasa Fija	9,470.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202214/12/20228.1245	Tasa Fija	6,689,383.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202215/09/20227.4225	Tasa Fija	316,786.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202215/09/20227.4225	Tasa Fija	298,684.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202211/08/20228.4725	Tasa Fija	620,920.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	2,009.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202212/10/20229.05	Tasa Fija	1,323,425.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/06/202210/10/20229.05	Tasa Fija	5,593.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202214/10/20227.4225	Tasa Fija	1,002,886.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/06/202214/12/20227.4225	Tasa Fija	2,005,773.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202208/07/20228.48	Tasa Fija	185,815.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/08/20228.48	Tasa Fija	253,769.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/08/20228.48	Tasa Fija	9,595.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202215/08/20228.48	Tasa Fija	94,092.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202209/09/20229.09	Tasa Fija	58,304.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202208/09/20229.09	Tasa Fija	122,313.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/10/20229.09	Tasa Fija	25,335.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202212/09/20229.09	Tasa Fija	319,879.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202212/09/20229.09	Tasa Fija	87,772.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202225/08/20229.09	Tasa Fija	423,034.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/10/20229.09	Tasa Fija	422,585.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202213/12/202210.4713	Tasa Fija	7,944.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202220/10/202210.4713	Tasa Fija	35,002.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/10/20229.09	Tasa Fija	310,741.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202211/10/20229.09	Tasa Fija	403,151.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202212/09/20229.09	Tasa Fija	2,431.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/10/20229.09	Tasa Fija	7,454.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202209/12/202210.4713	Tasa Fija	1,863,490.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/06/202215/09/20227.43	Tasa Fija	1,083,434.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202208/08/20228.48	Tasa Fija	19,728.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202211/07/20228.48	Tasa Fija	24,919.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202210/08/20228.48	Tasa Fija	182,236.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202201/07/20228.48	Tasa Fija	108,354.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202207/10/20229.09	Tasa Fija	368,844.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/06/202212/09/20229.09	Tasa Fija	107,782.65

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02

AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 81 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202212/10/20229.09	Tasa Fija	1,083,679.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202229/08/20229.09	Tasa Fija	726,345.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202214/09/20229.09	Tasa Fija	76,278.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202203/10/20229.09	Tasa Fija	657,279.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202214/12/202210.4713	Tasa Fija	381,215.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202208/07/20228.48	Tasa Fija	48,175.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202223/09/20229.09	Tasa Fija	9,930.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202215/12/20227.43		Tasa Fija	2,004,540.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202215/08/20228.4875	Tasa Fija	4,496,250.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202212/10/20229.1	Tasa Fija	581,878.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202228/09/20229.1	Tasa Fija	255,182.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202212/09/20229.1	Tasa Fija	125,109.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202211/11/202210.5324	Tasa Fija	216,730.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202216/12/202210.5324	Tasa Fija	1,139,249.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202213/10/20229.1	Tasa Fija	309,316.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202221/10/202210.5324	Tasa Fija	1,074,970.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202229/07/20228.4875	Tasa Fija	3,053,970.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202210/10/20229.1	Tasa Fija	34,118.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202230/08/20229.1	Tasa Fija	475,963.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202212/09/20229.1	Tasa Fija	9,829.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202210/10/20229.1	Tasa Fija	432,073.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202219/09/20227.4375		Tasa Fija	1,083,213.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202207/09/20229.1	Tasa Fija	72,071.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202223/09/20229.1	Tasa Fija	1,270,692.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202215/11/202210.5324	Tasa Fija	86,835.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202216/12/20227.4375		Tasa Fija	2,004,131.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202215/09/20227.95		Tasa Fija	1,465,929.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202219/09/20227.4375		Tasa Fija	501,032.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202202/08/20228.505	Tasa Fija	124,752.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202210/08/20228.505	Tasa Fija	24,839.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202220/09/20229.13	Tasa Fija	44,992.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202220/10/20229.13	Tasa Fija	2,004,564.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202212/10/20229.13	Tasa Fija	4,561,952.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202221/10/202210.5324	Tasa Fija	24,078.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202211/11/202210.5324	Tasa Fija	343,824.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202229/08/20223.13428	Tasa Fija	819,615.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202226/09/20223.91372	Tasa Fija	95,582.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202207/10/20229.13	Tasa Fija	202,675.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202212/10/20229.13	Tasa Fija	1,232,491.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202212/10/20229.13	Tasa Fija	1,817,917.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202221/09/20229.13	Tasa Fija	632,345.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202220/09/20227.455		Tasa Fija	1,087,758.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202208/08/20228.505	Tasa Fija	32,731.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202220/09/20229.13	Tasa Fija	232,349.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202229/08/20229.13	Tasa Fija	68,493.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202212/10/20229.13	Tasa Fija	1,624,278.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202230/08/20229.13	Tasa Fija	405,932.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202218/10/20229.13	Tasa Fija	1,323,012.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202219/12/20227.455		Tasa Fija	5,860,902.94

