



ANEXO
SCOTIABANK

Scotiabank					
Indicadores Financieros					
	T3	2020 T2	T1	2019 T4	T3
ROE (Utilidad neta del trimestre anualizada / Capital contable promedio)	2.6	1.4	10.3	6.9	9.7
ROA (Utilidad neta del trimestre anualizada / Activo total promedio)	0.2	0.1	0.9	0.6	0.9
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	2.2	2.2	2.7	3.1	3.4
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	3.0	2.8	3.0	3.4	3.2
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	2.62	2.58	2.31	2.37	2.23
Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre)	143.8	125.0	121.4	118.6	121.5
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	15.91*	15.14	14.43	15.36	15.01
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	13.76*	13.44	12.91	13.69	13.30
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	76.5	65.9	65.8	66.5	57.4

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank Información Financiera Condensada (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%	30 sep 2019	30 sep 2020	A/A Δ%
Ingresos por intereses	13,022	12,581	11,764	-10%	37,858	37,067	-2%
Gastos por intereses	(7,109)	(6,162)	(5,378)	24%	(20,458)	(18,304)	11%
Margen Financiero	5,913	6,419	6,386	8%	17,400	18,763	8%
Comisiones	1,089	885	906	-17%	3,239	2,821	-13%
Intermediación	292	438	646	>+100%	528	1,826	>+100%
OI OE	407	388	257	-37%	1,649	1,140	-31%
Ingresos no Financieros	1,788	1,711	1,809	1%	5,416	5,787	7%
Ingresos	7,701	8,130	8,195	6%	22,816	24,550	8%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(1,521)	(3,057)	(2,951)	-94%	(4,185)	(8,011)	-91%
Total Ingresos	6,180	5,073	5,244	-15%	18,631	16,539	-11%
Gastos de Administración y Promoción	(4,465)	(4,488)	(4,880)	-9%	(12,866)	(13,960)	-9%
Resultado de la Operación	1,715	585	364	-79%	5,765	2,579	-55%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas y Asociadas	1	1	-	-100%	1	1	0%
Utilidad antes de Impuestos a la Utilidad	1,716	586	364	-79%	5,766	2,580	-55%
Impuestos a la Utilidad	(454)	(392)	(5)	99%	(1,736)	(643)	63%
Utilidad después de Impuestos a la Utilidad	1,262	194	359	-72%	4,030	1,937	-52%

En el tercer trimestre de 2020, la utilidad neta consolidada de Scotiabank Inverlat, S.A. de C.V. (Scotiabank), se ubicó en \$359 millones y la utilidad antes de impuestos fue de \$364 millones. Durante los dos últimos trimestres se constituyeron reservas voluntarias, por encima de las regulatorias por \$3,250 millones, \$1,540 en el primer trimestre y \$1,710 millones en el segundo; descontando este efecto, la utilidad del trimestre ascendería a \$1,556 millones, un incremento de \$294 millones o 23% respecto al año pasado.

La utilidad antes de impuestos, sin incluir las reservas mencionadas anteriormente asciende a \$2,074 millones, un incremento de \$358 millones o 21% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores ingresos y una menor estimación preventiva para riesgos crediticios, compensado parcialmente con mayores gastos de administración y promoción.

Respecto al trimestre anterior, sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, la utilidad antes de impuestos mostró una disminución de \$52 millones o 2%, principalmente por mayores gastos de administración y promoción, compensada parcialmente con una menor estimación preventiva para riesgos crediticios y mayores ingresos.

Al 30 de septiembre de 2020, la utilidad neta consolidada se ubicó en \$1,937 millones, sin incluir las reservas mencionadas con anterioridad, la utilidad se ubica en \$4,212 millones, un incremento anual de 5%, debido a un incremento de 8% en el total de ingresos y menores impuestos a la utilidad, compensado parcialmente por una mayor estimación preventiva para riesgos crediticios y gastos de administración y promoción.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank Comisiones y Tarifas (netas)	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%	30 sep 2019	30 sep 2020	A/A Δ%
Comisiones de Crédito	100	72	91	-9%	315	271	-14%
Manejo de cuenta	80	78	80	0%	248	241	-3%
Tarjeta de Crédito y Débito	519	369	389	-25%	1,556	1,208	-22%
Actividades fiduciarias	63	53	59	-6%	178	161	-10%
Servicios de banca electrónica	106	112	117	10%	305	348	14%
Compraventa de valores	11	11	12	9%	36	37	3%
Cartas de crédito sin refinanciamiento	43	54	44	2%	117	142	21%
Otras	167	136	114	-32%	484	413	-15%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	1,089	885	906	-17%	3,239	2,821	-13%

Scotiabank Otros Ingresos/Egresos de la Operación	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%	30 sep 2019	30 sep 2020	A/A Δ%
Otras Recuperaciones	-	-	-	0%	-	3	0%
Pérdida por Cesión de Cartera de Crédito	(2)	(3)	(3)	-50%	(4)	(13)	> -100%
Castigos y Quebrantos	(132)	(61)	(208)	-58%	(399)	(407)	-2%
Resultado neto por Venta de Bienes Adjudicados	28	12	20	-29%	99	58	-41%
Intereses por Préstamos a Empleados	1	1	1	0%	3	3	0%
Ingresos por Arrendamiento	24	21	20	-17%	71	62	-13%
Otras partidas de los Ingresos/Egresos de la operación	488	542	427	-13%	1,879	1,558	-17%
Pérdida por cesión de cartera de crédito	-	(124)	-	0%	-	(124)	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	407	388	257	-37%	1,649	1,140	-31%

Scotiabank Gastos de Administración y Promoción	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%	30 sep 2019	30 sep 2020	A/A Δ%
Gastos de Personal	(88)	(92)	(83)	6%	(226)	(250)	-11%
Gastos de Operación	(4,377)	(4,396)	(4,797)	-10%	(12,640)	(13,710)	-8%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,465)	(4,488)	(4,880)	-9%	(12,866)	(13,960)	-9%

En el tercer trimestre de 2020, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$2,951 millones, un incremento de \$1,430 millones respecto al mismo periodo del año pasado. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, se muestra una disminución de \$280 millones o 18%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera automotriz, tarjeta de crédito y cartera de consumo, así como mayores requerimientos en cartera hipotecaria y comercial.

Respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra una disminución de \$106 millones o 3%. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, se muestra una disminución de \$276 millones o 18%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera hipotecaria, comercial y automotriz.

Al 30 de septiembre de 2020, la estimación preventiva para riesgos crediticios, ascendió a \$8,011 millones, un incremento anual de \$3,826 millones o 91%. Sin incluir las reservas mencionadas anteriormente, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubica en \$4,761 millones, un incremento de \$576 millones o 14%, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial, cartera hipotecaria y de consumo; compensadas parcialmente por menores requerimientos de cartera automotriz y tarjeta de crédito.

Scotiabank Impuestos	3 meses				9 meses		
	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%	30 sep 2019	30 sep 2020	A/A Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)							
Impuesto a la Utilidad Causado	(644)	(220)	(508)	21%	(1,866)	(1,907)	-2%
Impuesto a la Utilidad Diferido	190	(172)	503	>+100%	130	1,264	>+100%
Total de Impuestos a la Utilidad	(454)	(392)	(5)	99%	(1,736)	(643)	63%

En el tercer trimestre de 2020, se registró un impuesto neto a cargo de \$5 millones, una disminución de \$449 millones o 99% respecto del mismo periodo del año pasado, principalmente por una menor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre anterior, el total de impuestos netos disminuyó \$387 millones o 99%, principalmente por la deflación registrada en el periodo anterior.

Al 30 de septiembre de 2020, el total de impuestos netos mostró una disminución anual de \$1,093 millones o 63%, principalmente a una menor utilidad del periodo.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%
Caja, bancos, Valores	127,859	195,736	222,901	74%
Cartera Vigente	395,588	431,937	412,269	4%
Cartera Vencida	9,027	11,424	11,085	23%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(10,972)	(14,280)	(15,940)	-45%
Otros Activos	32,324	31,090	36,139	12%
Activo Total	553,826	655,907	666,454	20%
Depósitos	368,533	417,452	407,167	10%
Préstamos bancarios	42,630	71,053	65,675	54%
Obligaciones Subordinadas	9,088	9,046	9,094	0%
Otros Pasivos	81,065	104,157	129,850	60%
Capital	52,510	54,199	54,668	4%
Total Pasivo y Capital	553,826	655,907	666,454	20%

Al 30 de septiembre de 2020, el total de activos de Scotiabank ascendió a \$666,454 millones, \$112,628 millones o 20% superior al mismo periodo del año pasado. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en inversiones en valores gubernamentales, principalmente en títulos para negociar y disponibles para la venta; así como a un crecimiento en deudores por reporto, cartera de crédito, un incremento en derivados con fines de negociación, disponibilidades y deudores por colaterales otorgados en efectivo.

Respecto al trimestre anterior, los activos totales incrementaron \$10,547 millones o 2%, debido principalmente a mayores volúmenes en inversiones en valores gubernamentales, principalmente en títulos disponibles para la venta y para negociar, así como un aumento en deudores por reporto; parcialmente compensados por una disminución en la cartera de crédito y disponibilidades.

El total del pasivo ascendió a \$611,786 millones al cierre de septiembre de 2020, un incremento de \$110,470 millones o 22% respecto al año pasado. Este crecimiento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos de clientes y plazo, préstamos bancarios de corto y largo plazo, acreedores por liquidación de operaciones, acreedores por reporto, derivados con fines de negociación y cobertura, así como en valores asignados por liquidar.

Respecto al trimestre anterior, el pasivo total aumentó \$10,078 millones o 2%, debido principalmente a mayores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones y reporto, así como en valores asignados por liquidar; parcialmente compensados por menores volúmenes en depósitos a plazo, títulos de crédito emitidos, préstamos bancarios de corto plazo y en derivados con fines de negociación.

La cartera vigente de préstamos de menudeo, creció \$13,037 millones u 8% respecto al año pasado y \$4,044 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento anual fue impulsado por un mayor volumen en la cartera hipotecaria por \$15,462 millones o 12%; parcialmente compensado con un menor volumen en tarjeta de crédito y otros préstamos personales por \$2,425 millones o 5%. El crecimiento trimestral, fue resultado de un incremento en la cartera hipotecaria por \$4,021 millones o 3% y en tarjeta de crédito y otros préstamos personales por \$23 millones.

El total de préstamos vigentes con entidades comerciales, financieras y gubernamentales mostró un incremento anual de \$3,644 millones o 2%. Este crecimiento fue impulsado principalmente por un mayor volumen en créditos gubernamentales. Respecto al trimestre anterior disminuyó \$23,712 millones o 9%, debido a menores volúmenes en créditos comerciales y entidades financieras; compensadas por un incremento en créditos gubernamentales.

La captación tradicional mostró un crecimiento anual del 10%, debido al incremento en depósitos a plazo 14%, depósitos de exigibilidad inmediata 9%. Respecto al trimestre anterior mostró una disminución del 2%, debido a la baja de volúmenes en depósitos a plazo 3% y títulos de crédito emitidos 9%.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank – Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	44,329	41,881	41,904	-5%
Créditos a la Vivienda	128,796	140,237	144,258	12%
Total Préstamos de Menudeo	173,125	182,118	186,162	8%
Actividad Empresarial o Comercial	179,984	201,821	180,787	0%
Entidades Financieras	33,567	35,152	31,618	-6%
Entidades Gubernamentales	8,912	12,846	13,702	54%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	222,463	249,819	226,107	2%
Total Cartera Vigente	395,588	431,937	412,269	4%

Scotiabank – Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%
Cartera Vencida	9,027	11,424	11,085	23%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(10,972)	(14,280)	(15,940)	-45%
Cartera Vencida Neta	(1,945)	(2,856)	(4,855)	> -100%
Cartera Vencida Bruta a Cartera Total	2.23%	2.58%	2.62%	39 pb
Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida	122%	125%	144%	2,200 pb

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	173,008	189,425	189,258	9%
Público en General	107,291	145,815	154,041	44%
Mercado de Dinero	51,313	41,915	27,230	-47%
Total Depósitos a Plazo	158,604	187,730	181,271	14%
Títulos de Crédito Emitidos	36,338	39,699	36,030	-1%
Cuenta global de captación sin movimientos	583	598	608	4%
Total de Depósitos	368,533	417,452	407,167	10%

Scotiabank Composición de Inversiones en Valores (millones de pesos al 30 de septiembre de 2020 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Títulos para negociar	67,991	-	9	100	68,100
Sin restricción:	-	-	4	-	4
Restringidos:	67,991	-	5	100	68,096
<i>En operaciones de reporto</i>	47,035	-	-	100	47,135
<i>Préstamos de valores</i>	628	-	-	-	628
<i>Otros</i>	20,328	-	5	-	20,333
Títulos disponibles para la venta	44,956	13,003	-	1,120	59,079
Sin restricción:	41,976	13,003	-	1,120	56,099
Restringidos:	2,980	-	-	-	2,980
<i>En operaciones de reporto</i>	2,130	-	-	-	2,130
<i>Otros</i>	850	-	-	-	850
Títulos conservados a vencimiento	5,035	-	-	-	5,035
Sin restricción	5,035	-	-	-	5,035
Total	117,982	13,003	9	1,220	132,214

Scotiabank Inversiones en Valores no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)				
Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-20401	11,513,256,939	4.15%	10	11,506

Scotiabank Derivados y operaciones de cobertura (millones de pesos al 30 de septiembre de 2020; valor razonable)														
	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		
Con fines de Negociación	1,990	1,577	-	-	561	364	321	342	16,002	16,469	-	-	18,874	18,752
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	4,250	6,641	-	-	4,250	6,641

Scotiabank**Montos nominales en operaciones derivadas****(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de septiembre de 2020)**

	Contratos adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación												
Posición USD	1,803	2,212	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN												
Divisas USD	-	-	-	-	22	22	274	274	-	-	-	-
Posición JPY	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	6	6	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	209	209	343	343	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	1,011	2,496	3,296	1,810	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	1	1	24,750	24,426	269,512	266,239	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	149	149	1,311	1,844	-	-
CLF Chilena	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Euros									25			
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	45,484	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	340	5	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-

Scotiabank**Cartera de Crédito Vigente****(millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)**

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	140,718	40,069	180,787
Créditos a entidades financieras	31,448	170	31,618
Créditos a entidades gubernamentales	13,702	-	13,702
Créditos al consumo	41,904	-	41,904
Créditos a la vivienda	144,221	37	144,258
Total	371,993	40,276	412,269

Scotiabank**Cartera de Crédito Vencida****(millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)**

	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	4,675	325	5,000
Créditos a entidades financieras	82	-	82
Créditos al consumo	1,224	-	1,224
Créditos a la vivienda	4,708	71	4,779
Total	10,689	396	11,085

Scotiabank	
Variaciones de Cartera Vencida	
(millones de pesos)	
Saldo al 30 de junio de 2020	11,424
Traspaso de Cartera Vigente a Vencida	1,035
Recuperaciones	(39)
Quitas y Castigos	(1,319)
Fluctuación Tipo de Cambio	(16)
Saldo al 30 de septiembre de 2020	11,085

Scotiabank	
Estimaciones preventivas para riesgos crediticios	
(millones de pesos)	
Saldo al 30 de junio de 2020	14,280
Más: Creación de reservas	3,038
Menos: Liberaciones	-
Cancelaciones	-
Adjudicaciones	105
Castigos y quitas	1,229
Comercial	144
Hipotecario	136
Consumo	949
Castigos y aplicaciones por programa de apoyo	-
Desliz cambiario	44
Saldo al 30 de septiembre de 2020	15,940

Scotiabank	30 sep	30 jun	30 sep
Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	2019	2020	2020
Cartera Vigente			
Metropolitano	61.6%	59.2%	61.7%
Noroeste – Centro	10.8%	10.8%	10.2%
Norte	14.1%	15.9%	15.0%
Bajío	7.9%	8.4%	7.8%
Sur	5.6%	5.7%	5.2%
Cartera Vencida			
Metropolitano	47.8%	36.5%	41.2%
Noroeste – Centro	14.8%	23.2%	15.4%
Norte	10.7%	10.8%	11.4%
Bajío	8.1%	9.1%	12.6%
Sur	18.6%	20.4%	19.4%

Scotiabank		
Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico		
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)		
No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	10,155	19.70%
2	7,534	14.61%
3	7,050	13.68%
4	6,999	13.58%
5	6,802	13.19%
6	6,087	11.81%
7	5,494	10.66%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		71,035

Scotiabank						
Calificación de la Cartera Crediticia						
Al 30 de septiembre de 2020						
(millones de pesos)						
	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				Total Reservas Preventivas
		Cartera Comercial	Consumo No Revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	301,647	835	123	395	239	1,592
Riesgo A2	67,206	677	39	211	19	946
Riesgo B1	30,595	451	46	83	13	593
Riesgo B2	15,445	208	57	58	51	374
Riesgo B3	12,022	300	37	67	35	439
Riesgo C1	6,897	167	52	154	66	439
Riesgo C2	4,485	12	114	376	161	663
Riesgo D	6,848	1,015	147	501	684	2,347
Riesgo E	6,189	2,749	687	909	682	5,027
Total	451,334	6,414	1,302	2,754	1,950	12,420
Exceso						3,520
Reservas Constituidas						15,940

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 septiembre de 2020.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$ 29
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	42
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	180
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	<u>3,269</u>
Total	\$ 3,520

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 septiembre 2020 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en valores - Títulos conservados al vencimiento” son:

Scotiabank			
Terminación anticipada de los programas hipotecarios			
Cetes especiales			
(millones de pesos)			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	505	07-jul-22
B4 220804	21,792	2	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,428	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	15,196,430	1,935	

Scotiabank			
Tasas Pagadas en Captación Tradicional			
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)			
	Pesos	Tasa Promedio Dólares	Udis
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	2.24%	0.32%	-
Depósitos a plazo	5.52%	0.00%	-

Scotiabank						
Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos						
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)						
Vencimiento	Préstamos		Financiamiento		Otros Organismos	Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento		
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	2,638	9,013	1,808	13,459
Largo	-	-	30,000	6,205	2,928	39,133
Total	-	-	32,638	15,218	4,736	52,592
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	6.49%	7.03%	5.01%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	9,976	-	17	394	5	10,392
Largo	-	-	-	477	2,214	2,691
Total	9,976	-	17	871	2,219	13,083
Tasa Promedio	0.38%	0.00%	2.12%	2.31%	1.02%	
Total Préstamos Interbancarios	9,976	-	32,655	16,089	6,955	65,675

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 septiembre de 2020.

Scotiabank Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 sep 2019	30 jun 2020	30 sep 2020
Depósitos a la Vista	52.2%	50.3%	50.2%
Metropolitano	27.8%	26.8%	21.4%
Noroeste – Centro	6.6%	7.2%	11.9%
Norte	7.1%	6.5%	7.7%
Bajío	5.2%	4.8%	3.6%
Sur	5.5%	5.0%	5.7%
Depósitos Ventanilla	32.3%	38.6%	41.6%
Metropolitano	11.9%	16.5%	21.8%
Noroeste - Centro	5.3%	5.2%	4.8%
Norte	5.9%	6.4%	7.3%
Bajío	4.8%	4.0%	2.4%
Sur	4.4%	6.5%	5.4%
Total de Captación del Público	84.5%	88.9%	91.9%
Fondeo Profesional	15.5%	11.1%	8.1%

Scotiabank Impuestos Diferidos (millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)	
Pérdida de arrastre fiscal	60
Provisión por perdidas de crédito	4760
Compensación diferida	(982)
Ingresos diferidos	591
Instalaciones y equipos / depreciación	611
Beneficios a los empleados	329
Provisiones	434
Otros	326
Efecto Neto en Diferido	6,129

Al 30 de septiembre de 2020, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank Resultados por Intermediación (millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)		
	Resultados del periodo por Valuación	Resultados del periodo por Compra - Venta
Inversiones en valores	24	256
Operaciones con instrumentos financieros derivados de negociación y cobertura	(239)	(140)
Divisas y otros	890	1,035
Total	675	1,151

Criterios Contables Especiales aplicables a los programas de apoyo otorgados por Scotiabank en respuesta a la contingencia sanitaria ocasionada por el virus COVID-19

Programas de apoyo

Mediante oficio No. P-285/2020 de fecha 26 de marzo y oficio No. 026/2020 de fecha 15 de abril de 2020, la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (la “Comisión”) determinó emitir con carácter temporal, los Criterios Contables Especiales (“CCE”), aplicables a los programas de apoyo otorgados por Scotiabank. Posteriormente, mediante oficio No. P325/2020 de fecha 23 de junio, la Comisión indicó que:

- Los criterios contables especiales 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.

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.

Lo anterior será aplicable a las instituciones de crédito respecto 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. 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.

Los criterios contables especiales para que las instituciones de crédito no marquen estas modificaciones como reestructuras y/o renovaciones y que sean consideradas como cartera vigente son 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 (“CUB”). 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.
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. 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.
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.
4. En relación a 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.
5. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, las Instituciones podrán diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios (“EPRC”), cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que la EPRC se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

De no haberse aplicado los criterios contables especiales, al 30 septiembre de 2020, el impacto por tipo de cartera de crédito de Banco Individual hubiera sido el siguiente:

Concepto	Saldos apoyo COVID	Efectos (Cartera de Crédito y EPRC)	Saldo sin apoyo COVID
Balance General			
Cartera de crédito vigente			
Créditos comerciales	226,448	(3)	226,445
Créditos consumo	41,904	(800)	41,104
Créditos vivienda	144,258	(1,310)	142,948
Subtotal cartera vigente	412,610	(2,113)	410,497
Cartera de crédito vencida			
Créditos comerciales	5,082	3	5,085
Créditos consumo	1,224	800	2,024
Créditos vivienda	4,779	1,310	6,089
Subtotal cartera vencida	11,085	2,113	13,198
Total Cartera de crédito	423,695	-	423,695
(Menos) Estimación preventiva para riesgos crediticios			
Créditos comerciales	(6,177)	(220)	(6,397)
Créditos consumo	(4,055)	(1,866)	(5,921)
Créditos vivienda	(1,951)	(1,157)	(3,108)
Operaciones contingentes y avales	(241)	-	(241)
Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación	(12,424)	(3,243)	(15,667)
Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional	(3,521)	3,250 ¹	(271)
Total Estimación preventiva para riesgos crediticios	(15,945)	7	(15,938)
Cartera de crédito (neta)	407,750	7	407,757
Estado de Resultados			
Ingresos por intereses de Cartera			
Créditos comerciales	13,093	-	13,093
Créditos consumo	6,556	-	6,556
Créditos vivienda	10,691	-	10,691
Total Ingresos por intereses de Cartera	30,340	-	30,340
Estimación preventiva para riesgos crediticios			
Créditos comerciales	(1,193)	(220)	(1,413)
Créditos consumo	(2,825)	(1,866)	(4,691)
Créditos vivienda	(740)	(1,157)	(1,897)
Operaciones contingentes y avales	12	-	12
Estimación preventiva para riesgos crediticios derivada de la calificación	(4,746)	(3,243)	(7,989)
Estimación preventiva para riesgos crediticios adicional	(3,269)	3,250 ¹	(19)
Total Estimación preventiva para riesgos crediticios	(8,015)	7	(8,008)

¹El Banco ha constituido a la fecha \$3,250 millones de reservas adicionales por efectos de COVID-19, con la finalidad de cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación; las cuales cubren las necesidades en caso de no contar con criterios contables especiales.