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 82 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202220/09/20227.455 Tasa Fija 180,836.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202220/09/20227.455 Tasa Fija 587,718.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202219/12/20227.455 Tasa Fija 2,003,727.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202222/07/20227.455 Tasa Fija 3,005,591.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202215/08/20228.5275 Tasa Fija 319,228.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202229/08/20229.18 Tasa Fija 764,132.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202212/09/20229.18 Tasa Fija 13,474.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202228/09/20229.18 Tasa Fija 396,576.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202210/10/20229.18 Tasa Fija 15,980.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202229/07/20228.5275 Tasa Fija 342,648.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202205/08/20228.5275 Tasa Fija 229,761.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202213/09/20229.18 Tasa Fija 67,439.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202219/10/20229.18 Tasa Fija 3,633.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202225/08/20229.18 Tasa Fija 1,062,764.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202212/09/20229.18 Tasa Fija 1,213.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202210/10/20229.18 Tasa Fija 17,348.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202230/08/20229.18 Tasa Fija 856,492.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202228/09/20229.18 Tasa Fija 118,254.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202215/12/202210.5726 Tasa Fija 154,418.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202213/12/202210.5726 Tasa Fija 18,506.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202222/07/20222.6985 Tasa Fija 34,175.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202229/07/20223.15728 Tasa Fija 29,842.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202219/09/20228.03 Tasa Fija 975,998.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202212/08/20228.5275 Tasa Fija 42,544.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202211/07/20228.5275 Tasa Fija 295.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202225/07/20228.5275 Tasa Fija 12,499.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202227/07/20228.5275 Tasa Fija 950,474.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202202/09/20229.18 Tasa Fija 1,158,842.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202213/09/20229.18 Tasa Fija 200,934.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202230/08/20229.18 Tasa Fija 156,909.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202221/09/20227.4775 Tasa Fija 1,064,648.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202221/09/20227.4775 Tasa Fija 316,399.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202220/12/20227.4775 Tasa Fija 2,003,323.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202221/09/20227.4775 Tasa Fija 451,999.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202220/12/20227.4775 Tasa Fija 2,003,323.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202219/04/20237.4775 Tasa Fija 10,016,616.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/06/202220/12/20227.4775 Tasa Fija 1,702,824.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202205/08/20228.5413 Tasa Fija 3,359,010.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202219/09/20229.2337 Tasa Fija 3,397,904.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202218/10/20229.2337 Tasa Fija 15,911.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202226/09/20229.2337 Tasa Fija 497,055.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202212/10/20229.2337 Tasa Fija 113,509.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202220/12/202210.558 Tasa Fija 193,599.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/06/202220/12/202210.558 Tasa Fija 36,123.63