Mediante Oficio Núm. 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la CNBV 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, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los Criterios Contables Especiales, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

Emisión de Certificados Bursátiles

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

	Quinta*	Segunda**	Cuarta**	Quinta**	Septima**	Septima**	Primera***	Segunda***
Clave de Pizarra	SCOTIAB 13-2	SCOTIAB 15-2	SCOTIAB 17-2	SCOTIAB 17-3	SCOTIAB 18	SCOTIAB 18 (reapertura)	SCOTIAB 19	SCOTIAB 19D
Monto de la Emisión	\$1,150 millones	\$2,300 millones	\$2,875 millones	\$3,450 millones	\$3,450 millones	\$2,875 millones	\$3,653 millones	\$123 millones dólares
Fecha de Emisión y Colocación	28 junio 2013	26 noviembre 2015	4 abril 2017	18 agosto 2017	16 marzo 2018	22 marzo 2018	27 mayo 2019	28 mayo 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	3,640 días, 20 períodos 182 días, aprox. 10 años	1,820 días, aprox. 5 años	1,820 días, aprox. 5 años	1,456 días, aprox. 4 años	1,459 días aprox. 4 años	1,459 días aprox. 4 años	1,263 días, aprox. 3.5 años	1,260 días, aprox. 3.5 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	7.30% Fijo	TIIE 28 + 0.40%	TIIE 28 + 0.50%	TIIE 28 + 0.36%	TIIE 28 + 0.24%	TIIE 28 + 0.24%	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%
Pago de Intereses	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días	Cada 28 días	Cada 28 días	Cada 28 días para los primeros 51 períodos el último período tendrá una vigencia de 31 días	Cada 28 días para los primeros 51 períodos el último período tendrá una vigencia de 31 días	Cada 28 días	Cada 90 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares

	Primera***	Segunda***	Tercera***
Clave de Pizarra	SCOTIAB 19 (reapertura) ¹	SCOTIAB 19D (reapertura) ¹	SCOTIAB 19-2
Monto de la Emisión	\$2,352 millones	\$112 millones dólares	\$6,000 millones
Fecha de Emisión y Colocación	29 julio 2019	29 julio 2019	6 diciembre 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	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
Tasa de interés	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%	TIIE 28 + 0.15%
Pago de Intereses	Cada 28 días	Cada 90 días	Cada 28 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares	Un sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

**Programa autorizado por la CNBV en septiembre de 2015

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 9-18	1,105,300	17-oct-18	16-oct-20	730	EEM	110,530,000
BONO SCOTIAB 2-19	716,915	11-abr-19	09-abr-21	729	NIKKEI 225	71,691,500
BONO SCOTIAB 4-19	996,600	22-may-19	21-may-21	730	S&P/TSX 60	99,660,000
BONO SCOTIAB 6-19	238,250	04-jun-19	03-jun-21	730	S&P/TSX 60	23,825,000
BONO SCOTIAB 9-19	1,403,500	25-jul-19	22-jul-21	728	TIIIE28	140,350,000
BONO SCOTIAB 10-19	344,200	04-sep-19	04-mar-21	547	IPC	34,420,000
BONO SCOTIAB 12-19	529,100	22-nov-19	22-nov-21	731	MSFDVTHY INDEX	52,910,000
BONO SCOTIAB 13-19	663,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	66,320,000
BONO SCOTIAB 14-19	1,409,300	27-dic-19	21-dic-20	360	USDMXN	140,930,000
BONO SCOTIAB 01-20	949,800	29-ene-20	22-ene-21	359	SPX	94,980,000
BONO SCOTIAB 02-20	870,100	29-ene-20	22-ene-21	359	USDMXN	87,010,000
BONO SCOTIAB 04-20	100,000	13-feb-20	05-feb-21	358	SPX	10,000,000
BONO SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB 06-20	6,585,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	658,591,000
BONO SCOTIAB 07-20	8,040,400	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	804,040,000
BONO SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2020						\$2,629,892,500

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 septiembre de 2020)		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	10,877
2	Resultado de ejercicios anteriores	36,427
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	7,364
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	54,668
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	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos conservador que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16	Inversiones en acciones propias conservador	-
17	Inversiones recíprocas en el capital ordinario conservador	-
18	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%) conservador	-
19	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%) conservador	-
20	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) conservador	-
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)	1,295
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	5,360
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-

D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	5,289
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	71
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	6,655
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	48,013
Capital adicional de nivel 1: instrumentos		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,480
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,480
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	3,480
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)	3,480
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	51,493
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	5,185
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	20
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	5,206
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)	5,206
59	Capital total (TC = T1 + T2)	56,698
60	Activos ponderados por riesgo totales	412,093
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	11.65%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	12.50%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	13.76%
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)	14.75%
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)	4.65%
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)	20
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	2,078
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

	Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)	
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 remedaciones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté representado por títulos representativos o acciones.
5	No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.
6	Suma de los conceptos 1 a 5.
7	No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.
8	Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
9	Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que no permite compensar con los impuestos a la utilidad diferidos a cargo.
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo que corresponden a partidas cubiertas que no están valuadas a valor razonable.
12 conservador	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011, ya que deduce del capital común de nivel 1 las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquellas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales, en el caso de que las Instituciones utilicen métodos basados en calificaciones internas en la determinación de sus requerimientos de capital.
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
14	No aplica.

15	<p>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.</p>
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.
	Ajustes nacionales considerados:
41	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 septiembre de 2020)**

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Disponibilidades	34,914
BG2	Cuentas de Margen	2,764
BG3	Inversiones en valores	132,214
BG4	Deudores por reporto	28,313
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Derivados	23,124
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	684
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	407,750
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	19,337
BG11	Bienes adjudicados (neto)	242
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	1,856
BG13	Inversiones permanentes	3,115
BG14	Activos de larga duración disponibles para la venta	22
BG15	Impuestos y PTU diferidos (neto)	6,226
BG16	Otros activos	5,695
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	407,506
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	65,675
	Valores asignados por liquidar	10,989
BG19	Acreedores por reporto	48,974
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	588
BG22	Derivados	25,393
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	14
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	41,674
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	9,094
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	-
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,681
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	10,877
BG30	Capital ganado	43,791
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	274,944
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	377,740
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	54,891
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	56,216
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,548
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	134,249
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	596
BG41	Otras cuentas de registro	1,412,885

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 septiembre de 2020)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
	ACTIVO			
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	-	
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18		
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19		
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	1,295	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1295
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	20	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$20
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	5,289	BG 16 Activos Intangibles \$2,933 más Gastos de Instalación \$2,356

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	71	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 71
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	3,480	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,480
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	5,185	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$5,185
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
CAPITAL CONTABLE				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	10,877	BG 29 Capital Social \$10,404 más Prima en Venta de Acciones \$473
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	36,427	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$36,427
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	(1,021)	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo (\$1,021)
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	8,385	BG 30 Reservas de Capital \$6,758 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta \$478 más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$788) más Resultado Neto \$1,937
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	-
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 septiembre de 2020)**

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	30,575	2,446
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,813	145
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	438	35
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	13	1
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	3,375	270
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,950	156
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	88	7
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	-	-
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	2	0
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	40	3
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%)	-	67
	839	

Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,433	275
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	-	-
Grupo III (ponderados al 50%)	536	43
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%)	3,610	289
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	331	27
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	90	7
Grupo VI (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 50%)	30,840	2,467
Grupo VI (ponderados al 75%)	19,310	1,545
Grupo VI (ponderados al 100%)	92,875	7,430
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	1,226	98
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	11,014	881
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	758	61
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	9,304	744
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	156,453	12,516
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	604	48
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
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%)	3,618	289
Grupo VIII (ponderados al 150%)	2,153	172
Grupo IX (ponderados al 100%)	13,870	1,110
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	5,524	442

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	17,413	1,393
Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses		
26,478		

Categoría Capitalización

Al 30 de septiembre de 2020, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 10.65%, por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

Scotiabank
Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio		
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	10,876,764,482
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.

15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
Rendimientos / dividendos		
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación anticipada	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.
24	Condiciones de convertibilidad	N.A.
25	Grado de convertibilidad	N.A.
26	Tasa de conversión	N.A.
27	Tipo de convertibilidad del instrumento	N.A.
28	Tipo de instrumento financiero de la convertibilidad	N.A.
Rendimientos / dividendos		
29	Emisor del instrumento	Institución de Crédito, de las acciones representativas del capital social.
30	Cláusula de disminución de valor (<i>Write-Down</i>)	No
31	Condiciones para disminución de valor	N.A.
32	Grado de baja de valor	N.A.
33	Temporalidad de la baja de valor	N.A.
34	Mecanismos de disminución de valor temporal	N.A.
35	Posición de subordinación en caso de liquidación	Los títulos de las acciones están sujetos a las disposiciones que en su caso emite la Secretaría de Hacienda y Crédito Público y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, así como lo que al efecto dispongan los Estatutos Sociales.
36	Características de incumplimiento	No
37	Descripción de características de incumplimiento	No

Scotiabank
Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

-

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

La UAIR de la Institución está representada por la Dirección General Adjunta de Riesgos (DGA Riesgos) y se apoya para la gestión y administración de los distintos tipos de riesgo (i.e. crédito, liquidez, tasas de interés, mercado y operacional, tecnológico, entre otros) principalmente en la Dirección Corporativa de Riesgos, la cual a su vez está organizada en 8 direcciones 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 septiembre de 2020 fue de \$6.09 MM y su promedio durante el tercer trimestre de 2020 fue de \$12.81 MM mismo que corresponde a un 0.023% del capital neto (\$54,785 MM a septiembre 2020, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2020 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	680,396	687,835
Mercado de Dinero	57,819	37,037
Tipo de cambio		
Derivados	127,887	110,181
Capitales		
Cash	14	16
Derivados	13,747	13,754

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre septiembre 2020	(Promedio)
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	6.89	14.17
Tipo de cambio	3.29	3.37
Capitales	0.35	0.01
Total (con efecto de diversificación)	6.09	12.81

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 tercer trimestre de 2020 muestra una pérdida máxima de \$64.38 MM. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en la crisis de 2008 para mercados emergentes. Adicionalmente, como parte de los ejercicios de suficiencia de capital se estiman posibles impactos por factores de mercado en las posiciones de negociación de la institución.

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 tercer trimestre de 2020, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de septiembre 2020 así como el promedio del tercer trimestre de 2020 se muestran a continuación:

Scotiabank	Posición	Posición
<i>(millones de pesos)</i>	<i>(Cierre)²</i>	<i>(Promedio)</i>
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	7,853	21,913
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	93,388	96,326

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, es importante mencionar que, al cierre de septiembre 2020, la brecha acumulada fue positiva, debido a que, en la ventana de 30 días bajo condiciones normales, se tenían contempladas más entradas de efectivo que salidas.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el tercer trimestre de 2020 de 169%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos.

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

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

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

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

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

² Cifras previas al cierre de septiembre 2020.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de septiembre 2020 y en promedio para el tercer trimestre de 2020 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	-1,028	-1,095
Sensibilidad de Margen (+100 pbs)	576	568

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Títulos Disponibles para la venta	59,079	58,641
Derivados de Cobertura	52,473	52,518

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 septiembre 2020 y el promedio del tercer trimestre del 2020 fueron \$2,038 MM y \$1,605 MM, 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 los instrumentos financieros.

Existen distintos niveles de resolución crediticia instituidos en tres niveles: Consejo de Administración, Comités de Crédito 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. Así mismo, el Consejo delega al Comité de Riesgos la facultad de autorización de límites específicos y actualizaciones a las metodologías utilizadas para la administración de riesgo crédito y contraparte.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Criterios contables especiales por programa de apoyo por virus SARS-COV2 (COVID-19)

Con el objetivo de mitigar los efectos negativos económicos derivados de la contingencia por el virus SARS-COV2 (COVID-19), con base al oficio P285/2020 de la CNBV, notificado expresamente a Scotiabank Inverlat mediante oficio número 141-5/2046/2020, el Banco emitió un esquema de apoyo para acreditados cuya fuente de pago fue afectada por esta contingencia. El apoyo consiste en que la cartera crediticia de los clientes afectados por esta pandemia, sea considerada contablemente como vigente dando cumplimiento con los criterios especiales establecidos por la Comisión Bancaria. Con base al oficio P325/2020 de la CNBV emitido el 23 de junio de 2020, notifica la ampliación por un mes adicional al esquema.

Plan de apoyo para créditos de la cartera comercial. El programa de apoyo permite otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses. El Banco determinó las condiciones generales del programa en apoyo a sus clientes, lo ha informado a la CNBV y ha reportado mes a mes los créditos beneficiados con el mismo, dando cumplimiento al plazo establecido de 10 días hábiles posteriores al cierre de mes establecido en el oficio, por lo que, al cierre de septiembre de 2020, el programa continuó vigente y opera con normalidad.

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

Condiciones del diferimiento.

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

Elegibilidad de clientes.

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

Constitución de reservas adicionales por emergencia sanitaria virus SARS-COV2 (COVID-19)

Considerando la emergencia sanitaria por COVID-19 que se está presentando no solo en México sino a nivel mundial y que afecta el entorno económico y financiero, a septiembre 2020, el Banco ha constituido reservas adicionales por \$3,250 MM para cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

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

Por lo tanto, las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa inicial para algún portafolio, por lo que se trata de reservas genéricas que se aplicarán acorde con las necesidades particulares de cada portafolio.

Información metodológica

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

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

Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 30 de septiembre 2020)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.4%	3.2%
Consumo	5.8%	14.3%
Cartera Comercial	1.1%	5.4%
Total	1.3%	5.5%

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

Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre 2020)	EI ²	PI	SP
Hipotecas	144,258	1.74%	18.93%
Consumo	58,228	7.05%	72.37%
Cartera Comercial	266,592	2.6%	43.1%

1/ El calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.

2/ Incorpora exposiciones brutas a riesgo de crédito, i.e., incluye créditos inter compañía.

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de septiembre de 2020.

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 septiembre 2020 y en promedio durante el tercer trimestre de 2020, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.03% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.69% y 0.82% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

Destacar que previo a cualquier operación que implique riesgo de crédito, se tiene un proceso de revisión de los acreditados/contrapartes para evaluar su perfil de riesgo y definir el límite de exposición aceptado con cada uno. Una vez aprobados los límites, son monitoreados por la UAIR y revisados de manera anual por el área de Crédito o con mayor frecuencia en caso de que se detecte algún riesgo potencial o bien la línea de negocio así lo solicite. El requerimiento de capital para operaciones con derivados se calcula bajo metodología regulatoria, tal es el caso del valor ajustado por valuación crediticia o CVA por sus siglas en inglés.

Así mismo, 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 capital

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 julio-septiembre de 2020, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$135.7 MM, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2020 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$129.7 MM, \$28.7 MM corresponden a riesgo operacional y \$101.0 MM a riesgo legal, el 100% de la exposición cuenta 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.

Además de estar sujeto a la metodología general de riesgos operacionales, el Banco cuenta con las políticas de gestión del riesgo tecnológico. Dichas políticas describen los lineamientos y la metodología para la evaluación del riesgo tecnológico. Adicionalmente, la Dirección General Adjunta de Sistemas cuenta con políticas, procedimientos y sistemas que apoyan el cumplimiento con los requerimientos en esta materia.

La metodología de riesgo tecnológico, que evalúa las vulnerabilidades, considera la criticidad de la información en términos de integridad, confidencialidad, disponibilidad y continuidad, para identificar los riesgos inherentes a los aplicativos e infraestructura tecnológica, evaluar los controles existentes y obtener el riesgo residual. Como resultado, la metodología establece una propuesta de controles para mitigar el riesgo tecnológico a un nivel aceptable.

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

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

Anexo 5³. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: julio 2020 - septiembre 2020

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez⁴

(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES		
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	96,326.14
SALIDAS DE EFECTIVO		
2 Financiamiento minorista no garantizado	141,534.77	10,799.53
3 Financiamiento estable	67,079.03	3,353.95
4 Financiamiento menos estable	74,455.73	7,445.57
5 Financiamiento mayorista no garantizado	185,161.95	70,006.30
6 Depósitos operacionales	66,937.48	15,517.43
7 Depósitos no operacionales	111,017.69	47,282.08
8 Deuda no garantizada	7,206.79	7,206.79
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	334.94
10 Requerimientos adicionales:	282,691.82	21,596.09
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	13,167.95	3,382.84
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	269,523.87	18,213.25
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	99.03	99.03
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	-	-
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	102,825.90
ENTRADAS DE EFECTIVO		
17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	27,764.31	688.39
18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	48,502.48	31,136.33
19 Otras entradas de efectivo	13,884.26	13,884.26
20 TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	90,151.05	45,708.97
		Importe ajustado
21 TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	96,326.14
22 TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	57,168.92
23 COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	168.93

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

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

⁴ Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

- Durante septiembre 2020, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁵
 - o Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$35,678 MM y depósitos a plazo tradicionales por \$36,205 MM, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$757 MM y \$2,038 MM respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$19,300 MM.
 - o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$17,181 MM y por operaciones de call money de \$7,263 MM y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,297 MM.
 - o Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de MXN 93,388 MM en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$70,850 MM en títulos de deuda de nivel 1, \$13,469 MM 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 \$5,432 MM y \$3,641 MM en títulos de nivel 2A.

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

Cierre de junio 2020: 161% – cierre de septiembre 2020: 150% (decremento: -11%) El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 11% respecto de junio 2020, esto debido principalmente a:

- o Decremento en fondeo total del banco por \$15,781 MM, lo que restó liquidez a la institución.
- o En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$21,090 MM, sin embargo, se presentan entradas adicionales en 30 días por \$8,500 MM, respecto al trimestre anterior.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron un incremento de \$16,464 MM.

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

Evolución de Activos Líquidos T3-2020			
	Julio	Agosto	Septiembre
Efectivo	6%	5%	6%
Reservas en el Banco Central	22%	19%	14%
Nivel 1	68%	72%	76%
Nivel 2 ^a	4%	4%	4%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

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

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

(e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Julio	Agosto	Septiembre
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	39%	39%	40%
Depósitos a plazo			
Del público en general	30%	32%	32%
Mercado de dinero	8%	6%	6%
Títulos de crédito emitidos	8%	8%	8%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata			
De corto plazo	6%	6%	5%
De largo plazo	9%	9%	9%
Total	100%	100%	100%

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

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

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)	
Exposición Potencial Futura (Septiembre 2020)	
Con contrato de compensación	3,991
Sin contrato de compensación	8,960
Posibles llamadas de margen (Septiembre 2020)	
Colateral en Tránsito	71
Downgrade (Septiembre 2020)	
Baja calificación 3 niveles	2,038

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de septiembre 2020 es la siguiente:

Scotiabank Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	738,215
Tipo de cambio	127,887
Capitales	13,761
Total	879,863

(g) *El descalce en divisas;*

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

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

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

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

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

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

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos	
Concepto	Límite MM
Concentración de Depósitos (MXN)	4,500 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	100 USD

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

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

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

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

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

Para tener un control sobre el descalce generado por la naturaleza del balance entre activos y pasivos, Scotiabank establece límites para sus brechas de liquidez en diferentes plazos. Asimismo, el banco monitorea las brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días; las brechas incorporan posiciones activas y pasivas del balance, así como posiciones fuera del mismo. Los resultados al cierre de septiembre 2020 y el promedio del tercer trimestre de 2020 son:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ⁷	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	7,853	21,913
Liquidity Buffer (métrica CCL)	93,388	96,326

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

II. Información cualitativa

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

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

⁷ Cifras previas al cierre de septiembre 2020.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranas, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la

- Liquidez.
- o Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
 - o Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
 - o Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
 - o Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el tercer trimestre de 2020, 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 tercer trimestre 2020, 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).

Posiciones en Acciones

Al cierre de septiembre de 2020 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$9.44 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.34 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1A-PBR-N	22,500	3.56	3.99	(0.43)
Scotiabank	Pública	1-AC-*	13,513	1.29	1.22	0.07
Scotiabank	Pública	1I-BRZU-*	1,200	1.75	1.77	(0.02)
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	170,000	2.39	2.35	0.04
Scotiabank	Pública	1-KOF-UBL	5,000	0.45	0.45	0.00
Total			212,213	9.44	9.78	(0.34)

Al cierre del tercer trimestre del año 2020, se reflejó una pérdida acumulada proveniente de las ventas por \$4.67 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1AIBM*	3,744	0.28	(0.04)	0.24
Scotiabank	Pública	1APBRN	20,419	0.08	(0.08)	-
Scotiabank	Pública	1GFNORTEO	15,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	19,960	0.24	-	0.24
Scotiabank	Pública	1IEWZ*	8,000	0.05	(0.36)	(0.31)
Scotiabank	Pública	1ATX*	14,500	0.06	(0.05)	0.01
Scotiabank	Pública	1ACHLN	10,001	0.52	-	0.52
Scotiabank	Pública	1AVALEN	38,998	0.22	(0.54)	(0.32)
Scotiabank	Pública	1ISHV*	895	0.05	(0.01)	0.04
Scotiabank	Pública	1IFXE*	4,300	0.29	(0.01)	0.28
Scotiabank	Pública	1IPSQ*	10,600	0.06	(0.06)	-
Scotiabank	Pública	1MFRISCOA-1	55,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	CFFSHOP13	5,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	1,008,802	0.26	(1.58)	(1.32)
Scotiabank	Pública	1VOLARA	5,000	-	-	-

INFORMACIÓN ADICIONAL

Scotiabank	Pública	1LALAB	202,991	0.09	(0.02)	0.07
Scotiabank	Pública	1AWBA*	2,500	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	962,675	-	(1.38)	(1.38)
Scotiabank	Pública	1SITESB-1	221,454	0.16	-	0.16
Scotiabank	Pública	1IIBTAN	50,354	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1IBRZU*	31,568	0.17	(2.78)	(2.61)
Scotiabank	Pública	41BSMXB	575,431	0.30	(1.15)	(0.85)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	35,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	93,825	0.11	(0.38)	(0.27)
Scotiabank	Pública	1IIB01N	67,276	0.06	(0.01)	0.05
Scotiabank	Pública	1ALFAA	1,048,239	0.17	(0.52)	(0.35)
Scotiabank	Pública	1AMXL	420,486	0.02	(0.04)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1CEMEXCPO	1,538,699	0.17	(0.28)	(0.11)
Scotiabank	Pública	1AGGBN	80,361	0.18	(0.01)	0.17
Scotiabank	Pública	1APBRN	44,703	0.43	(0.02)	0.41
Scotiabank	Pública	1AVALEN	5,500	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	60,000	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1CPSOTRAC15	568,910	0.03	(0.01)	0.02
Scotiabank	Pública	1IBRZU*	36,767	0.36	(0.63)	(0.27)
Scotiabank	Pública	1IEWZ*	10,600	0.41	-	0.41
Scotiabank	Pública	1IFLOAN	5,184	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1IIB01N	63,047	0.01	(0.08)	(0.07)
Scotiabank	Pública	1IPSQ*	20,601	0.13	(0.03)	0.10
Scotiabank	Pública	1ISHV*	8,098	0.06	(0.20)	(0.14)
Scotiabank	Pública	1IUISO*	84,722	0.32	(1.50)	(1.18)
Scotiabank	Pública	1AC*	9,500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1ALFAA	159,994	0.05	(0.03)	0.02
Scotiabank	Pública	1AMXL	855,000	0.27	(0.15)	0.12
Scotiabank	Pública	1CEMEXCPO	770,000	0.16	-	0.16
Scotiabank	Pública	1GFINBURO	52,976	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1GFNORTEO	245,000	0.25	(0.09)	0.16
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	27,028	0.10	-	0.10
Scotiabank	Pública	1LIVEPOLC1	67,785	0.16	(0.05)	0.11
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	494,525	0.30	(0.42)	(0.12)
Scotiabank	Pública	1TLEVISACPO	75,216	0.08	-	0.08
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	234,886	0.28	(0.05)	0.23
Scotiabank	Pública	1I-QQQ-*	300	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-ICH-B	10	-	-	-
Scotiabank	Pública	1A-PBR-N	36,389	0.12	(0.20)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	147,741	0.24	(0.10)	0.14
Scotiabank	Pública	1-GFINBUR-O	339,278	0.09	(0.02)	0.07
Scotiabank	Pública	1-SIMEC-B	4	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-PSQ-*	32,446	0.20	(0.37)	(0.17)
Scotiabank	Pública	1B-NAFTRAC-ISHS	511,906	0.39	(0.01)	0.38
Scotiabank	Pública	1-LALA-B	137,518	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1A-WBA-*	4,695	0.03	(0.22)	(0.19)
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	30,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	117,129	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	41BSMXB	881,906	0.46	(0.29)	0.17
Scotiabank	Pública	1I-BRZU-*	1,499	0.07	(0.01)	0.06
Scotiabank	Pública	41-BSMX-B	604,045	0.38	(0.04)	0.34
Scotiabank	Pública	1-R-A	17,485	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1I-FLOA-N	3,005	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-FEMSA-UBD	195,691	0.22	(0.30)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-KOF-UBL	29,703	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-IB1MXX-N	985	-	-	-

Scotiabank	Pública	1-AMX-L	964,691	0.16	(0.21)	(0.05)
Scotiabank	Pública	1-CEMEX-CPO	931,271	0.20	(0.08)	0.12
Total			15,439,317	9.79	(14.46)	(4.67)

La posición accionaria de títulos Disponibles para la Venta 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	-	-	-
Total			9,317	-	-	-

Al 30 de septiembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$7.28 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$5.36 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$0.76 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización					
Por Riesgo General de Mercado	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
	24.09	-	24.09	22.23%	5.36
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	9.44	-	9.44	8.00%	0.76
Índices accionarios	14.65	-	14.65	4.00%	0.58
Requerimiento por riesgos	14.65	-	14.65	4.00%	0.58
			Total Requerimiento de capital		7.28

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	Jun-20	Sep-20
	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)	613,528	614,819
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(6,224)	(6,655)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	607,304	608,164
	Exposiciones a instrumentos financieros derivados		
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	7,637	6,419
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	3,650	3,329
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)	(9,029)	(8,751)
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)	2,258	997
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	16,481	28,313
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(16,481)	(28,313)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	19	1
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)	19	1
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	258,405	274,944
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(209,724)	(198,168)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	48,681	76,776
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	51,552	51,493
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	658,262	685,937
	Coefficiente de apalancamiento		
22	Coefficiente de apalancamiento de Basilea III	7.83%	7.51%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Jun-20	Sep-20
1	Activos totales	656,145	666,256
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	0	(71)
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	(23,877)	(22,128)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(16,462)	(28,312)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	48,681	76,776
7	Otros ajustes	(6,225)	(6,584)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	658,262	685,937

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Jun-20	Sep-20
1	Activos totales	656,145	666,256
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(26,136)	(23,124)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(16,481)	(28,313)
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	613,528	614,819

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

CONCEPTO/PERIODO	Jun-20	Sep-20	Variación
Capital Básico ^{1/}	51,552	51,493	-0.11%
Activos Ajustados ^{2/}	658,262	685,937	4.20%
Razón de Apalancamiento ^{3/}	7.83%	7.83%	-0.32%

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 junio a septiembre 2020.

El indicador se ubicó en 7.51%, 32 pbs inferior respecto al trimestre anterior, debido principalmente al incremento de las exposiciones totales por \$27,675 millones (-31 pbs) y a la disminución del Capital de Nivel 1 por \$59 millones (-1 pbs).

La variación de -31 pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente al incremento en las exposiciones fuera del balance -32 pbs.

El Capital de Nivel 1 mostró una disminución trimestral de 1 pb por pago de intereses de los instrumentos de capital.

TABLA I.2

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

REFERENCIA	EXPLICACIÓN
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	<p>Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) <i>recibidas</i>, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ol style="list-style-type: none"> Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia. El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	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.
5	En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

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

TABLA II.2

NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

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

TABLA III.2

NOTAS A LA CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 13 de noviembre del 2013, se aprobó decretar y pagar dividendos en efectivo, el primero de ellos hasta por la cantidad de \$318'443,208.00 M.N. (Trescientos dieciocho millones cuatrocientos cuarenta y tres mil doscientos ocho pesos 00/100) M.N, a razón de \$0.0513618077419 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 6,200'000,000 (Seis mil 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 septiembre del 2020, 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 \$90,273 millones de pesos.
- Disponibilidades en bancos y reservas con el Banco Central por MXN \$30,897 millones de pesos.

Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD \$250 millones de dólares.
- Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.

- Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución.
- Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

Inversiones relevantes en capital

Al 30 de septiembre de 2020, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión

del 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 tercer trimestre de 2020, 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 apegan a los Criterios Contables B-5 “derivados y operaciones de cobertura” emitido por la CNBV y aplicables a las Instituciones de Crédito, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de operaciones de cobertura.

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

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

Núm.	Tipo de Cobertura	Posición Cubierta	Tipo de posición cubierta	Condición de Mercado	Derivado
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, o títulos referenciados a acciones, que coticen en una bolsa de valores.			✓	✓	✓	✓
Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.	✓		✓	✓		
* Tasas de interés nominal, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas	✓	✓		✓	✓	✓
Operaciones de Opción sobre futuros de índice.			✓			
Moneda nacional, Divisas y UDIS;	✓	✓		✓		✓
Oro y Plata		✓		✓		
Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (<i>Swaps</i>) en especie y por diferenciales.	✓	✓				

*SBI solicita autorización para operar por cuenta propia, productos derivados de tasas de interés cuya característica o variación consiste principalmente en pactar/establecer una fecha futura y/o periodo determinado para fijar la tasa de interés y el inicio del intercambio de pago
(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 septiembre 2020 y en promedio para el tercer trimestre de 2020 es de:

Scotiabank	Posición	Posición
(millones de pesos)	(Cierre)	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	17,019	29,766

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable			
Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés	Opciones	Europea	<p>Caps, Floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets. $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$ <ul style="list-style-type: none"> Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet. $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
		Binaria	<p>La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:</p> <ul style="list-style-type: none"> Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap). Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).
		IRS	El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).
		CCIRS	Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
Tipo de cambio	Opciones	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
		Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
		Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.
		Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.
Forward	Forward OTC	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.	

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

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

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

i. Políticas Líneas de Crédito

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

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

- **Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco**

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

- **Sujetos de Crédito**

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

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

- **Reglas Particulares**

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- **Idoneidad del Cliente**

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

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

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

ii. Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

Con metodología se asume que la 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 TIIIE, 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 TIIIE están autorizados sólo en una base back to back

Futuros de TIIIE

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 TIIIE.

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

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

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

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

a. 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 septiembre de 2020 y promedio del tercer trimestre 2020 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank	Posición	Posición
(millones de pesos)	(Cierre)	(Promedio)
Liquidity Buffer (métrica CCL)	93,388	96,326

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:

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

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

En donde:

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

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	17,019	32,794	32,777	32,733
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		-2,039	-2,042	-2,045

Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a septiembre 30, 2020:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	26,884	45,713	(73,310)	51,647	40,939	(60,182)	31,691
CCS	33	249	862	1,193	298	33	2,669
Caps&Floors	1,525	99	265	(66)	0	0	1,823
Binary Caps&Floors	0	0	0	0	0	0	0
TIIE Futures	0	0	0	0	0	0	0
Mbonds Futures	0	0	0	0	0	0	0
Total DERIVATIVES	28,442	46,061	(72,183)	52,774	41,238	(60,149)	36,182

Cifras en MXN

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de -10.01 Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de -20.02 Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable -48.24 Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable		Stress 1		Stress 2	
				Shock(+/-)	P&L	Shock(+/-)	P&L	Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	0.00	0	50	0.00	100	0.00	200	0.00
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.04	-190	50	-1.81	100	-3.62	200	-7.24
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	-0.04	0.2	10%	0.00	40%	-0.02	100%	-0.04
a FX %	Forwards	3.70	82	10%	-8.19	20%	-16.39	50%	-40.97
a FX %	Opciones Divisa	0.00	0	10%	0.00	20%	0.00	50%	0.00
Total					-10.01		-20.02		-48.24

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 Warrants con sus respectivas sensibilidades al 30 de septiembre de 2020.

	Delta	Vega	Gamma
Options MEXSR5.INDX	4,360,336	52,561	0
Options MEXEEM.USM	17,121	(16)	(26,385)
Options MEXIXM.INDX	0	0	0
Options MEXSPX.INDX	(16,313)	(32)	(2,652)
Options MEXSX5E.INDX	0	0	(0)
Options MEXTSX60.INDX	88,744	453	0
Options MXNNKY.INDX	32,836	162	0
Options MEXMSI.INDX	9,349,186	104,087	0
TOTAL	13,831,911	157,213	(29,037)

Cifras en MXN al 30Sep20

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		
	-10%	-30%	-50%
Options MEXSPXINDX	(436,034)	(1,308,101)	(2,180,168)
Options GE.USM	(1,712)	(5,136)	(8,561)
Options MEXSX5EINDX	0	0	0
Options GOOGUSM	1,631	4,894	8,157
Options Basket IXM SX7	0	0	0
Options IXM SX5E Mex	(8,874)	(26,623)	(44,372)
Options FBUSM	(3,284)	(9,851)	(16,418)
Options MEXIBX.INDX	(934,919)	(2,804,756)	(4,674,593)
TOTAL	(1,383,191)	(4,149,573)	(6,915,955)

Cifras en MXN al 30Sep20

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

	Escenarios a la Alza		
	5%	15%	20%
Options MEXSPXINDX	218,017	654,050	872,067
Options GE.USM	856	2,568	3,424
Options MEXSX5EINDX	0	0	0
Options GOOGUSM	(816)	(2,447)	(3,263)
Options Basket IXM SX	0	0	0
Options IXM SX5E Mex	4,437	13,312	17,749
Options FBUSM	1,642	4,925	6,567
Options MEXIBX.INDX	467,459	1,402,378	1,869,837
TOTAL	691,596	2,074,787	2,766,382

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	(1,383,191)
Poco Probable	(4,149,573)
Muy poco Probable	(6,915,955)

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

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurnID	PaySide Current Notional	PaySide CurnID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurnID	Option Notional
P12142	Cap	07/09/2020	Sell	A	MXN					1,361,888
P12151	Cap	05/08/2020	Sell	A	MXN					846,205
P12634	Cap	07/08/2020	Sell	A	MXN					21,500,000
P13055	Cap	05/07/2020	Sell	A	MXN					358,023
P13109	Cap	20/09/2020	Sell	A	MXN					539,976
P13148	Cap	20/09/2020	Sell	A	MXN					536,792
P13159	Cap	31/07/2020	Buy	A	MXN					111,581,631
P13160	Cap	31/07/2020	Sell	A	MXN					111,581,631
P13162	Cap	20/07/2020	Sell	A	MXN					2,740,137
P13379	Cap	07/08/2020	Buy	A	MXN					21,500,000
P13405	Cap	07/08/2020	Sell	A	MXN					21,500,000
P14343	Cap	28/07/2020	Sell	A	MXN					24,305,556
P14351	Cap	28/07/2020	Buy	A	MXN					24,305,556
P14549	Cap	17/09/2020	Sell	A	MXN					30,000,000
P14550	Cap	17/09/2020	Buy	A	MXN					30,000,000
P15394	Cap	31/07/2020	Sell	A	MXN					23,093,984
P15395	Cap	31/07/2020	Buy	A	MXN					23,093,984
SAK827	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	308,897	MXN	308,897	MXN	
SAK872	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	308,897	MXN	308,897	MXN	
SAV318	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	585,000,000	MXN	585,000,000	MXN	
SAV320	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	980,000,000	MXN	980,000,000	MXN	
SAV521	SC Swap	02/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SAV529	SC Swap	02/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SAV659	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	2,974,000,000	MXN	2,974,000,000	MXN	
SAV844	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SAY034	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SAY051	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN	
SAY437	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SAZ877	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SBA247	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	700,000,000	MXN	700,000,000	MXN	
SBA249	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SBA378	SC Swap	07/09/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SBA616	SC Swap	09/09/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SBB013	SC Swap	15/09/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SBF083	SC Swap	14/07/2020	Buy	A	MXN	1,980,000,000	MXN	1,980,000,000	MXN	
SBF464	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	565,000,000	MXN	565,000,000	MXN	
SBF501	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	1,980,000,000	MXN	1,980,000,000	MXN	
SBF895	SC Swap	22/07/2020	Buy	A	MXN	430,000,000	MXN	430,000,000	MXN	
SBG584	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	570,000,000	MXN	570,000,000	MXN	
SBG983	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	715,000,000	MXN	715,000,000	MXN	
SBH123	SC Swap	04/08/2020	Buy	A	MXN	720,000,000	MXN	720,000,000	MXN	
SBH408	SC Swap	06/08/2020	Buy	A	MXN	575,000,000	MXN	575,000,000	MXN	
SBH712	SC Swap	11/08/2020	Buy	A	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN	
SBH720	SC Swap	11/08/2020	Buy	A	MXN	575,000,000	MXN	575,000,000	MXN	
SBJ506	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	280,000,000	MXN	280,000,000	MXN	
SBJ669	SC Swap	28/08/2020	Buy	A	MXN	280,000,000	MXN	280,000,000	MXN	
SBK055	SC Swap	08/09/2020	Buy	A	MXN	415,000,000	MXN	415,000,000	MXN	
SBK766	SC Swap	02/07/2020	Buy	A	MXN	7,836,653	MXN	7,836,653	MXN	
SBK818	SC Swap	02/07/2020	Buy	A	MXN	7,836,653	MXN	7,836,653	MXN	
SBL125	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	13,338,983	MXN	13,338,983	MXN	
SBL188	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	13,338,983	MXN	13,338,983	MXN	
SBL549	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBL582	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBL676	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBL693	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBL817	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	410,000,000	MXN	410,000,000	MXN	
SBL952	SC Swap	21/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBM143	SC Swap	21/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SBM234	SC Swap	23/07/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBM238	SC Swap	23/07/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBM253	SC Swap	14/07/2020	Buy	A	MXN	620,000,000	MXN	620,000,000	MXN	
SBM375	SC Swap	24/07/2020	Buy	A	MXN	18,400,000	MXN	18,400,000	MXN	
SBM404	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	415,000,000	MXN	415,000,000	MXN	
SBM406	SC Swap	24/07/2020	Buy	A	MXN	18,400,000	MXN	18,400,000	MXN	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SBN774	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	410,000,000	MXN	410,000,000	MXN	
SBO121	SC Swap	11/08/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBO123	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBO142	SC Swap	11/08/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBO143	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SBO514	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	11,000,000	MXN	11,000,000	MXN	
SBO620	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	11,000,000	MXN	11,000,000	MXN	
SBO943	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	USD	900,000	USD	900,000	USD	
SBQ906	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	USD	900,000	USD	900,000	USD	
SBQ907	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	USD	900,000	USD	900,000	USD	
SBV797	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SBV844	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SBW675	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	532,000,000	MXN	532,000,000	MXN	
SBX215	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	9,493,364	MXN	9,493,364	MXN	
SBX437	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	9,493,364	MXN	9,493,364	MXN	
SBZ545	SC Swap	08/07/2020	Buy	A	MXN	505,000,000	MXN	505,000,000	MXN	
SBZ694	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	1,756,705	USD	1,756,705	USD	
SBZ708	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	1,756,705	USD	1,756,705	USD	
SCC377	SC Swap	21/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SCC392	SC Swap	21/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SCC540	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	7,627,119	MXN	7,627,119	MXN	
SCC739	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	7,627,119	MXN	7,627,119	MXN	
SCC842	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	500,000	USD	500,000	USD	
SCC844	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	500,000	USD	500,000	USD	
SCC946	SC Swap	22/07/2020	Buy	A	MXN	1,055,000,000	MXN	1,055,000,000	MXN	
SCD026	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	USD	11,067,822	USD	11,067,822	USD	
SCD109	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	275,000	USD	275,000	USD	
SCD125	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	USD	11,067,822	USD	11,067,822	USD	
SCD311	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	275,000	USD	275,000	USD	
SCD486	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	280,846	USD	280,846	USD	
SCD519	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	USD	280,846	USD	280,846	USD	
SCD617	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	7,627,119	MXN	7,627,119	MXN	
SCD697	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	7,627,119	MXN	7,627,119	MXN	
SCE413	SC Swap	04/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SCE817	SC Swap	06/08/2020	Buy	A	MXN	1,050,000,000	MXN	1,050,000,000	MXN	
SCF786	SC Swap	19/08/2020	Buy	A	MXN	2,885,000,000	MXN	2,885,000,000	MXN	
SCG230	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SCG233	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN	
SCG274	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SCG277	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	839,908	USD	839,908	USD	
SCG282	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	2,900,000,000	MXN	2,900,000,000	MXN	
SCG283	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SCG289	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	839,908	USD	839,908	USD	
SCG377	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	25,407,050	MXN	25,407,050	MXN	
SCG386	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	25,407,050	MXN	25,407,050	MXN	
SCI116	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	3,850,000,000	MXN	3,850,000,000	MXN	
SCI366	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	160,000,000	MXN	160,000,000	MXN	
SCI379	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	160,000,000	MXN	160,000,000	MXN	
SCI451	SC Swap	15/09/2020	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SCI740	SC Swap	17/09/2020	Buy	A	MXN	422,000,000	MXN	422,000,000	MXN	
SCI847	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SCL721	SC Swap	15/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SCL723	SC Swap	15/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SU4906	SC Swap	08/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU4926	SC Swap	08/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU4966	SC Swap	08/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU4998	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU5007	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU5010	SC Swap	03/07/2020	Buy	A	MXN	7,652,180	MXN	7,652,180	MXN	
SU5025	SC Swap	10/09/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU5055	SC Swap	11/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5057	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SU5064	SC Swap	11/09/2020	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN	
SU5074	SC Swap	11/09/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU5128	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU5135	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU5139	SC Swap	11/09/2020	Buy	A	MXN	360,000,000	MXN	360,000,000	MXN	
SU5184	SC Swap	11/09/2020	Buy	A	MXN	360,000,000	MXN	360,000,000	MXN	
SU5224	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	92,000,000	MXN	92,000,000	MXN	
SU5295	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU5304	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5340	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5396	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5399	SC Swap	04/08/2020	Buy	A	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SU5406	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5466	SC Swap	14/09/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU5503	SC Swap	15/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU5703	SC Swap	17/09/2020	Buy	A	MXN	35,000,000	MXN	35,000,000	MXN	
SU5767	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	780,000,000	MXN	780,000,000	MXN	
SU5777	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	380,000,000	MXN	380,000,000	MXN	
SU5834	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5843	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5851	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU5853	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5871	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	2,474,000	USD	2,474,000	USD	
SU5872	SC Swap	02/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5878	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5900	SC Swap	06/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5901	SC Swap	21/09/2020	Buy	A	MXN	375,000,000	MXN	375,000,000	MXN	
SU5918	SC Swap	21/09/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SU5926	SC Swap	06/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5935	SC Swap	06/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU5936	SC Swap	21/09/2020	Buy	A	MXN	295,000,000	MXN	295,000,000	MXN	
SU5944	SC Swap	06/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5963	SC Swap	21/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU5972	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU5991	SC Swap	22/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU5997	SC Swap	08/07/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6017	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6036	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6055	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6065	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SU6076	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6081	SC Swap	07/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU6112	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6117	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6134	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6150	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU6161	SC Swap	15/07/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU6205	SC Swap	23/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6256	SC Swap	16/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6285	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6295	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6305	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6313	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6321	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6330	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SU6341	SC Swap	20/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6359	SC Swap	20/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6406	SC Swap	21/07/2020	Buy	A	MXN	175,000,000	MXN	175,000,000	MXN	
SU6420	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6433	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6468	SC Swap	22/07/2020	Buy	A	MXN	460,000,000	MXN	460,000,000	MXN	
SU6482	SC Swap	16/09/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SU6546	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN	
SU6578	SC Swap	09/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6601	SC Swap	28/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU6632	SC Swap	28/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6653	SC Swap	23/07/2020	Buy	A	MXN	120,000,000	MXN	120,000,000	MXN	
SU6676	SC Swap	28/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6692	SC Swap	23/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6709	SC Swap	29/09/2020	Buy	A	MXN	370,000,000	MXN	370,000,000	MXN	
SU6715	SC Swap	24/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6730	SC Swap	29/09/2020	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN	
SU6750	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6758	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SU6786	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6799	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6813	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN	
SU6822	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SU6831	SC Swap	28/07/2020	Buy	A	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SU6890	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6896	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6905	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU6906	SC Swap	28/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6926	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6935	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU6945	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	9,800,000	MXN	9,800,000	MXN	
SU6954	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU6973	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6977	SC Swap	22/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU6998	SC Swap	06/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7014	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	270,000,000	MXN	270,000,000	MXN	
SU7025	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU7040	SC Swap	24/07/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU7056	SC Swap	30/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7084	SC Swap	30/07/2020	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN	
SU7105	SC Swap	27/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7115	SC Swap	27/07/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7125	SC Swap	30/07/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU7147	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU7156	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7165	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7279	SC Swap	10/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7297	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	1,418,000	USD	1,418,000	USD	
SU7317	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7328	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SU7332	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SU7344	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7356	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	70,000,000	MXN	70,000,000	MXN	
SU7373	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU7412	SC Swap	04/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU7507	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7516	SC Swap	06/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU7526	SC Swap	06/08/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU7558	SC Swap	29/07/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7602	SC Swap	11/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU7641	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU7651	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7658	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU7702	SC Swap	12/08/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU7739	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SU7748	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7757	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SU7768	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN	
SU7778	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	230,000,000	MXN	230,000,000	MXN	
SU7815	SC Swap	13/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU7939	SC Swap	17/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU7949	SC Swap	31/07/2020	Buy	A	MXN	170,000,000	MXN	170,000,000	MXN	
SU8006	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU8059	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU8087	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	17,200,000	MXN	17,200,000	MXN	
SU8088	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	360,000,000	MXN	360,000,000	MXN	
SU8105	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU8172	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU8196	SC Swap	17/08/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU8236	SC Swap	07/07/2020	Buy	A	MXN	80,000,000	MXN	80,000,000	MXN	
SU8250	SC Swap	18/08/2020	Buy	A	MXN	180,000,000	MXN	180,000,000	MXN	
SU8341	SC Swap	19/08/2020	Buy	A	MXN	170,000,000	MXN	170,000,000	MXN	
SU8358	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	170,000,000	MXN	170,000,000	MXN	
SU8369	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SU8389	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN	
SU8404	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN	
SU8454	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU8468	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN	
SU8475	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN	
SU8488	SC Swap	20/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU8603	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN	
SU8651	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN	
SU8687	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SU8694	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN		MXN
SU8702	SC Swap	01/07/2020	Buy	A	MXN	400,000,000	MXN	400,000,000	MXN		MXN
SU8776	SC Swap	19/08/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN		MXN
SU8820	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		MXN
SU8845	SC Swap	26/08/2020	Buy	A	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN		MXN
SU8869	SC Swap	26/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		MXN
SU8894	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	285,000,000	MXN	285,000,000	MXN		MXN
SU8902	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN		MXN
SU8910	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	190,000,000	MXN	190,000,000	MXN		MXN
SU8941	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		MXN
SU8950	SC Swap	27/08/2020	Buy	A	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		MXN
SU8960	SC Swap	07/08/2020	Buy	A	MXN	420,000,000	MXN	420,000,000	MXN		MXN
SU8967	SC Swap	07/08/2020	Buy	A	MXN	345,000,000	MXN	345,000,000	MXN		MXN
SU9012	SC Swap	02/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SU9035	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN		MXN
SU9049	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN		MXN
SU9064	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN		MXN
SU9076	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		MXN
SU9093	SC Swap	03/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN		MXN
SU9117	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SU9123	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SU9159	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	220,000,000	MXN	220,000,000	MXN		MXN
SU9191	SC Swap	07/09/2020	Buy	A	MXN	200,000,000	MXN	200,000,000	MXN		MXN
SU9203	SC Swap	07/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SU9219	SC Swap	07/09/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SU9295	SC Swap	16/09/2020	Buy	A	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN		MXN
SU9568	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	1,418,000	USD	1,418,000	USD		USD
SU9579	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	17,200,000	MXN	17,200,000	MXN		MXN
SU9593	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN		MXN
SU9612	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN		MXN
SU9630	SC Swap	03/07/2020	Buy	A	MXN	7,652,180	MXN	7,652,180	MXN		MXN
SU9640	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	92,000,000	MXN	92,000,000	MXN		MXN
SU9669	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	USD	2,474,000	USD	2,474,000	USD		USD
SU9682	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	9,800,000	MXN	9,800,000	MXN		MXN
SU9948	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN		MXN
SU9952	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN		MXN
SV0208	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN		MXN
SV0212	SC Swap	10/07/2020	Buy	A	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN		MXN
SV1083	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	2,200,000	USD	2,200,000	USD		USD
SV1095	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	2,200,000	USD	2,200,000	USD		USD
SV1909	SC Swap	26/07/2020	Buy	A	MXN	7,080,414	MXN	7,080,414	MXN		MXN
SV1928	SC Swap	26/07/2020	Buy	A	MXN	7,080,414	MXN	7,080,414	MXN		MXN
SV2388	SC Swap	28/07/2020	Buy	A	MXN	4,771,423	MXN	4,771,423	MXN		MXN
SV2403	SC Swap	28/07/2020	Buy	A	MXN	4,771,423	MXN	4,771,423	MXN		MXN
SV2536	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	500,000	USD	500,000	USD		USD
SV2549	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	500,000	USD	500,000	USD		USD
SV2757	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	90,000	USD	90,000	USD		USD
SV2768	SC Swap	17/07/2020	Buy	A	USD	90,000	USD	90,000	USD		USD
SV3937	SC Swap	28/08/2020	Buy	A	MXN	57,000,000	MXN	57,000,000	MXN		MXN
SV3938	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	129,126,000	MXN	129,126,000	MXN		MXN
SV3939	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	54,773,706	MXN	54,773,706	MXN		MXN
SV3997	SC Swap	28/08/2020	Buy	A	MXN	57,000,000	MXN	57,000,000	MXN		MXN
SV3998	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	129,126,000	MXN	129,126,000	MXN		MXN
SV3999	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	54,773,706	MXN	54,773,706	MXN		MXN
SV4057	SC Swap	28/08/2020	Buy	A	MXN	57,000,000	MXN	57,000,000	MXN		MXN
SV4058	SC Swap	04/09/2020	Buy	A	MXN	129,126,000	MXN	129,126,000	MXN		MXN
SV4059	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	54,773,706	MXN	54,773,706	MXN		MXN
SV4445	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		MXN
SV4495	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	750,000,000	MXN	750,000,000	MXN		MXN
SV7166	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	6,495,000	MXN	6,495,000	MXN		MXN
SV7215	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	7,000,000	MXN	7,000,000	MXN		MXN
SV7304	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	6,495,000	MXN	6,495,000	MXN		MXN
SV7305	SC Swap	25/09/2020	Buy	A	MXN	7,000,000	MXN	7,000,000	MXN		MXN
SV7928	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	757,420	MXN	757,420	MXN		MXN
SV7978	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	755,000,000	MXN	755,000,000	MXN		MXN
SV8011	SC Swap	31/08/2020	Buy	A	MXN	757,420	MXN	757,420	MXN		MXN
SW0654	SC Swap	24/08/2020	Buy	A	MXN	191,333,333	MXN	191,333,333	MXN		MXN
SX3906	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	1,536,880	MXN	1,536,880	MXN		MXN
SX3910	SC Swap	30/09/2020	Buy	A	MXN	1,536,880	MXN	1,536,880	MXN		MXN
SX6231	SC Swap	21/08/2020	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		MXN
SX6541	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	11,653,700	MXN	11,653,700	MXN		MXN
SX6558	SC Swap	18/09/2020	Buy	A	MXN	11,653,700	MXN	11,653,700	MXN		MXN
SZ5352	SC Swap	03/08/2020	Buy	A	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SZ6269	SC Swap	10/08/2020	Buy	A	MXN	34,334,938	MXN	34,334,938	MXN		MXN
SZ6291	SC Swap	10/08/2020	Buy	A	MXN	34,334,938	MXN	34,334,938	MXN		MXN