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 83 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202219/09/20223.20434	Tasa Fija	96,747.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202208/07/20228.5413	Tasa Fija	3,460.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202215/08/20228.5413	Tasa Fija	16,301.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202209/08/20228.5413	Tasa Fija	494,500.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202207/10/20229.2337	Tasa Fija	692,860.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202219/10/20229.2337	Tasa Fija	39,032.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202205/10/20229.2337	Tasa Fija	309,309.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202211/11/202210.558	Tasa Fija	47,187.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202220/12/202210.558	Tasa Fija	1,284,177.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202222/11/202210.558	Tasa Fija	123,340.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202221/10/20227.4913		Tasa Fija	1,001,456.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202218/08/20228.5413	Tasa Fija	782,397.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202207/10/20229.2337	Tasa Fija	105,002.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202222/09/20229.2337	Tasa Fija	100,709.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202229/08/20229.2337	Tasa Fija	46,373.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202229/08/20229.2337	Tasa Fija	394,694.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202229/09/20229.2337	Tasa Fija	601,449.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202205/10/20229.2337	Tasa Fija	703,197.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202215/12/202210.558	Tasa Fija	771,473.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202220/12/202210.558	Tasa Fija	152,676.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/06/202220/12/202210.558	Tasa Fija	9,389.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202222/09/20227.4913		Tasa Fija	515,174.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202222/09/20227.4913		Tasa Fija	270,466.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202221/12/20227.4913		Tasa Fija	2,002,913.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202221/12/20227.4913		Tasa Fija	1,702,476.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202222/09/20227.4913		Tasa Fija	500,728.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202215/07/20229.1625	Tasa Fija	186,488.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202215/07/20229.1625	Tasa Fija	219,457.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202214/10/20229.5635	Tasa Fija	94,020.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202222/08/20229.1625	Tasa Fija	116,165.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202219/08/20229.1625	Tasa Fija	34,835.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202222/08/20229.1625	Tasa Fija	46,450.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202222/08/20229.1625	Tasa Fija	2,577.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202221/10/20229.5635	Tasa Fija	514,668.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202219/09/20229.5635	Tasa Fija	359,836.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202201/09/20229.5635	Tasa Fija	1,683,632.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202220/10/20229.5635	Tasa Fija	32,915.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202221/10/20229.5635	Tasa Fija	1,305,385.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202225/10/20229.5635	Tasa Fija	10,586.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202226/09/20229.5635	Tasa Fija	158,235.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202226/09/20229.5635	Tasa Fija	640,811.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202226/09/20229.5635	Tasa Fija	142,836.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202212/10/20229.5635	Tasa Fija	29,040.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202210/10/20229.5635	Tasa Fija	166,110.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202201/08/20229.1625	Tasa Fija	6,100,626.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202215/08/20229.1625	Tasa Fija	4,475,071.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202205/09/20229.5635	Tasa Fija	110,147.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202206/12/202210.5117	Tasa Fija	481,192.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202215/08/20229.1625	Tasa Fija	1,269,281.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/06/202224/08/20229.1625	Tasa Fija	45,355.47

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 84 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202215/08/20229.1625	Tasa Fija	11,654,716.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202214/10/20229.5635	Tasa Fija	203,384.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202203/10/20229.5635	Tasa Fija	134,750.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202212/10/20229.5635	Tasa Fija	302,013.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202205/09/20229.5635	Tasa Fija	293,804.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202226/09/20229.5635	Tasa Fija	19,095.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202212/10/20229.5635	Tasa Fija	3,853,168.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202223/12/202210.5117	Tasa Fija	2,046,086.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202218/11/202210.5117	Tasa Fija	74,249.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202210/11/202210.5117	Tasa Fija	1,477,202.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202220/12/202210.5117	Tasa Fija	88,130.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202221/12/202210.5117	Tasa Fija	6,531.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202222/09/20228.1125	Tasa Fija	26,023,436.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202223/09/20228.1125	Tasa Fija	343,259.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202223/09/20228.1125	Tasa Fija	451,656.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202223/09/20228.4135	Tasa Fija	974,232.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202222/12/20228.1125	Tasa Fija	2,001,802.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202224/06/20268.268	Tasa Fija	82,235,374.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202222/12/20228.1125	Tasa Fija	2,001,802.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202220/12/202210.7119	Tasa Fija	62,031.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202223/09/20229.545	Tasa Fija	197,356.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202219/10/20229.545	Tasa Fija	79,729.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202226/10/20229.545	Tasa Fija	650,517.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202224/08/20229.168	Tasa Fija	88,371.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202222/09/20229.545	Tasa Fija	54,273.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202217/11/202210.7119	Tasa Fija	48,997.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202213/12/202210.7119	Tasa Fija	680,581.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202226/09/20228.118	Tasa Fija	400,270.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202221/09/20228.118	Tasa Fija	27,018,265.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202229/07/20229.168	Tasa Fija	1,098,892.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202219/09/20229.545	Tasa Fija	486,406.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202216/12/202210.7119	Tasa Fija	604,075.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202225/08/20229.168	Tasa Fija	40,450.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202201/08/20229.168	Tasa Fija	1,706,438.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202229/08/20229.545	Tasa Fija	1,120,852.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202207/09/20229.545	Tasa Fija	147,020.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202220/10/20229.545	Tasa Fija	610,901.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202223/12/20228.118	Tasa Fija	2,001,353.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202226/09/20228.118	Tasa Fija	406,399.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202223/12/20228.118	Tasa Fija	2,001,353.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202226/10/20228.118	Tasa Fija	60,040,590.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202223/12/20228.1245	Tasa Fija	1,085,734.20