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2052875	FX	176,632	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2052876	FX	176,632	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2052881	FX	176,632	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2052882	FX	176,632	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053296	FX	25,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053298	FX	25,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053308	FX	25,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053310	FX	25,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053508	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053510	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053511	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053513	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053514	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053516	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053517	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053519	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053520	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053522	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053523	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053525	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053526	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053528	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053583	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053585	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053586	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053588	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053589	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053591	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053592	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053594	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053595	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053597	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053598	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053600	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053601	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2053603	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054071	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054072	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054073	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054074	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054075	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054076	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054248	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054250	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054251	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054253	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054254	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054256	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054257	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054259	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054260	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054262	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054263	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054265	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054266	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054268	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054269	FX	50,000	02/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054271	FX	50,000	02/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054272	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054274	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054275	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054277	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054278	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054280	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054320	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054322	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054323	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054325	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054326	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054328	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054329	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054331	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054332	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2054334	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2055376	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055378	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055379	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055381	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055382	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055384	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055409	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055411	FX	50,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055412	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055414	FX	50,000	15/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055415	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055417	FX	50,000	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055418	FX	50,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055420	FX	50,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055421	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055423	FX	50,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055424	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055426	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055427	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055429	FX	50,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055430	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055432	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055433	FX	50,000	02/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055435	FX	50,000	02/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055436	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055438	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055439	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055441	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055442	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2055444	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2056417	FX	400,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2056419	FX	400,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2056427	FX	400,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2056429	FX	400,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057263	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057264	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057265	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057266	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057267	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2057268	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058949	FX	500,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058951	FX	500,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058952	FX	22,081	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058953	FX	500,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058955	FX	500,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058956	FX	22,081	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058957	FX	500,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058959	FX	500,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058960	FX	22,081	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058997	FX	500,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2058999	FX	500,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059000	FX	22,081	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059001	FX	500,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059003	FX	500,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059004	FX	22,081	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059005	FX	500,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059007	FX	500,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059008	FX	22,081	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059056	FX	41,735	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059058	FX	38,309	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059060	FX	35,309	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059080	FX	41,735	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059082	FX	38,309	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059084	FX	35,309	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059234	FX	523,589	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059236	FX	523,589	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059246	FX	523,589	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059248	FX	523,589	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059470	FX	50,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059472	FX	50,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059473	FX	658	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059474	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059476	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059477	FX	658	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2059478	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059480	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059481	FX	658	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059482	FX	50,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059484	FX	50,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059485	FX	658	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059486	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059488	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059489	FX	658	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059490	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059492	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059493	FX	658	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059494	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059496	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059497	FX	658	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059582	FX	50,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059584	FX	50,000	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059585	FX	658	01/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059586	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059588	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059589	FX	658	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059590	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059592	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059593	FX	658	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059594	FX	50,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059596	FX	50,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059597	FX	658	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059598	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059600	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059601	FX	658	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059602	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059604	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059605	FX	658	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059606	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059608	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059609	FX	658	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059798	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059800	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059801	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059803	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059822	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059824	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059825	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059827	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059848	FX	25,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059850	FX	25,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059852	FX	25,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059854	FX	25,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059868	FX	25,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059870	FX	25,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059872	FX	25,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059874	FX	25,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059901	FX	100,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059903	FX	100,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059917	FX	100,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2059920	FX	100,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060170	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060172	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060173	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060175	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060176	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060178	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060179	FX	50,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060181	FX	50,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060194	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060196	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060197	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060199	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060200	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060202	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060203	FX	50,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060205	FX	50,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060254	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060256	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2060257	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060259	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060260	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060262	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060281	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060283	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060284	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060286	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060287	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060289	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060383	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060385	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060386	FX	13,788	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060387	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060389	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060390	FX	13,788	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060391	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060393	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060394	FX	13,788	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060455	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060457	FX	300,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060458	FX	13,788	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060459	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060461	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060462	FX	13,788	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060463	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060465	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060466	FX	13,788	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060500	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060502	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060503	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060505	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060506	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060508	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060509	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060511	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060512	FX	50,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060514	FX	50,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060524	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060526	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060527	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060529	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060530	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060532	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060533	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060535	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060536	FX	50,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060538	FX	50,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060559	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060561	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060562	FX	42,051	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060563	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060565	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060566	FX	42,051	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060567	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060569	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060570	FX	42,051	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060607	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060609	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060610	FX	42,051	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060611	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060613	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060614	FX	42,051	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060615	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060617	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060618	FX	42,051	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060683	FX	907,287	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060685	FX	907,287	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060686	FX	715,438	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060688	FX	715,438	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060701	FX	907,287	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060703	FX	907,287	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2060704	FX	715,438	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2060706	FX	715,438	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061067	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061069	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061073	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061075	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061268	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061270	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061271	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061273	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061274	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2061276	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062584	FX	100,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062588	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062592	FX	100,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062596	FX	100,000	27/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062600	FX	100,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062604	FX	100,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062608	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062612	FX	100,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062616	FX	100,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062620	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062624	FX	100,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062628	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062632	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062667	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062668	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062742	FX	100,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062746	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062750	FX	100,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062754	FX	100,000	27/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062758	FX	100,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062762	FX	100,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062766	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062770	FX	100,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062774	FX	100,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062778	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062782	FX	100,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062786	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062790	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2062876	FX	100,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063358	FX	100,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063362	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063366	FX	100,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063370	FX	100,000	27/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063374	FX	100,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063378	FX	100,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063382	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063386	FX	100,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063390	FX	100,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063394	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063397	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2063402	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063406	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063442	FX	100,000	27/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063446	FX	100,000	03/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063450	FX	100,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063454	FX	100,000	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063458	FX	100,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063462	FX	100,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063466	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063469	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2063474	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063478	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063578	FX	100,000	06/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063582	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063586	FX	100,000	20/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063646	FX	125,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063890	FX	100,000	03/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063892	FX	100,000	10/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063894	FX	100,000	17/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063896	FX	100,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063898	FX	100,000	31/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063900	FX	100,000	07/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2063902	FX	100,000	14/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063904	FX	100,000	21/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2063906	FX	100,000	28/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064550	FX	100,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064552	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064558	FX	200,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064559	FX	200,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064560	FX	200,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064561	FX	200,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064562	FX	200,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064563	FX	200,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064564	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064566	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064567	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064569	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064570	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064572	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064580	FX	200,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064589	FX	200,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064652	FX	300,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064661	FX	300,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064678	FX	25,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064681	FX	25,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064684	FX	25,000	16/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064687	FX	25,000	23/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064690	FX	25,000	30/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064693	FX	25,000	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064696	FX	25,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064699	FX	25,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064714	FX	25,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064717	FX	25,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064720	FX	25,000	16/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064723	FX	25,000	23/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064726	FX	25,000	30/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064729	FX	25,000	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064732	FX	25,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064735	FX	25,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064768	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064771	FX	684,107	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064810	FX	50,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064813	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064816	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064819	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064837	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064840	FX	684,107	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064855	FX	50,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064858	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064861	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064864	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064885	FX	100,000	03/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064887	FX	100,000	10/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064889	FX	100,000	17/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064891	FX	100,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064893	FX	100,000	31/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064895	FX	100,000	07/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064897	FX	100,000	14/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064899	FX	100,000	21/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064901	FX	100,000	28/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2064908	FX	300,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064911	FX	300,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064917	FX	300,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064920	FX	300,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064935	FX	560,904	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064938	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064941	FX	560,904	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064944	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064955	FX	50,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064958	FX	50,000	16/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064961	FX	50,000	30/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064973	FX	50,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064976	FX	50,000	16/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064979	FX	50,000	30/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064982	FX	50,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2064993	FX	50,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2064997	FX	50,000	23/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065017	FX	50,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065021	FX	50,000	23/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065025	FX	50,000	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065029	FX	50,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065039	FX	820,928	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065048	FX	820,928	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065051	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065055	FX	50,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065071	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065075	FX	50,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065091	FX	70,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065094	FX	70,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065097	FX	70,000	03/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065112	FX	70,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065115	FX	70,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065118	FX	70,000	03/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065193	FX	250,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065196	FX	250,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065202	FX	250,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065205	FX	250,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065208	FX	250,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065232	FX	250,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065235	FX	250,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065241	FX	250,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065244	FX	250,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065247	FX	250,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065345	FX	50,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065349	FX	50,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065354	FX	50,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065358	FX	50,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065362	FX	50,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065365	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065393	FX	50,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065397	FX	50,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065402	FX	50,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065406	FX	50,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065410	FX	50,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065413	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065482	FX	200,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065485	FX	200,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065491	FX	200,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065494	FX	200,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065539	FX	200,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065544	FX	200,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065547	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065551	FX	200,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065556	FX	200,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065559	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065585	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065588	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065594	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065597	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065603	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065607	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065615	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065619	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065641	FX	50,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065644	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065647	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065656	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065677	FX	50,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065680	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065683	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065692	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065721	FX	555,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065726	FX	555,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065730	FX	555,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065733	FX	555,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065772	FX	500,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065777	FX	500,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065781	FX	500,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065784	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065820	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2065825	FX	50,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065829	FX	50,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065832	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065868	FX	5,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065873	FX	5,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065877	FX	5,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2065880	FX	5,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065922	FX	30,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065923	FX	30,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065924	FX	30,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065925	FX	30,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065926	FX	30,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065927	FX	30,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065928	FX	30,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065929	FX	30,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065930	FX	30,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065931	FX	30,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065932	FX	30,000	10/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065933	FX	30,000	17/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065934	FX	30,000	24/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065939	FX	30,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065940	FX	30,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065941	FX	30,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065942	FX	30,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065943	FX	30,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065944	FX	30,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065945	FX	30,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065946	FX	30,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065947	FX	30,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065948	FX	30,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065949	FX	30,000	10/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065950	FX	30,000	17/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065951	FX	30,000	24/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065996	FX	100,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2065998	FX	125,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066007	FX	100,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066009	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066022	FX	19,230	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066026	FX	23,091	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066030	FX	12,627	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066038	FX	19,230	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066042	FX	23,091	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066046	FX	12,627	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066054	FX	12,060	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066062	FX	12,060	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066144	FX	400,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066147	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066152	FX	400,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066155	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066211	FX	500,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066213	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066220	FX	500,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066222	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066237	FX	153,441	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066243	FX	153,441	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066248	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066251	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066253	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066303	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066306	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066308	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066318	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066322	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066338	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066342	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066390	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066400	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066452	FX	150,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066454	FX	150,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066455	FX	150,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066458	FX	150,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066461	FX	150,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066483	FX	250,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066490	FX	150,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2066492	FX	150,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066493	FX	150,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066496	FX	150,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066499	FX	150,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066517	FX	200,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066520	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066522	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066532	FX	200,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066535	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066537	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066589	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066599	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066607	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066611	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066627	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066631	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066660	FX	250,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066691	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066704	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066709	FX	50,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066711	FX	50,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066730	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066743	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066748	FX	50,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066750	FX	50,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2066779	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066780	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066781	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066782	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066783	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066784	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066785	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066786	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066787	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066788	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066789	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066790	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066791	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066792	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066793	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066794	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066795	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066796	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066797	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066798	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066799	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066800	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066801	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066802	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066803	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066804	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066805	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066806	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066824	FX	50,000	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066832	FX	50,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066834	FX	50,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066835	FX	100,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066844	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066853	FX	150,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066877	FX	408,002	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066886	FX	408,002	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066895	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066897	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066915	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066917	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066995	FX	40,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2066998	FX	40,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067025	FX	40,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067028	FX	40,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067166	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067182	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067222	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2067230	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067239	FX	200,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067243	FX	200,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067246	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067291	FX	200,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067295	FX	200,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067298	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067441	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067461	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067582	FX	20,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067584	FX	20,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067614	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067634	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067654	FX	20,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067656	FX	20,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067686	FX	20,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067689	FX	20,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067691	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067694	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067734	FX	20,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067737	FX	20,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067739	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067742	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2067944	FX	250,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2067949	FX	250,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068011	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068038	FX	250,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068043	FX	250,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068085	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068105	FX	4,626,330	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068108	FX	4,622,379	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068110	FX	4,606,837	02/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068112	FX	4,594,195	03/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068114	FX	9,167,784	07/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068116	FX	4,573,968	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068118	FX	4,560,957	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068120	FX	4,556,490	10/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068122	FX	4,540,967	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068124	FX	4,445,567	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068126	FX	4,522,508	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068128	FX	4,511,228	17/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068130	FX	4,505,263	18/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068132	FX	4,490,853	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068134	FX	4,485,389	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068135	FX	4,473,768	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068137	FX	4,460,937	24/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068139	FX	4,452,510	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068141	FX	4,443,419	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068143	FX	4,436,505	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068237	FX	500,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068249	FX	500,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068448	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068450	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068451	FX	8,989	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068476	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068478	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068479	FX	8,989	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068504	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068506	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068531	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068533	FX	200,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2068598	FX	60,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068599	FX	60,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068608	FX	60,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2068609	FX	60,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXERCISED
2069264	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2069266	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2069267	FX	15,837	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2069280	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2069282	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED
2069283	FX	15,837	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2053297	FX	25,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053299	FX	25,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053309	FX	25,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053311	FX	25,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053509	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053512	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053515	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053518	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053521	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053524	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053527	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053584	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053587	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053590	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053593	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053596	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053599	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2053602	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054249	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054252	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054255	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054258	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054261	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054264	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054267	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054270	FX	50,000	02/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054273	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054276	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054279	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054321	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054324	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054327	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054330	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054333	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054336	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054339	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054342	FX	50,000	02/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054345	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054348	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054351	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054991	FX	50,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054994	FX	50,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2054997	FX	50,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055000	FX	50,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055003	FX	50,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055006	FX	50,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055009	FX	50,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055012	FX	50,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055015	FX	50,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055018	FX	50,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055021	FX	50,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055051	FX	50,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055054	FX	50,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055057	FX	50,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055060	FX	50,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055063	FX	50,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055066	FX	50,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055069	FX	50,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055072	FX	50,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055075	FX	50,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055078	FX	50,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055081	FX	50,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055350	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055353	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055356	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055359	FX	50,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055362	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055365	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055368	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055371	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055374	FX	50,000	02/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055377	FX	50,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055380	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055383	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2055410	FX	50,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055413	FX	50,000	15/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055416	FX	50,000	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055419	FX	50,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055422	FX	50,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055425	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055428	FX	50,000	19/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055431	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055434	FX	50,000	02/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055437	FX	50,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055440	FX	50,000	15/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2055443	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2056418	FX	400,000	01/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2056420	FX	400,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2056428	FX	400,000	01/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2056430	FX	400,000	05/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2058950	FX	500,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2058954	FX	500,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2058958	FX	500,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2058998	FX	500,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059002	FX	500,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059006	FX	500,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059057	FX	41,735	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059059	FX	38,309	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059061	FX	35,309	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059081	FX	41,735	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059083	FX	38,309	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059085	FX	35,309	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059235	FX	523,589	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059247	FX	523,589	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059471	FX	50,000	01/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059475	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059479	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059483	FX	50,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059487	FX	50,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059491	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059495	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059583	FX	50,000	01/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059587	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059591	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059595	FX	50,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059599	FX	50,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059603	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059607	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059799	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059802	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059823	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059826	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059849	FX	25,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059851	FX	25,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059853	FX	25,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059855	FX	25,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059869	FX	25,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059871	FX	25,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059873	FX	25,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059875	FX	25,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059900	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059902	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059916	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059918	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059919	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2059921	FX	100,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060171	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060174	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060177	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060180	FX	50,000	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060195	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060198	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060201	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060204	FX	50,000	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060255	FX	300,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060258	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060261	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060282	FX	300,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2060285	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060288	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060384	FX	300,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060388	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060392	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060456	FX	300,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060460	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060464	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060501	FX	50,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060504	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060507	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060510	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060513	FX	50,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060525	FX	50,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060528	FX	50,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060531	FX	50,000	21/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060534	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060537	FX	50,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060560	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060564	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060568	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060608	FX	1,000,000	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060612	FX	1,000,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060616	FX	1,000,000	11/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060684	FX	907,287	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060687	FX	715,438	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060702	FX	907,287	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2060705	FX	715,438	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2061068	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2061074	FX	2,500,000	02/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2061269	FX	200,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2061272	FX	200,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2061275	FX	200,000	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062583	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062585	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062586	FX	5,185	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062587	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062589	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062590	FX	5,185	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062591	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062593	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062594	FX	5,185	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062595	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062597	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062598	FX	5,185	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062599	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062601	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062602	FX	5,185	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062603	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062605	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062606	FX	5,185	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062607	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062609	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062610	FX	5,185	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062611	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062613	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062614	FX	5,185	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062615	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062617	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062618	FX	5,185	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062619	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062621	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062622	FX	5,185	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062623	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062625	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062626	FX	5,185	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062627	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062629	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062630	FX	5,185	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062631	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062633	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062634	FX	5,185	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062741	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062743	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2062744	FX	5,185	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062745	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062747	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062748	FX	5,185	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062749	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062751	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062752	FX	5,185	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062753	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062755	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062756	FX	5,185	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062757	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062759	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062760	FX	5,185	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062761	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062763	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062764	FX	5,185	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062765	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062767	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062768	FX	5,185	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062769	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062771	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062772	FX	5,185	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062773	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062775	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062776	FX	5,185	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062777	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062779	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062780	FX	5,185	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062781	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062783	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062784	FX	5,185	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062785	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062787	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062788	FX	5,185	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062789	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062791	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062792	FX	5,185	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2062875	FX	100,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063357	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063359	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063360	FX	7,286	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063361	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063363	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063364	FX	7,286	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063365	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063367	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063368	FX	7,286	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063369	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063371	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063372	FX	7,286	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063373	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063375	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063376	FX	7,286	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063377	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063379	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063380	FX	7,286	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063381	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063383	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063384	FX	7,286	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063385	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063387	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063388	FX	7,286	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063389	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063391	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063392	FX	7,286	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063393	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063395	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063396	FX	7,286	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063398	FX	100,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2063399	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063400	FX	7,286	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063401	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063403	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063404	FX	7,286	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2063405	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063407	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063408	FX	7,286	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063441	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063443	FX	100,000	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063444	FX	7,286	27/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063445	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063447	FX	100,000	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063448	FX	7,286	03/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063449	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063451	FX	100,000	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063452	FX	7,286	10/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063453	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063455	FX	100,000	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063456	FX	7,286	17/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063457	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063459	FX	100,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063460	FX	7,286	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063461	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063463	FX	100,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063464	FX	7,286	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063465	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063467	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063468	FX	7,286	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063470	FX	100,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2063471	FX	100,000	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063472	FX	7,286	14/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063473	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063475	FX	100,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063476	FX	7,286	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063477	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063479	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063480	FX	7,286	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063577	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063579	FX	100,000	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063580	FX	7,286	06/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063581	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063583	FX	100,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063584	FX	7,286	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063585	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063587	FX	100,000	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063588	FX	7,286	20/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063645	FX	125,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063647	FX	125,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063648	FX	125,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2063889	FX	100,000	03/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063891	FX	100,000	10/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063893	FX	100,000	17/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063895	FX	100,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063897	FX	100,000	31/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063899	FX	100,000	07/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063901	FX	100,000	14/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063903	FX	100,000	21/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063905	FX	100,000	28/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063907	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063908	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2063932	FX	100,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063933	FX	100,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2063934	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2063935	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064038	FX	200,000	10/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064039	FX	200,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064040	FX	200,000	10/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064041	FX	200,000	10/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064492	FX	200,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064493	FX	200,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064551	FX	100,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064553	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064565	FX	200,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064568	FX	