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 85 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202226/08/20229.1755	Tasa Fija	91,703.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202215/08/20229.1755	Tasa Fija	136,697.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202222/08/20229.1755	Tasa Fija	128,017.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202225/10/20229.5469	Tasa Fija	552,477.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202229/08/20229.5469	Tasa Fija	271,277.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202219/10/20229.5469	Tasa Fija	6,933,868.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202210/10/20229.5469	Tasa Fija	542,151.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202218/11/202210.7109	Tasa Fija	100,977.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202217/10/20223.95329	Tasa Fija	6,375.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202221/09/20229.5469	Tasa Fija	48,018.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202210/08/20229.1755	Tasa Fija	115,844.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202201/08/20229.1755	Tasa Fija	306,385.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202219/09/20229.5469	Tasa Fija	83,004.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202227/10/20229.5469	Tasa Fija	300,159.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202219/10/20229.5469	Tasa Fija	259,383.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202212/09/20229.5469	Tasa Fija	54,000.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202226/12/20228.1255		Tasa Fija	4,201,895.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202219/09/20229.5469	Tasa Fija	1,100,920.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202208/09/20229.5469	Tasa Fija	2,246,495.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202220/10/20229.5469	Tasa Fija	772,399.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202203/10/20229.5469	Tasa Fija	27,785.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202204/11/202210.7109	Tasa Fija	23,504.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202212/09/20229.5469	Tasa Fija	62,285.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/06/202219/10/20229.5469	Tasa Fija	67,299.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202209/12/20228.1255		Tasa Fija	4,555,514.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202227/10/20228.1255		Tasa Fija	4,001,805.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202226/12/20228.1255		Tasa Fija	2,000,902.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202227/09/20228.1255		Tasa Fija	300,216.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202227/09/20228.1255		Tasa Fija	496,599.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202205/08/20229.1745	Tasa Fija	480,308.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202217/08/20229.1745	Tasa Fija	96,815.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202225/08/20229.1745	Tasa Fija	561,809.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202205/08/20229.1745	Tasa Fija	1,314,334.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202205/08/20229.1745	Tasa Fija	162,457.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202214/10/20229.5405	Tasa Fija	773,930.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202227/09/20229.5405	Tasa Fija	41,421.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202206/09/20229.5405	Tasa Fija	208,855.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202228/09/20229.5405	Tasa Fija	200,083.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202226/09/20229.5405	Tasa Fija	128,189.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202219/10/20229.5405	Tasa Fija	500,780.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202203/10/20223.97838	Tasa Fija	70,824.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202227/09/20229.5405	Tasa Fija	2,964.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202212/10/20229.5405	Tasa Fija	172,745.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202228/10/20229.5405	Tasa Fija	585,775.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202219/10/20229.5405	Tasa Fija	429,173.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202226/09/20229.5405	Tasa Fija	2,434,703.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202229/11/202210.7157	Tasa Fija	247,642.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202219/08/20229.1745	Tasa Fija	77,013.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202201/08/20229.1745	Tasa Fija	122,562.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202218/08/20229.1745	Tasa Fija	355,674.28



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 87 / 87

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

TOTAL - - - - -  
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas 8,306,533,331.28  
10,605,000,000.00 2,093,000,000.00 - - 3,360,000,000.00 235,225,000.00 - -  
- - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL  
Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo  
Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Proveedores [sinopsis]  
Proveedores

TOTAL  
Total proveedores  
Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de  
interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]  
Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año  
[miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años  
o más [miembro]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]  
Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL  
Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo  
Total de créditos

Comentarios:  
El tipo de cambio tomado al cierre de junio fue de 20.1353

"VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF"

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 1 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

## Instrumentos Financieros Derivados

### I. Información Cualitativa

#### a. Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.

Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la

---

---

Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.

Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.

Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

**Negociación:** La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

**Cobertura:** Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

**Arbitraje:** Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.

Manual de Operación de Derivados.

Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

Política de Riesgo de Contraparte

Política de Sobregiros

---

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el segundo trimestre de 2022, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

Núm.	Tipo de Cobertura	Posición	Cubierta	Tipo de posición cubierta	Condición de Mercado	Derivado
1.	Flujos de Efectivo	Pagarés	con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)
2.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente.	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
3.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante	Activa	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)	
4.	Valor Razonable	Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera	Activa	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
5.	Flujos de Efectivo	Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
6.	Valor Razonable	Bonos de tasa fija en moneda funcional	Pasiva	Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)	
7.	Flujos de Efectivo	Reportos	Pasiva	Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés	Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)	
8.	Flujos de Efectivo	Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera	Activa	Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN	Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa	



flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional  
9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y sensibilidad del margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Banco se encuentran:

Subyacente\*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

\*Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (Currency Swaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (Forward Starting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:

El Modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo

El Modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.

El Modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)

El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

Satisfacer todos los compromisos diarios de flujo de efectivo.

Eliminar la necesidad de obtener fondos a tasas por arriba de las de mercado o a través de ventas forzadas de activos.

Satisfacer los límites y requerimientos de liquidez exigidas por las autoridades. Establecer e implementar políticas de liquidez prudentes.

Desarrollar e implementar técnicas y procedimientos efectivos para monitorear, medir y controlar los requerimientos de liquidez.

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

Medir, supervisar y pronosticar compromisos que involucren flujos de efectivo. Diversificar fuentes de fondeo.

Realizar análisis de liquidez en condiciones de crisis y mantener suficientes activos líquidos para hacer frente a eventos inesperados.

Mantener un plan de contingencia de liquidez y de fondeo

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de junio 2022 y en promedio para el segundo trimestre de 2022 es de:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 61,13453,469

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 79,16586,605

---

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura.

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2 & Wall Street).

Clase de activo Derivado Tipo Breve descripción

Tasas de interés Opciones Europea Caps, Floors:

Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets.

$$\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$$

Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet.

$$\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$$

Binaria La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos.

La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:

Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap).

Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).

IRSEl intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).

CCIRS Intercambio de intereses en moneda

nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.

Tipo de cambio Opciones Europea En este tipo de contratos se utiliza la fórmula

Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black-Scholes-Merton.

Americana El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)

Binaria Se recibe un pago fijo como beneficio en caso de que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción.

A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.

Barrera Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento  $S_T$ , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento  $S_{t < T}$ , son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria.

Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente  $S_T$  alcance un umbral preestablecido  $H$  llamado barrera de la opción.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 7 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

ForwardForward OTCCompra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

Clase de activoDerivadoTipoBreve descripción

Índices, capitales y metalesOpciones

EuropeaOpción Europea Call / Put: Este tipo de contratos utiliza la fórmula de Black-Scholes.

Opción Europea Quanto: Una opción tipo Quanto es un derivado en el cual el subyacente se denomina en una moneda, pero el instrumento en sí se liquida en otra moneda a una tasa determinada. Tales productos son atractivos para los inversionistas que desean estar expuestos a un activo extranjero, pero sin el riesgo de tipo de cambio equivalente.

BinariaTipo de opción la cual al vencimiento solo tiene dos eventos pagar o no pagar un monto previamente definido.

Derivados listadosMexder FuturesIRLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre Contrato de Intercambio de Flujos de Tasas son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

FXLas Condiciones Generales del Contrato de Futuro sobre el tipo de cambio son acorde a metodología disponible en sitio Mexder.

Instrumentos valuados a costo

Clase de activoNombre de productoMetodologíaNotas

FI SecurityBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

EQ CashAccionesLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Fondos de inversiónETFsLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Notas Estructuradas listadasBonosLos precios/insumos son proporcionados por el proveedor de precios diariamente.La regulación local requiere el uso de Valmer para los precios e insumos de datos del mercado.