200,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064571	FX	200,000	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064579	FX	200,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064581	FX	200,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064588	FX	200,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2064590	FX	200,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064651	FX	300,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064653	FX	300,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064660	FX	300,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064662	FX	300,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064663	FX	330,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064664	FX	330,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064677	FX	25,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064679	FX	25,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064680	FX	25,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064682	FX	25,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064683	FX	25,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064685	FX	25,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064686	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064688	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064689	FX	25,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064691	FX	25,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064692	FX	25,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064694	FX	25,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064695	FX	25,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064697	FX	25,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064698	FX	25,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064700	FX	25,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064713	FX	25,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064715	FX	25,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064716	FX	25,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064718	FX	25,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064719	FX	25,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064721	FX	25,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064722	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064724	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064725	FX	25,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064727	FX	25,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064728	FX	25,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064730	FX	25,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064731	FX	25,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064733	FX	25,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064734	FX	25,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064736	FX	25,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064767	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064769	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064770	FX	684,107	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064772	FX	684,107	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064809	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064811	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064812	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064814	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064815	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064817	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064818	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064820	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064836	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064838	FX	1,402,261	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064839	FX	684,107	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064841	FX	684,107	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064854	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064856	FX	50,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064857	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064859	FX	50,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064860	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064862	FX	50,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064863	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064865	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064884	FX	100,000	03/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064886	FX	100,000	10/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064888	FX	100,000	17/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064890	FX	100,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064892	FX	100,000	31/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064894	FX	100,000	07/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064896	FX	100,000	14/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064898	FX	100,000	21/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064900	FX	100,000	28/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064902	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2064903	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2064907	FX	300,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064909	FX	300,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064910	FX	300,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064912	FX	300,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064916	FX	300,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064918	FX	300,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064919	FX	300,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064921	FX	300,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064934	FX	560,904	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064936	FX	560,904	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064937	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064939	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064940	FX	560,904	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064942	FX	560,904	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064943	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064945	FX	1,231,392	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064946	FX	105,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064947	FX	105,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064954	FX	50,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064956	FX	50,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064957	FX	50,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064959	FX	50,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064960	FX	50,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064962	FX	50,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064972	FX	50,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064974	FX	50,000	02/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064975	FX	50,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064977	FX	50,000	16/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064978	FX	50,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064980	FX	50,000	30/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064981	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064983	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064992	FX	50,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064994	FX	50,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064995	FX	3,093	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064996	FX	50,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064998	FX	50,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2064999	FX	3,093	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065016	FX	50,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065018	FX	50,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065019	FX	3,093	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065020	FX	50,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065022	FX	50,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065023	FX	3,093	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065024	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065026	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065027	FX	3,093	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065028	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065030	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065031	FX	3,093	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065035	FX	841,356	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065036	FX	841,356	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065037	FX	841,356	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065038	FX	820,928	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065040	FX	820,928	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065044	FX	841,356	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065045	FX	841,356	08/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065046	FX	841,356	08/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065047	FX	820,928	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065049	FX	820,928	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065050	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065052	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065053	FX	3,646	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065054	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065056	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065057	FX	3,646	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065070	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065072	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065073	FX	3,646	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065074	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065076	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065077	FX	3,646	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065090	FX	70,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065092	FX	70,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2065093	FX	70,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065095	FX	70,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065096	FX	70,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065098	FX	70,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065111	FX	70,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065113	FX	70,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065114	FX	70,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065116	FX	70,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065117	FX	70,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065119	FX	70,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065186	FX	250,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065187	FX	250,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065188	FX	250,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065189	FX	250,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065190	FX	250,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065191	FX	250,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065192	FX	250,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065194	FX	250,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065195	FX	250,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065197	FX	250,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065198	FX	250,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065199	FX	250,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065200	FX	250,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065201	FX	250,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065203	FX	250,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065204	FX	250,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065206	FX	250,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065207	FX	250,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065209	FX	250,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065225	FX	250,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065226	FX	250,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065227	FX	250,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065228	FX	250,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065229	FX	250,000	14/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065230	FX	250,000	14/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065231	FX	250,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065233	FX	250,000	21/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065234	FX	250,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065236	FX	250,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065237	FX	250,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065238	FX	250,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065239	FX	250,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065240	FX	250,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065242	FX	250,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065243	FX	250,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065245	FX	250,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065246	FX	250,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065248	FX	250,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065346	FX	50,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065347	FX	50,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065348	FX	5,306	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065350	FX	50,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065351	FX	50,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065352	FX	5,306	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065353	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065355	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065356	FX	5,306	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065357	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065359	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065360	FX	5,306	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065361	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065363	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065364	FX	5,306	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065366	FX	50,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065367	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065368	FX	5,306	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065394	FX	50,000	24/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065395	FX	50,000	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065396	FX	5,306	24/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065398	FX	50,000	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065399	FX	50,000	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065400	FX	5,306	31/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065401	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065403	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2065404	FX	5,306	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065405	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065407	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065408	FX	5,306	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065409	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065411	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065412	FX	5,306	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065414	FX	50,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065415	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065416	FX	5,306	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065481	FX	200,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065483	FX	200,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065484	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065486	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065490	FX	200,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065492	FX	200,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065493	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065495	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065540	FX	200,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065541	FX	200,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065542	FX	14,043	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065543	FX	200,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065545	FX	200,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065546	FX	14,043	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065548	FX	200,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065549	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065550	FX	14,043	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065552	FX	200,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065553	FX	200,000	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065554	FX	14,043	04/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065555	FX	200,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065557	FX	200,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065558	FX	14,043	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065560	FX	200,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065561	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065562	FX	14,043	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065566	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065567	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065568	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065569	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065570	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065571	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065575	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065576	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065577	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065578	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065579	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065580	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065584	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065586	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065587	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065589	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065593	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065595	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065596	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065598	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065604	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065605	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065606	FX	17,374	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065608	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065609	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065610	FX	17,374	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065616	FX	333,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065617	FX	333,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065618	FX	17,374	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065620	FX	333,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065621	FX	333,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065622	FX	17,374	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065623	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065624	FX	703,712	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065625	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065626	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065627	FX	703,712	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065628	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2065635	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065636	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065637	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065638	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065639	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065640	FX	1,055,567	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065642	FX	50,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065643	FX	50,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065645	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065646	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065648	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065649	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065650	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065651	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065652	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065653	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065654	FX	50,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065655	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065657	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065658	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065678	FX	50,000	13/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065679	FX	50,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065681	FX	50,000	28/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065682	FX	50,000	28/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065684	FX	50,000	12/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065685	FX	50,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065686	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065687	FX	50,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065688	FX	50,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065689	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065690	FX	50,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065691	FX	50,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065693	FX	50,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065694	FX	50,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065722	FX	555,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065723	FX	555,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065724	FX	66,600	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065725	FX	555,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065727	FX	555,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065728	FX	66,600	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065729	FX	555,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065731	FX	555,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065732	FX	66,600	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065734	FX	555,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065735	FX	555,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065736	FX	66,600	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065773	FX	500,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065774	FX	500,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065775	FX	60,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065776	FX	500,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065778	FX	500,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065779	FX	60,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065780	FX	500,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065782	FX	500,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065783	FX	60,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065785	FX	500,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065786	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065787	FX	60,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065821	FX	50,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065822	FX	50,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065823	FX	6,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065824	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065826	FX	50,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065827	FX	6,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065828	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065830	FX	50,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065831	FX	6,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065833	FX	50,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065834	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065835	FX	6,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065869	FX	5,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065870	FX	5,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065871	FX	600	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065872	FX	5,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2065874	FX	5,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065875	FX	600	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065876	FX	5,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065878	FX	5,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065879	FX	600	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065881	FX	5,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065882	FX	5,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065883	FX	600	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065916	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065917	FX	703,712	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065918	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065919	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065920	FX	703,712	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065921	FX	703,712	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065965	FX	81,458	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065967	FX	81,458	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065972	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065973	FX	500,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065974	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065978	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065979	FX	500,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065980	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065984	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065985	FX	500,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065986	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065990	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065991	FX	500,000	07/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2065992	FX	500,000	07/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065995	FX	100,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065997	FX	125,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2065999	FX	125,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066000	FX	125,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066008	FX	100,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066010	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066015	FX	100,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066016	FX	100,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066017	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066018	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066021	FX	19,230	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066023	FX	19,230	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066024	FX	1,334	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066025	FX	23,091	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066027	FX	23,091	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066028	FX	1,602	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066029	FX	12,627	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066031	FX	12,627	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066032	FX	876	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066037	FX	19,230	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066039	FX	19,230	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066040	FX	1,334	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066041	FX	23,091	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066043	FX	23,091	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066044	FX	1,602	17/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066045	FX	12,627	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066047	FX	12,627	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066048	FX	876	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066053	FX	12,060	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066055	FX	12,060	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066056	FX	886	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066061	FX	12,060	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066063	FX	12,060	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066064	FX	886	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066069	FX	15,000	17/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066070	FX	15,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066071	FX	15,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066072	FX	15,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066073	FX	15,000	17/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066081	FX	15,000	17/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066082	FX	15,000	05/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066083	FX	15,000	19/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066084	FX	15,000	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066085	FX	15,000	17/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066093	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066094	FX	25,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2066095	FX	25,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066096	FX	25,000	23/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066097	FX	25,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066098	FX	25,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066143	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066145	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066146	FX	29,167	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066148	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066149	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066150	FX	29,167	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066151	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066153	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066154	FX	29,167	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066156	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066157	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066158	FX	29,167	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066204	FX	200,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066205	FX	200,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066206	FX	200,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066207	FX	200,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066208	FX	200,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066209	FX	200,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066210	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066212	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066214	FX	500,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066215	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066219	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066221	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066223	FX	500,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066224	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066228	FX	300,000	14/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066229	FX	300,000	14/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066230	FX	300,000	14/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066231	FX	300,000	14/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066232	FX	300,000	28/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066233	FX	300,000	28/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066234	FX	300,000	28/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066235	FX	300,000	28/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066236	FX	153,441	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066238	FX	153,441	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066242	FX	153,441	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066244	FX	153,441	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066249	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066250	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066252	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066304	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066305	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066307	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066319	FX	500,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066320	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066321	FX	26,872	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066323	FX	500,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066324	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066325	FX	26,872	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066339	FX	500,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066340	FX	500,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066341	FX	26,872	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066343	FX	500,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066344	FX	500,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066345	FX	26,872	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066388	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066389	FX	400,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066398	FX	400,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066399	FX	400,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066408	FX	300,000	28/08/2020	EUR	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066409	FX	300,000	28/08/2020	EUR	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066410	FX	300,000	28/08/2020	EUR	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066411	FX	300,000	28/08/2020	EUR	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066412	FX	300,000	07/08/2020	EUR	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066413	FX	300,000	07/08/2020	EUR	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066414	FX	300,000	07/08/2020	EUR	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066415	FX	300,000	07/08/2020	EUR	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066453	FX	150,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066456	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2066457	FX	150,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066459	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066460	FX	150,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066462	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066463	FX	150,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066464	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066465	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066466	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066467	FX	150,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066468	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066469	FX	150,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066480	FX	250,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066481	FX	250,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066482	FX	250,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066491	FX	150,000	04/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066494	FX	150,000	11/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066495	FX	150,000	11/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066497	FX	150,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066498	FX	150,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066500	FX	150,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066501	FX	150,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066502	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066503	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066504	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066505	FX	150,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066506	FX	150,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066507	FX	150,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066518	FX	200,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066519	FX	200,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066521	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066533	FX	200,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066534	FX	200,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066536	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066587	FX	250,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066588	FX	250,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066597	FX	250,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066598	FX	250,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066608	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066609	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066610	FX	25,895	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066612	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066613	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066614	FX	25,895	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066628	FX	300,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066629	FX	300,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066630	FX	25,895	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066632	FX	300,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066633	FX	300,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066634	FX	25,895	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066657	FX	250,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066658	FX	250,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066659	FX	250,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066692	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066693	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066694	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066695	FX	50,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066696	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066697	FX	50,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066698	FX	50,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066699	FX	50,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066700	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066701	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066702	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066703	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066705	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066706	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066707	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066708	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066710	FX	50,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066731	FX	50,000	18/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066732	FX	50,000	18/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066733	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066734	FX	50,000	25/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066735	FX	50,000	25/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2066736	FX	50,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066737	FX	50,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066738	FX	50,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066739	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066740	FX	50,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066741	FX	50,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066742	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066744	FX	50,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066745	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066746	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066747	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066749	FX	50,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066823	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066825	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066826	FX	3,093	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066827	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066829	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066830	FX	3,093	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066831	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066833	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066840	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066841	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066842	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066843	FX	150,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066845	FX	150,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066846	FX	150,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066847	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066848	FX	150,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066849	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066850	FX	150,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066851	FX	150,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066852	FX	150,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066854	FX	150,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066855	FX	150,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066856	FX	150,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2066857	FX	150,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066876	FX	408,002	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066878	FX	408,002	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066885	FX	408,002	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066887	FX	408,002	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066894	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066896	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066914	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066916	FX	100,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066994	FX	40,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066996	FX	40,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066997	FX	40,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2066999	FX	40,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067024	FX	40,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067026	FX	40,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067027	FX	40,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067029	FX	40,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067094	FX	60,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067096	FX	60,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067114	FX	60,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067116	FX	60,000	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067167	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067168	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067169	FX	14,130	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067183	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067184	FX	250,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067185	FX	14,130	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067223	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067224	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067225	FX	24,295	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067231	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067232	FX	400,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067233	FX	24,295	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067238	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067240	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067241	FX	11,304	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067242	FX	200,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067244	FX	200,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067245	FX	11,304	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2067247	FX	200,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067248	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067249	FX	11,304	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067290	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067292	FX	200,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067293	FX	11,304	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067294	FX	200,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067296	FX	200,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067297	FX	11,304	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067299	FX	200,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067300	FX	200,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067301	FX	11,304	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067442	FX	50,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067443	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067444	FX	2,826	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067462	FX	50,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067463	FX	50,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067464	FX	2,826	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067581	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067583	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067585	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067586	FX	20,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067587	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067588	FX	20,000	30/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067613	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067615	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067616	FX	2,729	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067633	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067635	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067636	FX	2,729	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067653	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067655	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067657	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067658	FX	20,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067659	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067660	FX	20,000	30/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067685	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067687	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067688	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067690	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067692	FX	20,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067693	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067695	FX	20,000	30/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067696	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067733	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067735	FX	20,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067736	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067738	FX	20,000	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067740	FX	20,000	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067741	FX	20,000	23/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067743	FX	20,000	30/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067744	FX	20,000	30/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067937	FX	250,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067940	FX	250,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067941	FX	250,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067942	FX	250,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067943	FX	250,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067945	FX	250,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067946	FX	250,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067947	FX	250,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067948	FX	250,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2067950	FX	250,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2067951	FX	250,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068012	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068013	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068014	FX	2,882	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068031	FX	250,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068032	FX	250,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068033	FX	250,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068034	FX	250,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068035	FX	250,000	08/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068036	FX	250,000	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068037	FX	250,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068039	FX	250,000	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2068040	FX	250,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068041	FX	250,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068042	FX	250,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068044	FX	250,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068045	FX	250,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068086	FX	50,000	22/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068087	FX	50,000	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068088	FX	2,882	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068106	FX	4,626,330	31/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068107	FX	4,622,379	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068109	FX	4,606,837	02/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068111	FX	4,594,195	03/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068113	FX	9,167,784	07/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068115	FX	4,573,968	08/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068117	FX	4,560,957	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068119	FX	4,556,490	10/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068121	FX	4,540,967	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068123	FX	4,445,567	14/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068125	FX	4,522,508	15/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068127	FX	4,511,228	17/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068129	FX	4,505,263	18/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068131	FX	4,490,853	21/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068133	FX	4,485,389	22/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068136	FX	4,473,768	23/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068138	FX	4,460,937	24/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068140	FX	4,452,510	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068142	FX	4,443,419	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068144	FX	4,436,505	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068199	FX	250,000	01/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068200	FX	250,000	01/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068238	FX	500,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068239	FX	500,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068250	FX	500,000	29/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068251	FX	500,000	29/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	EXPIRED
2068449	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068477	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068505	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2068532	FX	200,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069128	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069129	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069130	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069131	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069265	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED
2069281	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052003283	FWD	CHFMXN	14/08/2020	80,000	24.45	(1,956,209)
2020052003257	FWD	CHFMXN	14/08/2020	(80,000)	24.47	1,957,200
2020062303155	FWD	EURMXN	29/07/2020	154,000	25.48	(3,923,811)
2020080403284	FWD	EURMXN	13/08/2020	154,000	26.90	(4,142,660)
2020080403369	FWD	EURMXN	13/08/2020	976	26.88	(26,235)
2020080403320	FWD	EURMXN	14/09/2020	98,621	27.09	(2,671,252)
2020081803283	FWD	EURMXN	29/09/2020	96,983	26.62	(2,581,840)
2020031803303	FWD	USDMXN	01/07/2020	(400,000)	24.17	9,667,952
2020032703185	FWD	USDMXN	01/07/2020	400,000	23.80	(9,518,481)
2020032703333	FWD	USDMXN	01/07/2020	(300,000)	23.72	7,117,091
2020051803075	FWD	USDMXN	01/07/2020	1,000,000	23.62	(23,620,118)
2020051803073	FWD	USDMXN	01/07/2020	(1,000,000)	23.68	23,681,200
2020052003395	FWD	USDMXN	01/07/2020	100,000	23.35	(2,334,983)
2020052003397	FWD	USDMXN	01/07/2020	(100,000)	23.38	2,338,060
2020052103579	FWD	USDMXN	01/07/2020	220,000	23.03	(5,066,487)
2020052103540	FWD	USDMXN	01/07/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103564	FWD	USDMXN	01/07/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503319	FWD	USDMXN	01/07/2020	300,000	22.66	(6,798,930)
2020052603416	FWD	USDMXN	01/07/2020	200,000	22.36	(4,471,209)
2020052603409	FWD	USDMXN	01/07/2020	(200,000)	22.37	4,473,820
2020060103151	FWD	USDMXN	01/07/2020	745,000	22.09	(16,455,464)
2020060503195	FWD	USDMXN	01/07/2020	42,000	21.82	(916,355)
2020060503066	FWD	USDMXN	01/07/2020	(42,000)	21.87	918,670
2020060903378	FWD	USDMXN	01/07/2020	100,000	21.91	(2,191,190)
2020060903379	FWD	USDMXN	01/07/2020	100,000	21.91	(2,191,190)
2020060903415	FWD	USDMXN	01/07/2020	(200,000)	21.93	4,385,500
2020062403160	FWD	USDMXN	01/07/2020	200,000	22.71	(4,541,400)
2020062403153	FWD	USDMXN	01/07/2020	(200,000)	22.72	4,544,107
2020030503405	FWD	USDMXN	02/07/2020	100,000	20.19	(2,019,030)
2020030503327	FWD	USDMXN	02/07/2020	(100,000)	20.30	2,030,298
2020052003135	FWD	USDMXN	02/07/2020	100,000	23.54	(2,354,315)
2020052003130	FWD	USDMXN	02/07/2020	(100,000)	23.59	2,358,670
2020060203033	FWD	USDMXN	02/07/2020	1,000,000	21.93	(21,931,218)
2020060203045	FWD	USDMXN	02/07/2020	372,500	22.05	(8,211,818)
2020060203013	FWD	USDMXN	02/07/2020	(1,000,000)	21.94	21,941,000
2020060303064	FWD	USDMXN	02/07/2020	100,000	21.71	(2,170,587)
2020060303071	FWD	USDMXN	02/07/2020	(100,000)	21.73	2,173,060
2020061803406	FWD	USDMXN	02/07/2020	67,000	22.67	(1,519,037)
2020061803399	FWD	USDMXN	02/07/2020	(67,000)	22.74	1,523,370
2020062403188	FWD	USDMXN	02/07/2020	500,000	22.71	(11,354,000)
2020062403199	FWD	USDMXN	02/07/2020	(500,000)	22.74	11,371,851
2020062503007	FWD	USDMXN	02/07/2020	116,000	22.86	(2,651,412)
2020062503001	FWD	USDMXN	02/07/2020	(116,000)	22.89	2,655,751
2019121303272	FWD	USDMXN	03/07/2020	1,000,000	19.60	(19,597,424)
2019121303245	FWD	USDMXN	03/07/2020	(1,000,000)	19.66	19,658,400
2020012903239	FWD	USDMXN	03/07/2020	50,000	19.12	(956,097)
2020012903260	FWD	USDMXN	03/07/2020	(50,000)	19.14	957,025
2020020503233	FWD	USDMXN	03/07/2020	50,000	19.01	(950,458)
2020020503189	FWD	USDMXN	03/07/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020050703236	FWD	USDMXN	03/07/2020	74,760	24.18	(1,807,746)
2020050703207	FWD	USDMXN	03/07/2020	(74,760)	24.19	1,808,362
2020051803031	FWD	USDMXN	03/07/2020	100,000	23.72	(2,372,087)
2020051803039	FWD	USDMXN	03/07/2020	(100,000)	23.82	2,381,500
2020052203201	FWD	USDMXN	03/07/2020	250,000	22.93	(5,732,347)
2020052203145	FWD	USDMXN	03/07/2020	(250,000)	23.03	5,758,600
2020060203036	FWD	USDMXN	03/07/2020	2,000,000	21.93	(43,857,896)
2020060203111	FWD	USDMXN	03/07/2020	3,000,000	21.80	(65,387,619)
2020060203006	FWD	USDMXN	03/07/2020	(2,000,000)	22.00	44,000,000
2020060203085	FWD	USDMXN	03/07/2020	(3,000,000)	21.85	65,550,000
2020061803407	FWD	USDMXN	03/07/2020	140,000	22.68	(3,174,500)
2020061803414	FWD	USDMXN	03/07/2020	84,000	22.68	(1,904,700)
2020061803400	FWD	USDMXN	03/07/2020	(224,000)	22.74	5,093,679
2020062403401	FWD	USDMXN	03/07/2020	15,529	22.72	(352,823)
2020062403304	FWD	USDMXN	03/07/2020	(15,529)	22.73	353,054
2020062603176	FWD	USDMXN	03/07/2020	250,000	22.94	(5,735,000)
2020062603172	FWD	USDMXN	03/07/2020	(250,000)	22.97	5,742,347
2019102103098	FWD	USDMXN	06/07/2020	1,500,000	19.90	(29,847,173)
2020030603315	FWD	USDMXN	06/07/2020	(1,500,000)	20.60	30,892,970
2020031803184	FWD	USDMXN	06/07/2020	(170,457)	24.08	4,104,625
2020052003276	FWD	USDMXN	06/07/2020	250,000	23.57	(5,891,879)
2020052003277	FWD	USDMXN	06/07/2020	250,000	23.65	(5,912,037)
2020052003245	FWD	USDMXN	06/07/2020	(250,000)	23.70	5,925,275
2020052003246	FWD	USDMXN	06/07/2020	(250,000)	23.63	5,907,775
2020052103285	FWD	USDMXN	06/07/2020	25,000	23.05	(576,252)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052103185	FWD	USDMXN	06/07/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052903226	FWD	USDMXN	06/07/2020	25,000	22.29	(557,278)
2020052903164	FWD	USDMXN	06/07/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020061803439	FWD	USDMXN	06/07/2020	50,000	22.83	(1,141,425)
2020061803435	FWD	USDMXN	06/07/2020	(50,000)	22.84	1,142,077
2020062403374	FWD	USDMXN	06/07/2020	148,000	22.73	(3,363,330)
2020062403378	FWD	USDMXN	06/07/2020	138,000	22.73	(3,136,078)
2020062403379	FWD	USDMXN	06/07/2020	137,000	22.73	(3,113,352)
2020062403384	FWD	USDMXN	06/07/2020	147,000	22.73	(3,340,604)
2020062403381	FWD	USDMXN	06/07/2020	(570,000)	22.78	12,986,419
2020070203155	FWD	USDMXN	06/07/2020	(100,000)	22.52	2,252,090
2020070203157	FWD	USDMXN	06/07/2020	(100,000)	22.52	2,252,428
2020070203161	FWD	USDMXN	06/07/2020	(100,000)	22.52	2,251,963
2020070203165	FWD	USDMXN	06/07/2020	(100,000)	22.52	2,252,478
2020070203549	FWD	USDMXN	06/07/2020	(7,500,000)	22.48	168,593,325
2019101503207	FWD	USDMXN	07/07/2020	1,041,413	20.04	(20,867,540)
2019101503199	FWD	USDMXN	07/07/2020	(1,041,413)	20.05	20,876,998
2019101603102	FWD	USDMXN	07/07/2020	1,041,413	20.01	(20,837,795)
2019101603255	FWD	USDMXN	07/07/2020	2,082,826	19.97	(41,595,825)
2019101603099	FWD	USDMXN	07/07/2020	(1,041,413)	20.02	20,847,214
2019101603240	FWD	USDMXN	07/07/2020	(1,041,413)	19.99	20,818,887
2019101603242	FWD	USDMXN	07/07/2020	(1,041,413)	19.97	20,792,852
2019121103568	FWD	USDMXN	07/07/2020	534,224	19.70	(10,525,924)
2019121103601	FWD	USDMXN	07/07/2020	534,224	19.68	(10,515,441)
2019121103554	FWD	USDMXN	07/07/2020	(534,224)	19.71	10,529,288
2019121103596	FWD	USDMXN	07/07/2020	(534,224)	19.69	10,519,191
2019121303311	FWD	USDMXN	07/07/2020	534,224	19.55	(10,444,619)
2019121303206	FWD	USDMXN	07/07/2020	(534,224)	19.66	10,501,241
2020032703447	FWD	USDMXN	07/07/2020	57,103	23.61	(1,348,337)
2020032703457	FWD	USDMXN	07/07/2020	(57,103)	23.71	1,353,912
2020050603377	FWD	USDMXN	07/07/2020	100,000,000	24.05	(2,405,200,000)
2020050603438	FWD	USDMXN	07/07/2020	50,000,000	24.03	(1,201,700,000)
2020050603382	FWD	USDMXN	07/07/2020	(100,000,000)	24.05	2,405,200,000
2020050603442	FWD	USDMXN	07/07/2020	(50,000,000)	24.03	1,201,700,000
2020052003174	FWD	USDMXN	07/07/2020	87,553	23.43	(2,051,249)
2020052003163	FWD	USDMXN	07/07/2020	(87,554)	23.45	2,052,983
2020052103328	FWD	USDMXN	07/07/2020	10,000	23.09	(230,936)
2020052103306	FWD	USDMXN	07/07/2020	(10,000)	23.20	231,998
2020060103208	FWD	USDMXN	07/07/2020	227,500	22.14	(5,037,580)
2020060103185	FWD	USDMXN	07/07/2020	(227,500)	22.14	5,035,940
2020060403361	FWD	USDMXN	07/07/2020	15,750	22.00	(346,562)
2020060403342	FWD	USDMXN	07/07/2020	(15,750)	22.06	347,445
2020060803212	FWD	USDMXN	07/07/2020	3,400,000	21.72	(73,854,015)
2020060803078	FWD	USDMXN	07/07/2020	(3,400,000)	21.73	73,893,220
2020062403389	FWD	USDMXN	07/07/2020	98,000	22.73	(2,227,364)
2020062403383	FWD	USDMXN	07/07/2020	(98,000)	22.78	2,232,024
2020070603228	FWD	USDMXN	07/07/2020	3,400,000	22.29	(75,786,000)
2020070603235	FWD	USDMXN	07/07/2020	(3,400,000)	22.29	75,771,638
2019081903032	FWD	USDMXN	08/07/2020	(350,000)	20.79	7,276,311
2020032403313	FWD	USDMXN	08/07/2020	250,000	25.39	(6,347,188)
2020032403387	FWD	USDMXN	08/07/2020	(500,000)	25.32	12,659,749
2020032703186	FWD	USDMXN	08/07/2020	250,000	23.82	(5,955,070)
2020032703334	FWD	USDMXN	08/07/2020	(300,000)	23.75	7,124,218
2020041603094	FWD	USDMXN	08/07/2020	51,947,204	24.51	(1,273,200,000)
2020041603098	FWD	USDMXN	08/07/2020	(51,863,620)	24.55	1,273,200,000
2020041603099	FWD	USDMXN	08/07/2020	(83,584)	24.47	2,045,542
2020052003399	FWD	USDMXN	08/07/2020	100,000	23.37	(2,337,331)
2020052003401	FWD	USDMXN	08/07/2020	(100,000)	23.40	2,340,410
2020052103580	FWD	USDMXN	08/07/2020	220,000	23.05	(5,071,498)
2020052103543	FWD	USDMXN	08/07/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103565	FWD	USDMXN	08/07/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503331	FWD	USDMXN	08/07/2020	300,000	22.69	(6,805,910)
2020060803190	FWD	USDMXN	08/07/2020	372,553	21.68	(8,076,430)
2020060803205	FWD	USDMXN	08/07/2020	(53)	21.68	1,149
2020060903380	FWD	USDMXN	08/07/2020	100,000	21.93	(2,193,224)
2020060903381	FWD	USDMXN	08/07/2020	100,000	21.93	(2,193,224)
2020060903416	FWD	USDMXN	08/07/2020	(200,000)	21.95	4,389,520
2020070603170	FWD	USDMXN	08/07/2020	(5,200,000)	22.27	115,804,000
2020070603332	FWD	USDMXN	08/07/2020	(2,200,000)	22.35	49,168,900
2020022703184	FWD	USDMXN	09/07/2020	(343,000)	19.80	6,791,861
2020030503407	FWD	USDMXN	09/07/2020	100,000	20.21	(2,021,210)
2020030503049	FWD	USDMXN	09/07/2020	(343,000)	20.16	6,915,372
2020030503326	FWD	USDMXN	09/07/2020	(100,000)	20.32	2,032,443
2020060203102	FWD	USDMXN	09/07/2020	1,000,000	21.87	(21,870,197)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020060203087	FWD	USDMXN	09/07/2020	(1,000,000)	21.92	21,923,900
2020060903062	FWD	USDMXN	09/07/2020	372,500	21.85	(8,138,641)
2020062403190	FWD	USDMXN	09/07/2020	500,000	22.71	(11,354,000)
2020062403198	FWD	USDMXN	09/07/2020	(500,000)	22.76	11,382,340
2020063003255	FWD	USDMXN	09/07/2020	350,000	23.05	(8,067,500)
2020063003350	FWD	USDMXN	09/07/2020	125,000	23.00	(2,874,961)
2020063003235	FWD	USDMXN	09/07/2020	(350,000)	23.06	8,071,037
2020063003340	FWD	USDMXN	09/07/2020	(125,000)	23.02	2,877,950
2020070203171	FWD	USDMXN	09/07/2020	500,000	22.51	(11,257,096)
2020070203090	FWD	USDMXN	09/07/2020	(500,000)	22.60	11,298,500
2020070703280	FWD	USDMXN	09/07/2020	(10,966,118)	22.67	248,640,274
2020070903247	FWD	USDMXN	09/07/2020	(15,000)	22.67	340,039
2019100903235	FWD	USDMXN	10/07/2020	127,000	20.39	(2,589,855)
2019100903357	FWD	USDMXN	10/07/2020	747	20.40	(15,232)
2020012903240	FWD	USDMXN	10/07/2020	50,000	19.14	(957,059)
2020012903261	FWD	USDMXN	10/07/2020	(50,000)	19.14	957,025
2020020503234	FWD	USDMXN	10/07/2020	50,000	19.03	(951,410)
2020020503193	FWD	USDMXN	10/07/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020031903101	FWD	USDMXN	10/07/2020	(9,300)	24.37	226,682
2020052003132	FWD	USDMXN	10/07/2020	70,000	23.51	(1,645,410)
2020052003078	FWD	USDMXN	10/07/2020	(70,000)	23.51	1,645,952
2020052203203	FWD	USDMXN	10/07/2020	250,000	22.95	(5,737,959)
2020052203147	FWD	USDMXN	10/07/2020	(250,000)	23.06	5,764,250
2020060103363	FWD	USDMXN	10/07/2020	140,000	22.18	(3,105,414)
2020060103316	FWD	USDMXN	10/07/2020	(140,000)	22.17	3,103,366
2020060203109	FWD	USDMXN	10/07/2020	300,000	22.07	(6,620,238)
2020060203108	FWD	USDMXN	10/07/2020	(300,000)	22.09	6,626,730
2020061203366	FWD	USDMXN	10/07/2020	70,000	22.42	(1,569,230)
2020061203345	FWD	USDMXN	10/07/2020	(70,000)	22.43	1,569,890
2020062403390	FWD	USDMXN	10/07/2020	94,000	22.74	(2,137,297)
2020062403391	FWD	USDMXN	10/07/2020	44,000	22.74	(1,000,437)
2020062403392	FWD	USDMXN	10/07/2020	139,000	22.74	(3,160,471)
2020062403395	FWD	USDMXN	10/07/2020	67,000	22.74	(1,523,392)
2020062403386	FWD	USDMXN	10/07/2020	(344,000)	22.78	7,836,425
2020070303175	FWD	USDMXN	10/07/2020	100,000	22.43	(2,243,155)
2020070303165	FWD	USDMXN	10/07/2020	(100,000)	22.47	2,246,990
2020031103392	FWD	USDMXN	13/07/2020	(50,000,000)	21.76	1,087,772,400
2020031103399	FWD	USDMXN	13/07/2020	(50,000,000)	21.73	1,086,305,000
2020031203178	FWD	USDMXN	13/07/2020	150,000	21.80	(3,270,000)
2020031203065	FWD	USDMXN	13/07/2020	(150,000)	22.50	3,374,481
2020043003132	FWD	USDMXN	13/07/2020	22,588	24.07	(543,611)
2020050703319	FWD	USDMXN	13/07/2020	137,000	24.23	(3,319,457)
2020050703443	FWD	USDMXN	13/07/2020	712	24.30	(17,310)
2020052103286	FWD	USDMXN	13/07/2020	25,000	23.07	(576,828)
2020052103191	FWD	USDMXN	13/07/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052103420	FWD	USDMXN	13/07/2020	(480,000)	23.14	11,105,369
2020052103425	FWD	USDMXN	13/07/2020	(15,816)	23.12	365,622
2020052803513	FWD	USDMXN	13/07/2020	1,686,671	22.34	(37,687,704)
2020052903227	FWD	USDMXN	13/07/2020	25,000	22.31	(557,836)
2020052903165	FWD	USDMXN	13/07/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020061103369	FWD	USDMXN	13/07/2020	576,590	22.58	(13,018,410)
2020061803440	FWD	USDMXN	13/07/2020	50,000	22.85	(1,142,585)
2020061803434	FWD	USDMXN	13/07/2020	(50,000)	22.86	1,143,239
2020062403396	FWD	USDMXN	13/07/2020	131,000	22.75	(2,979,831)
2020062403397	FWD	USDMXN	13/07/2020	159,000	22.75	(3,616,741)
2020062403398	FWD	USDMXN	13/07/2020	131,000	22.75	(2,979,831)
2020062403399	FWD	USDMXN	13/07/2020	94,000	22.75	(2,138,199)
2020062403400	FWD	USDMXN	13/07/2020	139,000	22.75	(3,161,805)
2020062403388	FWD	USDMXN	13/07/2020	(654,000)	22.78	14,901,081
2020062503438	FWD	USDMXN	13/07/2020	313,000	22.83	(7,144,427)
2020062503445	FWD	USDMXN	13/07/2020	1,132	22.73	(25,733)
2020062503444	FWD	USDMXN	13/07/2020	(566)	22.72	12,860
2020070303234	FWD	USDMXN	13/07/2020	42,613	22.43	(955,662)
2020070303231	FWD	USDMXN	13/07/2020	(42,613)	22.44	956,161
2020070603179	FWD	USDMXN	13/07/2020	200,000	22.27	(4,453,400)
2020070603330	FWD	USDMXN	13/07/2020	250,000	22.34	(5,585,193)
2020070603331	FWD	USDMXN	13/07/2020	84	22.37	(1,876)
2020070603172	FWD	USDMXN	13/07/2020	(200,000)	22.28	4,456,734
2020070603310	FWD	USDMXN	13/07/2020	(229,344)	22.35	5,125,845
2020070603311	FWD	USDMXN	13/07/2020	(20,740)	22.35	463,529
2020070903038	FWD	USDMXN	13/07/2020	28,000,000	22.60	(632,884,000)
2019101703172	FWD	USDMXN	14/07/2020	1,041,413	19.93	(20,755,535)
2019101703152	FWD	USDMXN	14/07/2020	(1,041,413)	19.94	20,766,296
2019101803381	FWD	USDMXN	14/07/2020	1,041,413	19.90	(20,728,459)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019101803377	FWD	USDMXN	14/07/2020	(1,041,413)	19.91	20,737,136
2019102203061	FWD	USDMXN	14/07/2020	1,041,413	19.87	(20,689,213)
2019102203057	FWD	USDMXN	14/07/2020	(1,041,413)	19.88	20,699,645
2019121303312	FWD	USDMXN	14/07/2020	1,602,672	19.57	(31,364,437)
2019121303209	FWD	USDMXN	14/07/2020	(534,224)	19.66	10,500,707
2019121303214	FWD	USDMXN	14/07/2020	(534,224)	19.64	10,490,022
2019121303216	FWD	USDMXN	14/07/2020	(534,224)	19.62	10,479,338
2020030603508	FWD	USDMXN	14/07/2020	200,000	20.57	(4,114,080)
2020030603500	FWD	USDMXN	14/07/2020	(200,000)	20.61	4,121,911
2020051903266	FWD	USDMXN	14/07/2020	1,041,968	23.79	(24,787,179)
2020060303066	FWD	USDMXN	14/07/2020	100,000	21.74	(2,174,431)
2020060303074	FWD	USDMXN	14/07/2020	(100,000)	21.77	2,176,890
2020060803302	FWD	USDMXN	14/07/2020	3,000,000	21.75	(65,235,792)
2020060803086	FWD	USDMXN	14/07/2020	(3,000,000)	21.76	65,265,000
2020060903444	FWD	USDMXN	14/07/2020	33,100	21.95	(726,387)
2020060903360	FWD	USDMXN	14/07/2020	(5,000,000)	21.95	109,728,590
2020060903361	FWD	USDMXN	14/07/2020	(4,610,434)	21.95	101,188,567
2020060903369	FWD	USDMXN	14/07/2020	(5,000,000)	21.93	109,630,000
2020060903408	FWD	USDMXN	14/07/2020	(33,100)	22.01	728,465
2020061203325	FWD	USDMXN	14/07/2020	31,100	22.57	(702,072)
2020061203355	FWD	USDMXN	14/07/2020	(31,100)	22.64	703,949
2020061603247	FWD	USDMXN	14/07/2020	(10,000,000)	22.30	222,965,760
2020061603248	FWD	USDMXN	14/07/2020	(5,000,000)	22.29	111,473,930
2020062303156	FWD	USDMXN	14/07/2020	5,576,000	22.41	(124,951,062)
2020062303350	FWD	USDMXN	14/07/2020	700	22.45	(15,723)
2020062503379	FWD	USDMXN	14/07/2020	84,000	22.75	(1,911,412)
2020062503381	FWD	USDMXN	14/07/2020	17,000	22.75	(386,833)
2020062503375	FWD	USDMXN	14/07/2020	(101,000)	22.81	2,303,684
2020063003405	FWD	USDMXN	14/07/2020	643	23.03	(14,821)
2020063003465	FWD	USDMXN	14/07/2020	13,266,000	23.00	(305,078,149)
2020070303242	FWD	USDMXN	14/07/2020	300,000	22.42	(6,726,336)
2020070303223	FWD	USDMXN	14/07/2020	(300,000)	22.44	6,733,020
2020070703281	FWD	USDMXN	14/07/2020	10,966,118	22.69	(248,810,621)
2020070903025	FWD	USDMXN	14/07/2020	25,000,000	22.57	(564,250,500)
2020070903047	FWD	USDMXN	14/07/2020	440,860	22.57	(9,950,977)
2020070903016	FWD	USDMXN	14/07/2020	(54,091,191)	22.56	1,220,135,000
2020071003209	FWD	USDMXN	14/07/2020	(200,000)	22.49	4,498,286
2020071303128	FWD	USDMXN	14/07/2020	3,000,000	22.42	(67,245,000)
2020071303152	FWD	USDMXN	14/07/2020	(3,000,000)	22.42	67,268,100
2019071603254	FWD	USDMXN	15/07/2020	5,700,000	20.18	(115,034,550)
2019100903237	FWD	USDMXN	15/07/2020	82,000	20.41	(1,673,311)
2019100903358	FWD	USDMXN	15/07/2020	762	20.41	(15,552)
2019101703605	FWD	USDMXN	15/07/2020	272,000	20.00	(5,440,687)
2019121803020	FWD	USDMXN	15/07/2020	308,000	19.52	(6,011,246)
2020022803549	FWD	USDMXN	15/07/2020	100,000	20.48	(2,047,520)
2020022803655	FWD	USDMXN	15/07/2020	(100,000)	20.07	2,006,569
2020030903348	FWD	USDMXN	15/07/2020	100,000	22.06	(2,205,870)
2020030903276	FWD	USDMXN	15/07/2020	(100,000)	21.71	2,170,993
2020032403314	FWD	USDMXN	15/07/2020	250,000	25.41	(6,353,725)
2020032403388	FWD	USDMXN	15/07/2020	(500,000)	25.34	12,672,267
2020032703187	FWD	USDMXN	15/07/2020	250,000	23.84	(5,961,089)
2020032703335	FWD	USDMXN	15/07/2020	(300,000)	23.77	7,131,345
2020040103313	FWD	USDMXN	15/07/2020	(5,700,000)	24.76	141,144,683
2020052003409	FWD	USDMXN	15/07/2020	100,000	23.40	(2,339,684)
2020052003403	FWD	USDMXN	15/07/2020	(100,000)	23.43	2,342,760
2020052103581	FWD	USDMXN	15/07/2020	220,000	23.08	(5,076,532)
2020052103545	FWD	USDMXN	15/07/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103566	FWD	USDMXN	15/07/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503333	FWD	USDMXN	15/07/2020	300,000	22.71	(6,812,888)
2020060503197	FWD	USDMXN	15/07/2020	28,000	21.86	(612,133)
2020060503067	FWD	USDMXN	15/07/2020	(28,000)	21.92	613,670
2020060903382	FWD	USDMXN	15/07/2020	100,000	21.95	(2,195,278)
2020060903383	FWD	USDMXN	15/07/2020	100,000	21.95	(2,195,278)
2020060903417	FWD	USDMXN	15/07/2020	(200,000)	21.97	4,393,560
2020061503078	FWD	USDMXN	15/07/2020	745,000	22.62	(16,854,819)
2020062903158	FWD	USDMXN	15/07/2020	19,230	23.15	(445,191)
2020062903206	FWD	USDMXN	15/07/2020	1,000,000	23.17	(23,171,417)
2020062903146	FWD	USDMXN	15/07/2020	(19,230)	23.34	448,736
2020062903197	FWD	USDMXN	15/07/2020	(1,000,000)	23.20	23,198,000
2020071303316	FWD	USDMXN	15/07/2020	(150,000)	22.56	3,383,841
2020071503205	FWD	USDMXN	15/07/2020	(22,468,000)	22.30	501,036,400
2020011603089	FWD	USDMXN	16/07/2020	500,000	19.26	(9,631,281)
2020021203451	FWD	USDMXN	16/07/2020	298,400	19.03	(5,677,700)
2020021203426	FWD	USDMXN	16/07/2020	(298,400)	19.04	5,681,626

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020030503410	FWD	USDMXN	16/07/2020	100,000	20.23	(2,022,880)
2020030503328	FWD	USDMXN	16/07/2020	(100,000)	20.35	2,034,632
2020031803167	FWD	USDMXN	16/07/2020	500,000	24.08	(12,040,586)
2020031803015	FWD	USDMXN	16/07/2020	(500,000)	24.45	12,223,831
2020031803226	FWD	USDMXN	16/07/2020	(500,000)	24.43	12,213,488
2020060203105	FWD	USDMXN	16/07/2020	1,000,000	21.93	(21,932,846)
2020060203088	FWD	USDMXN	16/07/2020	(1,000,000)	21.93	21,926,400
2020061603252	FWD	USDMXN	16/07/2020	372,000	22.27	(8,285,986)
2020061603273	FWD	USDMXN	16/07/2020	500	22.33	(11,166)
2020062503385	FWD	USDMXN	16/07/2020	131,000	22.76	(2,981,704)
2020062503376	FWD	USDMXN	16/07/2020	(131,000)	22.81	2,988,761
2020063003351	FWD	USDMXN	16/07/2020	125,000	23.02	(2,877,726)
2020063003342	FWD	USDMXN	16/07/2020	(125,000)	23.05	2,880,700
2020070303084	FWD	USDMXN	16/07/2020	200,000	22.42	(4,483,388)
2020070303077	FWD	USDMXN	16/07/2020	(200,000)	22.43	4,486,000
2020071403284	FWD	USDMXN	16/07/2020	15,000,000	22.51	(337,702,050)
2020071403472	FWD	USDMXN	16/07/2020	12,500,000	22.46	(280,750,000)
2020012903241	FWD	USDMXN	17/07/2020	50,000	19.16	(958,021)
2020012903262	FWD	USDMXN	17/07/2020	(50,000)	19.14	957,025
2020020503235	FWD	USDMXN	17/07/2020	50,000	19.05	(952,352)
2020020503194	FWD	USDMXN	17/07/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020031203399	FWD	USDMXN	17/07/2020	(100,000,000)	22.44	2,244,000,000
2020043003133	FWD	USDMXN	17/07/2020	37,478	24.12	(903,904)
2020051803032	FWD	USDMXN	17/07/2020	100,000	23.76	(2,376,470)
2020051803040	FWD	USDMXN	17/07/2020	(100,000)	23.82	2,381,500
2020052203206	FWD	USDMXN	17/07/2020	250,000	22.97	(5,743,692)
2020052203150	FWD	USDMXN	17/07/2020	(250,000)	23.08	5,770,050
2020070303174	FWD	USDMXN	17/07/2020	100,000	22.45	(2,245,297)
2020070303166	FWD	USDMXN	17/07/2020	(100,000)	22.47	2,246,990
2020071503497	FWD	USDMXN	17/07/2020	(135,000)	22.33	3,014,125
2019101103123	FWD	USDMXN	20/07/2020	70,900	20.16	(1,428,991)
2019101103239	FWD	USDMXN	20/07/2020	68	20.14	(1,366)
2020042003056	FWD	USDMXN	20/07/2020	11,000,000	24.33	(267,627,965)
2020042003051	FWD	USDMXN	20/07/2020	(11,000,000)	24.33	267,649,800
2020042203124	FWD	USDMXN	20/07/2020	37,953,877	24.88	(944,140,649)
2020042203497	FWD	USDMXN	20/07/2020	590	24.79	(14,630)
2020042203273	FWD	USDMXN	20/07/2020	(37,896,749)	24.91	944,140,649
2020042203496	FWD	USDMXN	20/07/2020	(57,719)	24.79	1,430,614
2020052003287	FWD	USDMXN	20/07/2020	50,000	23.47	(1,173,466)
2020052003258	FWD	USDMXN	20/07/2020	(50,000)	23.48	1,174,000
2020052103287	FWD	USDMXN	20/07/2020	25,000	23.10	(577,403)
2020052103189	FWD	USDMXN	20/07/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803406	FWD	USDMXN	20/07/2020	393,000	22.38	(8,796,098)
2020052803409	FWD	USDMXN	20/07/2020	(237)	22.37	5,301
2020052903228	FWD	USDMXN	20/07/2020	25,000	22.34	(558,396)
2020052903166	FWD	USDMXN	20/07/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020071303189	FWD	USDMXN	20/07/2020	27,732,683	22.49	(623,573,169)
2020071303195	FWD	USDMXN	20/07/2020	(27,727,056)	22.49	623,573,169
2020071303326	FWD	USDMXN	20/07/2020	(5,627)	22.56	126,919
2019102403075	FWD	USDMXN	21/07/2020	1,041,413	19.84	(20,662,077)
2019102403071	FWD	USDMXN	21/07/2020	(1,041,413)	19.85	20,669,965
2019102503463	FWD	USDMXN	21/07/2020	1,041,413	19.81	(20,625,661)
2019102503455	FWD	USDMXN	21/07/2020	(1,041,413)	19.81	20,630,287
2019121303313	FWD	USDMXN	21/07/2020	1,602,672	19.59	(31,395,202)
2019121303222	FWD	USDMXN	21/07/2020	(534,224)	19.62	10,479,071
2019121303223	FWD	USDMXN	21/07/2020	(534,224)	19.60	10,468,386
2019121303224	FWD	USDMXN	21/07/2020	(534,224)	19.59	10,463,044
2020030503442	FWD	USDMXN	21/07/2020	345,000	20.31	(7,006,127)
2020030503457	FWD	USDMXN	21/07/2020	5,000	20.35	(101,772)
2020030503053	FWD	USDMXN	21/07/2020	(350,000)	20.18	7,064,069
2020030603275	FWD	USDMXN	21/07/2020	200,000	20.42	(4,084,000)
2020030603294	FWD	USDMXN	21/07/2020	(200,000)	20.63	4,125,054
2020043003136	FWD	USDMXN	21/07/2020	100,429	24.15	(2,425,127)
2020060203456	FWD	USDMXN	21/07/2020	1,720,000	21.88	(37,638,975)
2020060203488	FWD	USDMXN	21/07/2020	(1,720,000)	21.92	37,707,388
2020060503198	FWD	USDMXN	21/07/2020	30,000	21.88	(656,412)
2020060503068	FWD	USDMXN	21/07/2020	(30,000)	21.94	658,062
2020061703354	FWD	USDMXN	21/07/2020	65,700	22.45	(1,474,751)
2020061703356	FWD	USDMXN	21/07/2020	(65,700)	22.50	1,478,119
2020061903095	FWD	USDMXN	21/07/2020	745,000	22.69	(16,903,662)
2020070603237	FWD	USDMXN	21/07/2020	3,400,000	22.34	(75,968,506)
2020070603229	FWD	USDMXN	21/07/2020	(3,400,000)	22.34	75,958,380
2019080703072	FWD	USDMXN	22/07/2020	(350,000)	20.81	7,285,163
2019121003215	FWD	USDMXN	22/07/2020	73,903	19.85	(1,466,612)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020032403312	FWD	USDMXN	22/07/2020	250,000	25.44	(6,360,262)
2020032403389	FWD	USDMXN	22/07/2020	(500,000)	25.37	12,684,784
2020032703188	FWD	USDMXN	22/07/2020	250,000	23.87	(5,967,108)
2020032703336	FWD	USDMXN	22/07/2020	(300,000)	23.79	7,138,472
2020052103583	FWD	USDMXN	22/07/2020	220,000	23.10	(5,081,566)
2020052103548	FWD	USDMXN	22/07/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103567	FWD	USDMXN	22/07/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052203413	FWD	USDMXN	22/07/2020	691,000	22.99	(15,887,371)
2020052203355	FWD	USDMXN	22/07/2020	(691,000)	23.00	15,892,655
2020052503336	FWD	USDMXN	22/07/2020	300,000	22.73	(6,819,788)
2020052703364	FWD	USDMXN	22/07/2020	231,500	22.51	(5,210,914)
2020052703281	FWD	USDMXN	22/07/2020	(231,490)	22.51	5,211,650
2020052803422	FWD	USDMXN	22/07/2020	39,000	22.32	(870,609)
2020052803392	FWD	USDMXN	22/07/2020	(39,000)	22.39	873,389
2020060203505	FWD	USDMXN	22/07/2020	17,979,364	21.88	(393,460,400)
2020060203363	FWD	USDMXN	22/07/2020	(8,000,000)	21.86	174,913,744
2020060203369	FWD	USDMXN	22/07/2020	(9,958,336)	21.88	217,928,218
2020060203508	FWD	USDMXN	22/07/2020	(21,038)	21.91	460,910
2020060903384	FWD	USDMXN	22/07/2020	100,000	21.97	(2,197,371)
2020060903385	FWD	USDMXN	22/07/2020	100,000	21.97	(2,197,371)
2020060903418	FWD	USDMXN	22/07/2020	(200,000)	21.99	4,397,780
2020061703023	FWD	USDMXN	22/07/2020	760,000	22.33	(16,969,391)
2020061703021	FWD	USDMXN	22/07/2020	(760,000)	22.38	17,008,800
2020070603236	FWD	USDMXN	22/07/2020	3,400,000	22.33	(75,927,100)
2020070603238	FWD	USDMXN	22/07/2020	(3,400,000)	22.35	75,975,953
2020070703219	FWD	USDMXN	22/07/2020	1,148,492	22.68	(26,044,907)
2020070703195	FWD	USDMXN	22/07/2020	(1,148,493)	22.69	26,053,558
2020071403358	FWD	USDMXN	22/07/2020	100,000	22.47	(2,247,426)
2020071403362	FWD	USDMXN	22/07/2020	9,077	22.46	(203,869)
2020071403364	FWD	USDMXN	22/07/2020	(109,077)	22.49	2,452,921
2020072003321	FWD	USDMXN	22/07/2020	2,100,000	22.51	(47,268,396)
2020072103397	FWD	USDMXN	22/07/2020	200,000	22.30	(4,459,710)
2020072103399	FWD	USDMXN	22/07/2020	1,000,000	22.29	(22,289,978)
2019080703083	FWD	USDMXN	23/07/2020	(250,000)	20.83	5,207,073
2019121303285	FWD	USDMXN	23/07/2020	1,000,000	19.65	(19,652,153)
2020022703187	FWD	USDMXN	23/07/2020	(343,000)	19.86	6,812,519
2020030503412	FWD	USDMXN	23/07/2020	100,000	20.24	(2,024,050)
2020030503329	FWD	USDMXN	23/07/2020	(100,000)	20.37	2,036,821
2020030503444	FWD	USDMXN	23/07/2020	(343,000)	20.30	6,962,201
2020060203106	FWD	USDMXN	23/07/2020	1,000,000	21.94	(21,935,242)
2020060203090	FWD	USDMXN	23/07/2020	(1,000,000)	21.93	21,928,700
2020060303067	FWD	USDMXN	23/07/2020	100,000	21.77	(2,177,315)
2020060303075	FWD	USDMXN	23/07/2020	(100,000)	21.80	2,179,770
2020061103423	FWD	USDMXN	23/07/2020	(135,000)	22.84	3,083,429
2020062303091	FWD	USDMXN	23/07/2020	187,500	22.39	(4,198,755)
2020063003352	FWD	USDMXN	23/07/2020	125,000	23.04	(2,880,490)
2020063003347	FWD	USDMXN	23/07/2020	(125,000)	23.07	2,883,475
2020070303085	FWD	USDMXN	23/07/2020	100,000	22.44	(2,243,738)
2020070303078	FWD	USDMXN	23/07/2020	(100,000)	22.45	2,245,060
2020071403473	FWD	USDMXN	23/07/2020	(12,500,000)	22.48	281,018,750
2020071503498	FWD	USDMXN	23/07/2020	135,000	22.35	(3,016,676)
2020072103400	FWD	USDMXN	23/07/2020	(1,000,000)	22.29	22,292,740
2019083003085	FWD	USDMXN	24/07/2020	3,076,000	21.16	(65,083,495)
2019083003090	FWD	USDMXN	24/07/2020	(3,076,000)	21.15	65,049,710
2019101103130	FWD	USDMXN	24/07/2020	86,000	20.17	(1,734,301)
2019101103240	FWD	USDMXN	24/07/2020	521	20.15	(10,499)
2019112603556	FWD	USDMXN	24/07/2020	40,300	20.23	(815,188)
2019112603601	FWD	USDMXN	24/07/2020	100	20.23	(2,023)
2019112603557	FWD	USDMXN	24/07/2020	(40,400)	20.24	817,650
2020010603122	FWD	USDMXN	24/07/2020	100,000	19.35	(1,934,884)
2020010603101	FWD	USDMXN	24/07/2020	(100,000)	19.43	1,942,500
2020012903242	FWD	USDMXN	24/07/2020	50,000	19.18	(958,982)
2020012903264	FWD	USDMXN	24/07/2020	(50,000)	19.14	957,025
2020020503236	FWD	USDMXN	24/07/2020	50,000	19.07	(953,293)
2020020503195	FWD	USDMXN	24/07/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020051103011	FWD	USDMXN	24/07/2020	26,100	24.16	(630,576)
2020051103013	FWD	USDMXN	24/07/2020	(26,100)	24.21	631,830
2020052003133	FWD	USDMXN	24/07/2020	70,000	23.55	(1,648,687)
2020052003079	FWD	USDMXN	24/07/2020	(70,000)	23.56	1,649,228
2020052203207	FWD	USDMXN	24/07/2020	250,000	23.00	(5,749,424)
2020052203160	FWD	USDMXN	24/07/2020	(250,000)	23.10	5,775,850
2020060103365	FWD	USDMXN	24/07/2020	140,000	22.23	(3,112,377)
2020060103317	FWD	USDMXN	24/07/2020	(140,000)	22.21	3,109,554
2020060403258	FWD	USDMXN	24/07/2020	(15,000)	22.05	330,708

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020061203375	FWD	USDMXN	24/07/2020	70,000	22.57	(1,579,982)
2020061203346	FWD	USDMXN	24/07/2020	(70,000)	22.47	1,572,781
2020061503317	FWD	USDMXN	24/07/2020	690,582	22.36	(15,438,312)
2020061503334	FWD	USDMXN	24/07/2020	4,417	22.35	(98,726)
2020061503329	FWD	USDMXN	24/07/2020	(695,000)	22.36	15,540,951
2020062303229	FWD	USDMXN	24/07/2020	200,000	22.49	(4,497,979)
2020062303230	FWD	USDMXN	24/07/2020	(200,000)	22.54	4,508,000
2020070303192	FWD	USDMXN	24/07/2020	100,000	22.48	(2,247,660)
2020070303194	FWD	USDMXN	24/07/2020	(100,000)	22.50	2,249,800
2020070603103	FWD	USDMXN	24/07/2020	1,300,000	22.24	(28,917,248)
2020070603067	FWD	USDMXN	24/07/2020	(1,300,000)	22.32	29,013,010
2020070903248	FWD	USDMXN	24/07/2020	15,000	22.72	(340,730)
2020071503206	FWD	USDMXN	24/07/2020	22,468,000	22.33	(501,631,802)
2020072203385	FWD	USDMXN	24/07/2020	(135,000)	22.35	3,017,459
2020072203387	FWD	USDMXN	24/07/2020	(350,000)	22.35	7,823,130
2020043003137	FWD	USDMXN	27/07/2020	89,332	24.18	(2,159,900)
2020052103288	FWD	USDMXN	27/07/2020	25,000	23.12	(577,979)
2020052103193	FWD	USDMXN	27/07/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052203111	FWD	USDMXN	27/07/2020	200,000	23.16	(4,631,582)
2020052203067	FWD	USDMXN	27/07/2020	(200,000)	23.23	4,646,480
2020052903229	FWD	USDMXN	27/07/2020	25,000	22.36	(558,956)
2020052903172	FWD	USDMXN	27/07/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020062403326	FWD	USDMXN	27/07/2020	1,000,000	22.82	(22,818,806)
2020062403328	FWD	USDMXN	27/07/2020	(1,000,000)	22.84	22,839,800
2020062503142	FWD	USDMXN	27/07/2020	187,500	22.91	(4,296,144)
2020062503428	FWD	USDMXN	27/07/2020	1,000,000	22.75	(22,754,300)
2020062503426	FWD	USDMXN	27/07/2020	(1,000,000)	22.74	22,739,399
2020072303322	FWD	USDMXN	27/07/2020	(2,970,000)	22.47	66,721,555
2020072303324	FWD	USDMXN	27/07/2020	(3,322,000)	22.46	74,617,668
2020072303333	FWD	USDMXN	27/07/2020	(3,600,000)	22.47	80,886,312
2019102803085	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,041,413	19.79	(20,613,255)
2019102803082	FWD	USDMXN	28/07/2020	(1,041,413)	19.81	20,627,788
2019121303287	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,000,000	19.67	(19,671,812)
2019121303826	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,000,000	19.64	(19,640,960)
2019121603187	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,068,448	19.57	(20,904,228)
2019121603179	FWD	USDMXN	28/07/2020	(534,224)	19.58	10,460,907
2019121603180	FWD	USDMXN	28/07/2020	(534,224)	19.56	10,450,223
2020022803396	FWD	USDMXN	28/07/2020	150,000	20.19	(3,028,500)
2020022803495	FWD	USDMXN	28/07/2020	(150,000)	20.32	3,048,150
2020031803169	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,000,000	24.17	(24,169,153)
2020031803017	FWD	USDMXN	28/07/2020	(1,000,000)	24.49	24,491,005
2020031803231	FWD	USDMXN	28/07/2020	(1,000,000)	24.45	24,451,362
2020043003399	FWD	USDMXN	28/07/2020	(380,607)	24.27	9,237,527
2020052903218	FWD	USDMXN	28/07/2020	61,000	22.39	(1,365,899)
2020052903225	FWD	USDMXN	28/07/2020	607	22.36	(13,576)
2020060803206	FWD	USDMXN	28/07/2020	(36)	21.74	777
2020062603403	FWD	USDMXN	28/07/2020	187,500	23.01	(4,314,695)
2020062603508	FWD	USDMXN	28/07/2020	187,500	23.12	(4,334,263)
2020062903249	FWD	USDMXN	28/07/2020	16,350	23.19	(379,165)
2020062903258	FWD	USDMXN	28/07/2020	(16,350)	23.25	380,138
2020071003337	FWD	USDMXN	28/07/2020	48,714	22.53	(1,097,455)
2020071003342	FWD	USDMXN	28/07/2020	(48,714)	22.58	1,099,848
2020071403424	FWD	USDMXN	28/07/2020	12,000	22.52	(270,253)
2020071403417	FWD	USDMXN	28/07/2020	(12,000)	22.53	270,360
2020072103398	FWD	USDMXN	28/07/2020	(200,000)	22.32	4,463,183
2020032403315	FWD	USDMXN	29/07/2020	250,000	25.47	(6,366,713)
2020032403390	FWD	USDMXN	29/07/2020	(500,000)	25.39	12,697,286
2020032703189	FWD	USDMXN	29/07/2020	250,000	23.89	(5,973,127)
2020032703337	FWD	USDMXN	29/07/2020	(300,000)	23.82	7,145,599
2020042803254	FWD	USDMXN	29/07/2020	2,933,940	24.58	(72,125,511)
2020043003275	FWD	USDMXN	29/07/2020	(380,000)	24.25	9,214,563
2020050403005	FWD	USDMXN	29/07/2020	380,000	24.83	(9,437,187)
2020052103584	FWD	USDMXN	29/07/2020	220,000	23.12	(5,086,565)
2020052103549	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103568	FWD	USDMXN	29/07/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503290	FWD	USDMXN	29/07/2020	300,000	22.76	(6,826,811)
2020052603370	FWD	USDMXN	29/07/2020	36,000	22.45	(808,096)
2020052603371	FWD	USDMXN	29/07/2020	397	22.45	(8,903)
2020060203547	FWD	USDMXN	29/07/2020	161,655	21.92	(3,543,378)
2020060203570	FWD	USDMXN	29/07/2020	161,655	21.92	(3,543,599)
2020060203574	FWD	USDMXN	29/07/2020	(161,655)	21.96	3,549,591
2020060303223	FWD	USDMXN	29/07/2020	100,000	21.79	(2,179,242)
2020060303077	FWD	USDMXN	29/07/2020	(100,000)	21.82	2,181,680
2020060503200	FWD	USDMXN	29/07/2020	28,000	21.91	(613,343)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020060503069	FWD	USDMXN	29/07/2020	(28,000)	21.96	614,880
2020060903386	FWD	USDMXN	29/07/2020	100,000	21.99	(2,199,471)
2020060903387	FWD	USDMXN	29/07/2020	100,000	21.99	(2,199,471)
2020060903411	FWD	USDMXN	29/07/2020	836,000	22.01	(18,397,463)
2020060903419	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	22.01	4,401,980
2020061003003	FWD	USDMXN	29/07/2020	912	21.97	(20,037)
2020061603255	FWD	USDMXN	29/07/2020	1,134,000	22.33	(25,325,903)
2020061603274	FWD	USDMXN	29/07/2020	139	22.37	(3,104)
2020062303186	FWD	USDMXN	29/07/2020	(16,859,130)	22.46	378,576,596
2020063003368	FWD	USDMXN	29/07/2020	(573,000)	23.05	13,209,204
2020063003406	FWD	USDMXN	29/07/2020	(41)	23.07	937
2020063003467	FWD	USDMXN	29/07/2020	(13,000,000)	23.04	299,566,423
2020070903006	FWD	USDMXN	29/07/2020	400,000	22.66	(9,064,200)
2020070903008	FWD	USDMXN	29/07/2020	200,000	22.66	(4,532,283)
2020070903005	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	22.73	4,546,000
2020070903007	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	22.72	4,544,000
2020070903009	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	22.69	4,538,000
2020071003210	FWD	USDMXN	29/07/2020	200,000	22.54	(4,507,608)
2020071003207	FWD	USDMXN	29/07/2020	(200,000)	22.57	4,514,000
2020071403220	FWD	USDMXN	29/07/2020	425,878	22.61	(9,627,650)
2020071403222	FWD	USDMXN	29/07/2020	13,000,000	22.63	(294,214,765)
2020072703380	FWD	USDMXN	29/07/2020	(150,000)	21.99	3,297,821
2020072703384	FWD	USDMXN	29/07/2020	(500,000)	21.98	10,990,285
2020072703386	FWD	USDMXN	29/07/2020	(500,000)	21.98	10,990,535
2020072903255	FWD	USDMXN	29/07/2020	(26,100)	21.99	573,965
2019080603172	FWD	USDMXN	30/07/2020	(250,000)	20.83	5,206,585
2019101103742	FWD	USDMXN	30/07/2020	250,000	20.17	(5,041,470)
2020022803148	FWD	USDMXN	30/07/2020	(20,000)	20.19	403,719
2020030303038	FWD	USDMXN	30/07/2020	(400,000)	19.90	7,960,534
2020030503415	FWD	USDMXN	30/07/2020	100,000	20.25	(2,025,220)
2020030503330	FWD	USDMXN	30/07/2020	(100,000)	20.39	2,039,010
2020031203133	FWD	USDMXN	30/07/2020	100,000	23.01	(2,301,000)
2020031203113	FWD	USDMXN	30/07/2020	(100,000)	22.75	2,274,692
2020031803339	FWD	USDMXN	30/07/2020	100,000	24.61	(2,461,220)
2020031803370	FWD	USDMXN	30/07/2020	(100,000)	24.36	2,436,234
2020033003221	FWD	USDMXN	30/07/2020	(8,500)	24.64	209,408
2020042203155	FWD	USDMXN	30/07/2020	400,000	24.95	(9,979,912)
2020050603103	FWD	USDMXN	30/07/2020	(11,500)	24.59	282,823
2020060903449	FWD	USDMXN	30/07/2020	836,000	22.00	(18,396,046)
2020060903412	FWD	USDMXN	30/07/2020	(836,000)	22.01	18,398,695
2020062303158	FWD	USDMXN	30/07/2020	10,000,000	22.44	(224,409,690)
2020062303171	FWD	USDMXN	30/07/2020	10,000,000	22.42	(224,249,700)
2020062303173	FWD	USDMXN	30/07/2020	375,000	22.43	(8,410,758)
2020062303182	FWD	USDMXN	30/07/2020	(20,375,000)	22.50	458,366,188
2020062603149	FWD	USDMXN	30/07/2020	20,375,000	23.12	(470,978,313)
2020062603135	FWD	USDMXN	30/07/2020	(20,375,000)	23.07	470,135,969
2020063003038	FWD	USDMXN	30/07/2020	187,000	23.21	(4,340,207)
2020063003310	FWD	USDMXN	30/07/2020	500	23.13	(11,565)
2020063003353	FWD	USDMXN	30/07/2020	125,000	23.07	(2,883,280)
2020063003349	FWD	USDMXN	30/07/2020	(125,000)	23.09	2,886,250
2020070303086	FWD	USDMXN	30/07/2020	100,000	22.46	(2,245,791)
2020070303079	FWD	USDMXN	30/07/2020	(100,000)	22.47	2,247,110
2020070803050	FWD	USDMXN	30/07/2020	(135,000)	22.91	3,092,888
2020072203205	FWD	USDMXN	30/07/2020	15,301	22.28	(340,938)
2020072203386	FWD	USDMXN	30/07/2020	135,000	22.37	(3,019,995)
2020072203203	FWD	USDMXN	30/07/2020	(15,301)	22.30	341,139
2020072803153	FWD	USDMXN	30/07/2020	27,099,824	21.96	(595,132,460)
2020072803148	FWD	USDMXN	30/07/2020	(11,312,063)	21.96	248,447,632
2020072803318	FWD	USDMXN	30/07/2020	(6,937,500)	21.94	152,208,750
2020072803425	FWD	USDMXN	30/07/2020	(350,500)	21.94	7,688,908
2019102103282	FWD	USDMXN	31/07/2020	8,000,000	19.97	(159,727,016)
2019102103279	FWD	USDMXN	31/07/2020	(8,000,000)	19.97	159,769,600
2020012903227	FWD	USDMXN	31/07/2020	68,210	19.21	(1,310,079)
2020012903243	FWD	USDMXN	31/07/2020	50,000	19.20	(959,945)
2020012903231	FWD	USDMXN	31/07/2020	(68,210)	19.21	1,310,314
2020012903265	FWD	USDMXN	31/07/2020	(50,000)	19.14	957,025
2020020503237	FWD	USDMXN	31/07/2020	50,000	19.08	(954,235)
2020020503198	FWD	USDMXN	31/07/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020022703280	FWD	USDMXN	31/07/2020	(500,000)	19.76	9,882,223
2020030503160	FWD	USDMXN	31/07/2020	(100,000)	20.21	2,021,076
2020042403297	FWD	USDMXN	31/07/2020	50,000	25.66	(1,282,975)
2020042403273	FWD	USDMXN	31/07/2020	(50,000)	25.71	1,285,500
2020052203209	FWD	USDMXN	31/07/2020	250,000	23.02	(5,755,050)
2020052203161	FWD	USDMXN	31/07/2020	(250,000)	23.13	5,781,500

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020061103297	FWD	USDMXN	31/07/2020	500,000	22.65	(11,324,884)
2020062603342	FWD	USDMXN	31/07/2020	50,000,000	23.07	(1,153,250,000)
2020062603377	FWD	USDMXN	31/07/2020	31,000,000	23.05	(714,491,100)
2020062603382	FWD	USDMXN	31/07/2020	730,373	23.02	(16,813,123)
2020062603370	FWD	USDMXN	31/07/2020	(81,730,373)	23.06	1,884,400,000
2020072903249	FWD	USDMXN	31/07/2020	1,500,000	22.00	(33,005,340)
2020072903406	FWD	USDMXN	31/07/2020	(135,000)	21.99	2,968,196
2020021203452	FWD	USDMXN	03/08/2020	387,100	19.07	(7,383,603)
2020021203427	FWD	USDMXN	03/08/2020	(387,100)	19.09	7,388,616
2020052103289	FWD	USDMXN	03/08/2020	25,000	23.14	(578,541)
2020052103194	FWD	USDMXN	03/08/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052603376	FWD	USDMXN	03/08/2020	250,000	22.72	(5,680,265)
2020052803543	FWD	USDMXN	03/08/2020	15,930	22.40	(356,910)
2020052803557	FWD	USDMXN	03/08/2020	(15,930)	22.48	358,046
2020052903230	FWD	USDMXN	03/08/2020	25,000	22.38	(559,517)
2020052903174	FWD	USDMXN	03/08/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020061103424	FWD	USDMXN	03/08/2020	(11,500)	22.87	262,974
2020061803265	FWD	USDMXN	03/08/2020	(250,000)	22.84	5,710,832
2020070203063	FWD	USDMXN	03/08/2020	350,000	22.61	(7,911,761)
2020070203167	FWD	USDMXN	03/08/2020	500	22.60	(11,301)
2020072703164	FWD	USDMXN	03/08/2020	26,000	22.00	(572,017)
2020072703155	FWD	USDMXN	03/08/2020	(26,000)	22.19	576,880
2020073003403	FWD	USDMXN	03/08/2020	147,527	22.08	(3,258,000)
2019101503210	FWD	USDMXN	04/08/2020	1,036,003	20.12	(20,840,367)
2019101503200	FWD	USDMXN	04/08/2020	(1,036,003)	20.12	20,849,042
2019101603103	FWD	USDMXN	04/08/2020	1,036,003	20.09	(20,811,562)
2019101603256	FWD	USDMXN	04/08/2020	2,072,006	20.05	(41,544,334)
2019101603100	FWD	USDMXN	04/08/2020	(1,036,003)	20.10	20,821,485
2019101603246	FWD	USDMXN	04/08/2020	(1,036,003)	20.07	20,793,098
2019101603247	FWD	USDMXN	04/08/2020	(1,036,003)	20.05	20,767,198
2019121103567	FWD	USDMXN	04/08/2020	773,071	19.78	(15,291,722)
2019121103600	FWD	USDMXN	04/08/2020	773,071	19.76	(15,276,486)
2019121103555	FWD	USDMXN	04/08/2020	(773,071)	19.79	15,297,142
2019121103598	FWD	USDMXN	04/08/2020	(773,071)	19.77	15,281,681
2019121303314	FWD	USDMXN	04/08/2020	773,071	19.63	(15,173,720)
2019121303226	FWD	USDMXN	04/08/2020	(773,071)	19.73	15,255,397
2020050603217	FWD	USDMXN	04/08/2020	16,856,257	24.55	(413,852,428)
2020050603205	FWD	USDMXN	04/08/2020	(16,856,257)	24.60	414,727,522
2020060503202	FWD	USDMXN	04/08/2020	40,000	21.92	(876,947)
2020060503070	FWD	USDMXN	04/08/2020	(40,000)	21.98	879,140
2020061203364	FWD	USDMXN	04/08/2020	2,000,000	22.60	(45,201,148)
2020061203321	FWD	USDMXN	04/08/2020	(2,000,000)	22.62	45,230,000
2020070303159	FWD	USDMXN	04/08/2020	350,000	22.50	(7,873,959)
2020070303160	FWD	USDMXN	04/08/2020	500	22.51	(11,256)
2020070603016	FWD	USDMXN	04/08/2020	2,000,000	22.29	(44,576,936)
2020070603038	FWD	USDMXN	04/08/2020	2,000,000	22.32	(44,637,280)
2020070603050	FWD	USDMXN	04/08/2020	2,000,000	22.29	(44,589,816)
2020070603024	FWD	USDMXN	04/08/2020	(2,000,000)	22.30	44,590,000
2020070603036	FWD	USDMXN	04/08/2020	(2,000,000)	22.33	44,653,000
2020070603046	FWD	USDMXN	04/08/2020	(2,000,000)	22.30	44,597,000
2020070803218	FWD	USDMXN	04/08/2020	13,000,000	22.82	(296,647,000)
2020070803232	FWD	USDMXN	04/08/2020	(5,000,000)	22.83	114,162,790
2020070803233	FWD	USDMXN	04/08/2020	(8,000,000)	22.83	182,635,784
2020071403425	FWD	USDMXN	04/08/2020	33,500	22.54	(755,159)
2020071403418	FWD	USDMXN	04/08/2020	(33,500)	22.55	755,459
2020073103427	FWD	USDMXN	04/08/2020	475,700	22.25	(10,582,969)
2020080303071	FWD	USDMXN	04/08/2020	6,000,000	22.60	(135,600,000)
2020080303067	FWD	USDMXN	04/08/2020	(6,000,000)	22.60	135,574,740
2019081903024	FWD	USDMXN	05/08/2020	(350,000)	20.86	7,301,585
2020031803186	FWD	USDMXN	05/08/2020	(169,611)	24.20	4,105,002
2020032403316	FWD	USDMXN	05/08/2020	250,000	25.49	(6,372,948)
2020032403391	FWD	USDMXN	05/08/2020	(500,000)	25.42	12,709,747
2020032703190	FWD	USDMXN	05/08/2020	250,000	23.92	(5,979,070)
2020032703338	FWD	USDMXN	05/08/2020	(300,000)	23.84	7,152,852
2020052103585	FWD	USDMXN	05/08/2020	220,000	23.14	(5,091,477)
2020052103550	FWD	USDMXN	05/08/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103571	FWD	USDMXN	05/08/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503298	FWD	USDMXN	05/08/2020	300,000	22.78	(6,833,566)
2020060903388	FWD	USDMXN	05/08/2020	100,000	22.02	(2,201,572)
2020060903389	FWD	USDMXN	05/08/2020	100,000	22.02	(2,201,572)
2020060903420	FWD	USDMXN	05/08/2020	(200,000)	22.03	4,406,200
2020070603234	FWD	USDMXN	05/08/2020	350,000	22.38	(7,834,483)
2020070603251	FWD	USDMXN	05/08/2020	500	22.42	(11,209)
2020080303216	FWD	USDMXN	05/08/2020	180,000	22.59	(4,065,637)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020080303218	FWD	USDMXN	05/08/2020	150,000	22.59	(3,388,278)
2020080303318	FWD	USDMXN	05/08/2020	(380,000)	22.62	8,597,359
2019080703103	FWD	USDMXN	06/08/2020	(260,000)	20.89	5,432,419
2019081903101	FWD	USDMXN	06/08/2020	(250,000)	20.98	5,245,890
2020010903018	FWD	USDMXN	06/08/2020	337,500	19.36	(6,532,767)
2020010903071	FWD	USDMXN	06/08/2020	(337,500)	19.37	6,536,666
2020030603311	FWD	USDMXN	06/08/2020	100,000	20.48	(2,047,940)
2020030603362	FWD	USDMXN	06/08/2020	(100,000)	20.61	2,061,246
2020070203156	FWD	USDMXN	06/08/2020	100,000	22.61	(2,261,347)
2020070203091	FWD	USDMXN	06/08/2020	(100,000)	22.77	2,277,480
2020070703326	FWD	USDMXN	06/08/2020	350,500	22.74	(7,970,594)
2020071003283	FWD	USDMXN	06/08/2020	1,000,000	22.54	(22,544,310)
2020071003265	FWD	USDMXN	06/08/2020	(1,000,000)	22.58	22,578,300
2020072003074	FWD	USDMXN	06/08/2020	(135,000)	22.69	3,062,494
2020072903407	FWD	USDMXN	06/08/2020	135,000	22.01	(2,970,695)
2020080603157	FWD	USDMXN	06/08/2020	100,000	22.36	(2,235,748)
2019101103145	FWD	USDMXN	07/08/2020	63,000	20.21	(1,273,350)
2019101103241	FWD	USDMXN	07/08/2020	848	20.19	(17,126)
2020012903137	FWD	USDMXN	07/08/2020	100,000	19.20	(1,920,380)
2020012903120	FWD	USDMXN	07/08/2020	(100,000)	19.27	1,927,400
2020020503238	FWD	USDMXN	07/08/2020	50,000	19.10	(955,177)
2020020503199	FWD	USDMXN	07/08/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020031903439	FWD	USDMXN	07/08/2020	53,000	24.70	(1,309,100)
2020031903380	FWD	USDMXN	07/08/2020	(53,000)	24.84	1,316,656
2020040303056	FWD	USDMXN	07/08/2020	(27,500)	25.10	690,246
2020050803073	FWD	USDMXN	07/08/2020	60,000	24.02	(1,441,228)
2020050803071	FWD	USDMXN	07/08/2020	(60,000)	24.05	1,442,946
2020052003161	FWD	USDMXN	07/08/2020	100,000	23.60	(2,360,459)
2020052003092	FWD	USDMXN	07/08/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052203212	FWD	USDMXN	07/08/2020	250,000	23.04	(5,760,597)
2020052203162	FWD	USDMXN	07/08/2020	(250,000)	23.15	5,787,050
2020062303033	FWD	USDMXN	07/08/2020	340,000	22.48	(7,644,737)
2020062303035	FWD	USDMXN	07/08/2020	(340,000)	22.50	7,649,830
2020070603104	FWD	USDMXN	07/08/2020	1,500,000	22.29	(33,427,607)
2020070603073	FWD	USDMXN	07/08/2020	(1,500,000)	22.32	33,476,550
2020070803118	FWD	USDMXN	07/08/2020	350,500	22.96	(8,047,636)
2020072403418	FWD	USDMXN	07/08/2020	53,000	22.30	(1,181,972)
2020072403431	FWD	USDMXN	07/08/2020	(53,000)	22.41	1,187,730
2020050603219	FWD	USDMXN	10/08/2020	11,120,730	24.64	(274,000,000)
2020050603177	FWD	USDMXN	10/08/2020	(11,113,364)	24.66	274,000,000
2020050603240	FWD	USDMXN	10/08/2020	(7,366)	24.56	180,891
2020051103014	FWD	USDMXN	10/08/2020	(26,100)	24.26	633,130
2020052103291	FWD	USDMXN	10/08/2020	25,000	23.16	(579,104)
2020052103197	FWD	USDMXN	10/08/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803544	FWD	USDMXN	10/08/2020	15,930	22.43	(357,273)
2020052803560	FWD	USDMXN	10/08/2020	(15,930)	22.50	358,388
2020052903231	FWD	USDMXN	10/08/2020	25,000	22.40	(560,068)
2020052903175	FWD	USDMXN	10/08/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020060103367	FWD	USDMXN	10/08/2020	140,000	22.29	(3,119,940)
2020060103319	FWD	USDMXN	10/08/2020	(140,000)	22.27	3,117,114
2020061203367	FWD	USDMXN	10/08/2020	70,000	22.51	(1,575,679)
2020061203347	FWD	USDMXN	10/08/2020	(70,000)	22.52	1,576,372
2020070103397	FWD	USDMXN	10/08/2020	70,000	22.89	(1,602,272)
2020070103359	FWD	USDMXN	10/08/2020	(70,000)	22.90	1,603,056
2020070903404	FWD	USDMXN	10/08/2020	350,000	22.76	(7,965,566)
2020070903406	FWD	USDMXN	10/08/2020	500	22.74	(11,371)
2020071003249	FWD	USDMXN	10/08/2020	70,000	22.57	(1,580,168)
2020071003231	FWD	USDMXN	10/08/2020	(70,000)	22.58	1,580,719
2020071503360	FWD	USDMXN	10/08/2020	70,000	22.48	(1,573,610)
2020071503332	FWD	USDMXN	10/08/2020	(70,000)	22.49	1,574,286
2020072703165	FWD	USDMXN	10/08/2020	30,000	22.02	(660,661)
2020072703158	FWD	USDMXN	10/08/2020	(30,000)	22.21	666,276
2020072903256	FWD	USDMXN	10/08/2020	26,100	22.03	(574,940)
2020073103315	FWD	USDMXN	10/08/2020	26,100	22.21	(579,681)
2020073103294	FWD	USDMXN	10/08/2020	(26,100)	22.24	580,506
2020080603280	FWD	USDMXN	10/08/2020	(100,000)	22.34	2,233,903
2019101703170	FWD	USDMXN	11/08/2020	1,036,003	20.01	(20,727,985)
2019101703157	FWD	USDMXN	11/08/2020	(1,036,003)	20.02	20,738,190
2019101803382	FWD	USDMXN	11/08/2020	1,036,003	19.98	(20,700,257)
2019101803379	FWD	USDMXN	11/08/2020	(1,036,003)	19.99	20,708,560
2019102203062	FWD	USDMXN	11/08/2020	1,036,003	19.94	(20,660,600)
2019102203059	FWD	USDMXN	11/08/2020	(1,036,003)	19.95	20,671,368
2019121303315	FWD	USDMXN	11/08/2020	897,078	19.65	(17,625,007)
2019121303358	FWD	USDMXN	11/08/2020	1,422,135	19.71	(28,034,409)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019121303229	FWD	USDMXN	11/08/2020	(773,071)	19.73	15,254,624
2019121303230	FWD	USDMXN	11/08/2020	(773,071)	19.71	15,239,162
2019121303231	FWD	USDMXN	11/08/2020	(773,071)	19.69	15,223,701
2020043003141	FWD	USDMXN	11/08/2020	52,154	24.22	(1,262,924)
2020052203066	FWD	USDMXN	11/08/2020	12,528,443	23.15	(290,000,000)
2020052203120	FWD	USDMXN	11/08/2020	995	23.06	(22,953)
2020052203064	FWD	USDMXN	11/08/2020	(12,529,438)	23.15	290,000,000
2020060203460	FWD	USDMXN	11/08/2020	1,200,000	21.96	(26,351,008)
2020060203491	FWD	USDMXN	11/08/2020	(1,200,000)	22.00	26,396,040
2020060503206	FWD	USDMXN	11/08/2020	40,000	21.95	(877,808)
2020060503071	FWD	USDMXN	11/08/2020	(40,000)	22.00	879,996
2020070803305	FWD	USDMXN	11/08/2020	34,050	22.84	(777,601)
2020070803310	FWD	USDMXN	11/08/2020	(34,050)	22.89	779,473
2020071003206	FWD	USDMXN	11/08/2020	350,500	22.63	(7,930,093)
2020071303153	FWD	USDMXN	11/08/2020	3,000,000	22.51	(67,528,374)
2020071303129	FWD	USDMXN	11/08/2020	(3,000,000)	22.51	67,516,500
2020072003231	FWD	USDMXN	11/08/2020	10,000	22.64	(226,361)
2020072003228	FWD	USDMXN	11/08/2020	(10,000)	22.65	226,540
2020072703226	FWD	USDMXN	11/08/2020	450,000	22.06	(9,925,238)
2020073103111	FWD	USDMXN	11/08/2020	81,000	22.15	(1,794,498)
2020073103112	FWD	USDMXN	11/08/2020	75,000	22.15	(1,661,573)
2020073103171	FWD	USDMXN	11/08/2020	(156,000)	22.21	3,465,064
2020081003200	FWD	USDMXN	11/08/2020	3,000,000	22.43	(67,275,000)
2020081003202	FWD	USDMXN	11/08/2020	(3,000,000)	22.42	67,268,676
2020031003195	FWD	USDMXN	12/08/2020	(100,000,000)	21.50	2,149,750,000
2020031003198	FWD	USDMXN	12/08/2020	(50,000,000)	21.52	1,076,175,000
2020032403317	FWD	USDMXN	12/08/2020	250,000	25.52	(6,379,182)
2020032403392	FWD	USDMXN	12/08/2020	(500,000)	25.44	12,722,207
2020032703191	FWD	USDMXN	12/08/2020	250,000	23.94	(5,984,981)
2020032703339	FWD	USDMXN	12/08/2020	(300,000)	23.87	7,160,155
2020052103586	FWD	USDMXN	12/08/2020	220,000	23.17	(5,096,388)
2020052103552	FWD	USDMXN	12/08/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103573	FWD	USDMXN	12/08/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052503308	FWD	USDMXN	12/08/2020	300,000	22.80	(6,840,644)
2020060903390	FWD	USDMXN	12/08/2020	100,000	22.04	(2,203,661)
2020060903391	FWD	USDMXN	12/08/2020	100,000	22.04	(2,203,661)
2020060903421	FWD	USDMXN	12/08/2020	(200,000)	22.05	4,410,400
2020070203441	FWD	USDMXN	12/08/2020	(900,000)	22.55	20,297,597
2020070203443	FWD	USDMXN	12/08/2020	(4,857)	22.55	109,528
2020071303042	FWD	USDMXN	12/08/2020	350,000	22.58	(7,902,217)
2020071303044	FWD	USDMXN	12/08/2020	500	22.53	(11,263)
2020030603312	FWD	USDMXN	13/08/2020	100,000	20.49	(2,049,150)
2020030603363	FWD	USDMXN	13/08/2020	(100,000)	20.63	2,063,473
2020051903180	FWD	USDMXN	13/08/2020	213,000	23.88	(5,087,393)
2020051903456	FWD	USDMXN	13/08/2020	881	24.57	(21,645)
2020060903372	FWD	USDMXN	13/08/2020	1,000,000	22.01	(22,012,851)
2020061003000	FWD	USDMXN	13/08/2020	678,208	21.98	(14,909,773)
2020061603256	FWD	USDMXN	13/08/2020	1,321,000	22.38	(29,568,663)
2020061603272	FWD	USDMXN	13/08/2020	605	22.42	(13,569)
2020062203140	FWD	USDMXN	13/08/2020	3,242,000	22.54	(73,065,842)
2020062203147	FWD	USDMXN	13/08/2020	(3,242,000)	22.58	73,214,086
2020062303153	FWD	USDMXN	13/08/2020	2,000,000	22.50	(45,005,892)
2020062303351	FWD	USDMXN	13/08/2020	7,165	22.54	(161,475)
2020070203158	FWD	USDMXN	13/08/2020	100,000	22.64	(2,263,759)
2020070203092	FWD	USDMXN	13/08/2020	(100,000)	22.80	2,279,550
2020071003284	FWD	USDMXN	13/08/2020	1,000,000	22.59	(22,586,235)
2020071003266	FWD	USDMXN	13/08/2020	(1,000,000)	22.58	22,579,600
2020071403357	FWD	USDMXN	13/08/2020	350,500	22.54	(7,899,225)
2020071403215	FWD	USDMXN	13/08/2020	(10,000,000)	22.66	226,600,810
2020071403285	FWD	USDMXN	13/08/2020	(15,000,000)	22.60	338,978,655
2020071403386	FWD	USDMXN	13/08/2020	(523,726)	22.58	11,824,479
2020072103219	FWD	USDMXN	13/08/2020	(447,400)	22.38	10,011,434
2020072103236	FWD	USDMXN	13/08/2020	(43)	22.38	970
2020072803149	FWD	USDMXN	13/08/2020	11,312,063	22.01	(248,937,331)
2020073103114	FWD	USDMXN	13/08/2020	129,000	22.16	(2,858,640)
2020073103115	FWD	USDMXN	13/08/2020	80,000	22.16	(1,772,800)
2020073103116	FWD	USDMXN	13/08/2020	71,000	22.16	(1,573,360)
2020073103172	FWD	USDMXN	13/08/2020	(280,000)	22.22	6,220,943
2020073103302	FWD	USDMXN	13/08/2020	(11,500)	22.23	255,625
2020080303092	FWD	USDMXN	13/08/2020	135,000	22.60	(3,051,000)
2020080303080	FWD	USDMXN	13/08/2020	(135,000)	22.63	3,054,479
2020080403362	FWD	USDMXN	13/08/2020	15,000,000	22.80	(342,010,875)
2020080703117	FWD	USDMXN	13/08/2020	91,500,000	22.53	(2,061,037,500)
2020080703126	FWD	USDMXN	13/08/2020	(91,500,000)	22.46	2,054,907,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019101103148	FWD	USDMXN	14/08/2020	67,000	20.23	(1,355,505)
2019101103242	FWD	USDMXN	14/08/2020	374	20.21	(7,567)
2019121703411	FWD	USDMXN	14/08/2020	1,000,000	19.55	(19,551,729)
2020012903138	FWD	USDMXN	14/08/2020	100,000	19.22	(1,922,278)
2020012903121	FWD	USDMXN	14/08/2020	(100,000)	19.30	1,929,500
2020020503239	FWD	USDMXN	14/08/2020	50,000	19.12	(956,115)
2020020503201	FWD	USDMXN	14/08/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021403429	FWD	USDMXN	14/08/2020	60,000	19.03	(1,141,691)
2020021403424	FWD	USDMXN	14/08/2020	(60,000)	19.04	1,142,568
2020022803551	FWD	USDMXN	14/08/2020	100,000	20.48	(2,047,520)
2020022803519	FWD	USDMXN	14/08/2020	(100,000)	20.37	2,037,096
2020030303191	FWD	USDMXN	14/08/2020	500,000	19.67	(9,835,515)
2020030603517	FWD	USDMXN	14/08/2020	100,000	20.77	(2,076,720)
2020030603321	FWD	USDMXN	14/08/2020	(500,000)	20.73	10,364,092
2020030603498	FWD	USDMXN	14/08/2020	(100,000)	20.82	2,082,073
2020030903349	FWD	USDMXN	14/08/2020	100,000	22.06	(2,205,870)
2020030903277	FWD	USDMXN	14/08/2020	(100,000)	21.81	2,181,213
2020032603475	FWD	USDMXN	14/08/2020	300,000	23.69	(7,105,780)
2020032603554	FWD	USDMXN	14/08/2020	97,410	23.66	(2,305,125)
2020032603480	FWD	USDMXN	14/08/2020	(397,410)	23.69	9,413,451
2020041503025	FWD	USDMXN	14/08/2020	8,000,000	24.51	(196,072,320)
2020041503021	FWD	USDMXN	14/08/2020	(8,000,000)	24.58	196,600,000
2020050803077	FWD	USDMXN	14/08/2020	60,000	24.04	(1,442,567)
2020050803076	FWD	USDMXN	14/08/2020	(60,000)	24.07	1,444,284
2020052003164	FWD	USDMXN	14/08/2020	100,000	23.63	(2,362,654)
2020052003094	FWD	USDMXN	14/08/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052203213	FWD	USDMXN	14/08/2020	250,000	23.06	(5,766,144)
2020052203165	FWD	USDMXN	14/08/2020	(250,000)	23.17	5,792,600
2020073103118	FWD	USDMXN	14/08/2020	134,000	22.16	(2,969,829)
2020073103173	FWD	USDMXN	14/08/2020	(134,000)	22.22	2,977,549
2020080703252	FWD	USDMXN	14/08/2020	142,606	22.39	(3,193,240)
2020080703154	FWD	USDMXN	14/08/2020	(18,127)	22.48	407,405
2020080703155	FWD	USDMXN	14/08/2020	(124,479)	22.48	2,797,666
2019101703591	FWD	USDMXN	17/08/2020	241,000	20.07	(4,837,227)
2019121603485	FWD	USDMXN	17/08/2020	750,000	19.62	(14,717,033)
2020022803390	FWD	USDMXN	17/08/2020	3,000,000	20.26	(60,793,800)
2020022803392	FWD	USDMXN	17/08/2020	2,000,000	20.27	(40,545,200)
2020022803419	FWD	USDMXN	17/08/2020	(3,000,000)	20.29	60,870,180
2020022803421	FWD	USDMXN	17/08/2020	(2,000,000)	20.30	40,599,570
2020031803168	FWD	USDMXN	17/08/2020	750,000	24.20	(18,151,346)
2020031803018	FWD	USDMXN	17/08/2020	(750,000)	24.56	18,423,296
2020031803235	FWD	USDMXN	17/08/2020	(750,000)	24.53	18,400,908
2020052103292	FWD	USDMXN	17/08/2020	25,000	23.19	(579,666)
2020052103198	FWD	USDMXN	17/08/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803545	FWD	USDMXN	17/08/2020	15,930	22.45	(357,616)
2020052903233	FWD	USDMXN	17/08/2020	25,000	22.42	(560,620)
2020052903176	FWD	USDMXN	17/08/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020060803256	FWD	USDMXN	17/08/2020	15,930	21.82	(347,547)
2020061003137	FWD	USDMXN	17/08/2020	(15,930)	22.12	352,423
2020072003224	FWD	USDMXN	17/08/2020	2,100,000	22.65	(47,562,900)
2020072003322	FWD	USDMXN	17/08/2020	(2,100,000)	22.59	47,431,234
2020072103421	FWD	USDMXN	17/08/2020	10,000,000	22.39	(223,920,000)
2020072103422	FWD	USDMXN	17/08/2020	(10,000,000)	22.40	223,966,920
2020072703225	FWD	USDMXN	17/08/2020	150,000	22.07	(3,311,121)
2020073003159	FWD	USDMXN	17/08/2020	97,000	22.14	(2,147,978)
2020073003162	FWD	USDMXN	17/08/2020	78,000	22.14	(1,727,240)
2020073003184	FWD	USDMXN	17/08/2020	(175,000)	22.22	3,889,111
2020073103336	FWD	USDMXN	17/08/2020	24,000	22.20	(532,877)
2020073103338	FWD	USDMXN	17/08/2020	92,000	22.20	(2,042,694)
2020073103339	FWD	USDMXN	17/08/2020	134,000	22.20	(2,975,229)
2020073103424	FWD	USDMXN	17/08/2020	(250,000)	22.24	5,560,466
2020080303219	FWD	USDMXN	17/08/2020	(150,000)	22.62	3,393,529
2020080703127	FWD	USDMXN	17/08/2020	91,500,000	22.47	(2,056,023,300)
2020080703118	FWD	USDMXN	17/08/2020	(91,500,000)	22.54	2,062,153,800
2020081303179	FWD	USDMXN	17/08/2020	50,000,000	22.26	(1,112,750,000)
2020081303323	FWD	USDMXN	17/08/2020	(380,000)	22.17	8,424,699
2020081703132	FWD	USDMXN	17/08/2020	2,000,000	22.07	(44,131,457)
2020081703155	FWD	USDMXN	17/08/2020	(2,000,000)	22.06	44,120,000
2020081703360	FWD	USDMXN	17/08/2020	(2,735,000)	22.13	60,525,550
2019102403077	FWD	USDMXN	18/08/2020	1,036,003	19.91	(20,631,012)
2019102403072	FWD	USDMXN	18/08/2020	(1,036,003)	19.92	20,639,252
2019102503464	FWD	USDMXN	18/08/2020	1,036,003	19.88	(20,596,009)
2019102503457	FWD	USDMXN	18/08/2020	(1,036,003)	19.88	20,600,816
2019121303354	FWD	USDMXN	18/08/2020	2,319,213	19.73	(45,761,150)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019121303234	FWD	USDMXN	18/08/2020	(773,071)	19.69	15,223,082
2019121303238	FWD	USDMXN	18/08/2020	(773,071)	19.67	15,207,621
2019121303241	FWD	USDMXN	18/08/2020	(773,071)	19.66	15,199,890
2020062503418	FWD	USDMXN	18/08/2020	2,000,000	22.82	(45,631,572)
2020062503435	FWD	USDMXN	18/08/2020	100,000	22.83	(2,282,536)
2020062503436	FWD	USDMXN	18/08/2020	1,900,000	22.82	(43,366,922)
2020062503415	FWD	USDMXN	18/08/2020	(2,000,000)	22.82	45,642,000
2020062503434	FWD	USDMXN	18/08/2020	(2,000,000)	22.83	45,663,000
2020071303323	FWD	USDMXN	18/08/2020	38,040	22.67	(862,185)
2020071303325	FWD	USDMXN	18/08/2020	(38,040)	22.72	864,345
2020071603373	FWD	USDMXN	18/08/2020	15,900	22.52	(358,023)
2020071603379	FWD	USDMXN	18/08/2020	(15,900)	22.58	358,990
2020071703125	FWD	USDMXN	18/08/2020	350,500	22.56	(7,907,840)
2020071703418	FWD	USDMXN	18/08/2020	350,500	22.60	(7,921,061)
2020072203304	FWD	USDMXN	18/08/2020	3,100,000	22.43	(69,545,400)
2020072203363	FWD	USDMXN	18/08/2020	(3,000,000)	22.44	67,316,943
2020072203379	FWD	USDMXN	18/08/2020	(100,000)	22.42	2,242,304
2020072303176	FWD	USDMXN	18/08/2020	26,000	22.33	(580,580)
2020072303158	FWD	USDMXN	18/08/2020	(26,000)	22.37	581,629
2020073103342	FWD	USDMXN	18/08/2020	81,000	22.21	(1,798,694)
2020073103343	FWD	USDMXN	18/08/2020	81,000	22.21	(1,798,694)
2020073103345	FWD	USDMXN	18/08/2020	44,000	22.21	(977,068)
2020073103425	FWD	USDMXN	18/08/2020	(206,000)	22.24	4,582,416
2020080503109	FWD	USDMXN	18/08/2020	30,000	22.43	(672,777)
2020080503098	FWD	USDMXN	18/08/2020	(30,000)	22.45	673,350
2020081703325	FWD	USDMXN	18/08/2020	3,000,000	22.15	(66,446,231)
2020081703297	FWD	USDMXN	18/08/2020	(650,000)	22.09	14,355,292
2020081703371	FWD	USDMXN	18/08/2020	(265,