Políticas Líneas de Crédito

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

Necesidades de tesorería del Banco

Relación de corresponsalía

Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

---

---

Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:  
Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

Tesorería: Call Money

Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

Cambios: FOREX

Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

Metales

Sujetos de Crédito

Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:

Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.

Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)

Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure". La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar. Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

Idoneidad del Cliente

La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:

El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar

Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad,

---

---

basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

#### Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

#### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

##### Métodos y técnicas de Valuación:

##### Cálculo de Sensibilidades

La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L). Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

##### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).

Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.

##### Bonos de Tasa Flotante

En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.

---

---

Con metodología se asume que la reprecación ocurre justamente al pago de cupón.

#### Bonos Cupón Cero

Para el cómputo de la sensibilidad de instrumentos cupón cero, se utiliza el mismo sistema utilizado en instrumentos de tasa fija.

#### Riesgo de Crédito

También se utiliza el concepto de duración, pero en el caso de los instrumentos de tasa flotante se utiliza la duración total de instrumento en lugar de la "duración al próximo cupón".

#### Sensibilidad del Pasivo

Gran parte del portafolio de trading de la institución se encuentra fondeado con reportos. Para efectos de determinar cuál es la sensibilidad de la parte corta (el financiamiento) de las posiciones, se determina el cambio del valor del portafolio ante un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).

#### Derivados de Tasas de Interés

##### Swaps de Tasa de Interés

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.

En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back

##### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

##### Futuros de Bono M

Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.

##### Futuros de CETE

El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.

#### Efectividad De la Cobertura:

Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor

---

---

razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.

Las pruebas consideran 61 escenarios históricos y se realiza con base en un análisis de regresión.

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios semanales históricos, es decir una ventana de observación mayor a un año.

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios arriba descritos. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados:  $\geq 80\%$ .

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. Al cierre de junio 2022 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el segundo trimestre de 2022 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha de actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego a los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre:

La ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

---



Cobertura de Valor Razonable:

La ganancia o pérdida que resulte de valorar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.

La ganancia o pérdida que resulte de valorar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base 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 2022 y promedio del segundo trimestre 2022 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank Posición Posición

(millones de pesos) (Cierre) (Promedio)

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 79,16586,605

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.

Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

Scotiabank NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés  
(millones de pesos)

Gap 30d Gap Acum61,13457,76857,76857,767

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,366)(3,366)(3,367)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

---

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.

Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

#### Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas  $\gamma_{1\%}$  y  $\gamma_{5\%}$ .

$\gamma_{1\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que  $\gamma_{5\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

#### Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 02 AÑO: 2022

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 15 / 22

CONSOLIDADO

Impresión Final

puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.

Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.

## Dividend Risk

La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continúa conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

El riesgo de dividendos no tiene una letra "griega" asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

## II. Información Cuantitativa

Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a junio 30, 2022:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	96,859.00	(63,229.00)	283,699.00	(540,239.00)	(145,004.00)	1,191.00	(366,723.00)
CCS	12.00	168.00	26.00	(237.00)	328.00	(30.00)	267.00
Caps&Floors	133.00	1,101.00	97.00	182.00	0.00	0.00	1,513.00
Binary Caps&Floors	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
TIIE Futures	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Mbonds Futures	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-----
Total DERIVATIVES	97,004.00	(61,960.00)	283,822.00	(540,294.00)	(144,676.00)	1,161.00	(364,943.00)

## Análisis de sensibilidad

### Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular la sensibilidad es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (47.07) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (94.14) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (217.09) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

Escenarios a la Alza

0.050.150.2  
Options IDBTVR.INDX---  
Options MEXAS5.INDX---  
Options MEXEZU.USM---  
Options MEXFR5.INDX---  
Options MEXFXI.USM---  
Options MEXGLD.USM---  
Options MEXIL5.INDX86,738.25260,214.75346,953.00  
Options MEXIXM.INDX---  
Options MEXMCH.USM---  
Options MEXIBX.INDX---  
Options MXSXA.E.INDX421.701,265.101,686.80  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
TOTAL87,159.95261,479.85348,639.80

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:

Del EscenarioMonto  
Probable(174,319.90)  
Poco Probable(522,959.70)  
Muy poco Probable(871,599.50)

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de junio de 2022 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	53,400,000	(101,900,000)
CLIENTE 2	MXN	232,500,000	(63,100,000)
CLIENTE 3	MXN	94,800,000	(82,800,000)
CLIENTE 4	MXN	671,600,205	(460,800,000)
CLIENTE 5	USD	31,760,000	(32,950,000)
CLIENTE 6	USD	223,040,000	(11,400,000)
CLIENTE 7	USD	155,700,000	(202,400,000)
CLIENTE 8	USD	-	(320,000)
CLIENTE 9	USD	4,130,000	(5,650,000)
CLIENTE 10	USD	150,000	-
CLIENTE 11	USD	26,750,000	(19,790,000)
CLIENTE 12	USD	5,700,000	(4,970,000)
CLIENTE 13	MXN	373,200,000	(462,200,000)
CLIENTE 14	MXN	411,600,000	(277,800,000)
CLIENTE 15	MXN	15,500,000	(105,800,000)
CLIENTE 16	MXN	1,562,100,000	(1,106,800,000)
CLIENTE 17	USD	12,630,000	-
CLIENTE 18	MXN	390,200,000	(3,983,400,000)

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

CLIENTE 19MXN	62,500,000	(62,800,000)
CLIENTE 20USD	6,000,000	(11,510,000)
CLIENTE 21USD	2,790,000	(1,620,000)
CLIENTE 22MXN	-	(105,000,000)
TOTAL	4,336,050,204.71	(7,103,010,000)

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 19 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02**

AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 20 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 21 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Liquidados anticipadamente

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

Cifras expresadas en pesos

Producto	Fecha de evento	Contraparte/	Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	1	MXN	9,562	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	2	MXN	136,081	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	3	MXN	6,886	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	4	MXN	8,787	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	5	MXN	17,050	NO ENVIO EL DINERO POR FALLAS EN SU SISTEMA
Forwards	FXabr-22	Cliente	6	MXN	145,896	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards	FXabr-22	Cliente	7	MXN	223,318	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards	FXabr-22	Cliente	8	MXN	72,308	NO ENVIO LOS FONDOS
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	9	MXN	579,370	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	10	MXN	324	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards	FXabr-22	Cliente	11	MXN	609,360	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	12	MXN	612,408	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	13	MXN	614,868	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	14	MXN	622,905	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	15	MXN	627,435	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	16	MXN	1,264,680	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	17	MXN	632,070	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	18	MXN	632,925	PAGO FUERA DE HORARIO
Forwards	FXabr-22	Cliente	19	MXN	635,895	PAGO FUERA DE HORARIO
Interest Rate Swap	abr-22	Cliente	20	MXN	531,517	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	21	MXN	24,257	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	22	MXN	58,443	NO FONDEO SU CUENTA

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **02** AÑO: **2022**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 22 / 22

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	23MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	24MXN	266,843	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	25MXN	2,885	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	26MXN	1,376	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	27MXN	516,845	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	28MXN	585,330	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	may-22	Cliente	29MXN	187	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	30MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	may-22	Cliente	31MXN	203,771	NO FONDEO SU CUENTA
FX Options (Vanilla)	jun-22	Cliente	32MXN	2,025,000	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	33MXN	2,270	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	34MXN	(2,874)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	35MXN	69,961	NO ENVIO LOS FONDOS
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	36MXN	99,944	NO ENVIO LOS FONDOS
Forwards FX	jun-22	Cliente	37USD	117,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente	38USD	128,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente	39USD	137,000	NO FONDEO SU CUENTA
Forwards FX	jun-22	Cliente	40USD	151,000	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	41MXN	389,084	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	42MXN	(3,175)	NO SE LIQUIDA DEBIDO A LOS INCUMPLIMIENTOS QUE TIENEN
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	43MXN	312,150	NO FONDEO SU CUENTA
Interest Rate Swap	jun-22	Cliente	44MXN	391	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente	45MXN	2,172,412	NO FONDEO SU CUENTA
Cross Currency Swaps	jun-22	Cliente	46MXN	194,068	NO FONDEO SU CUENTA

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte  
Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

"VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF"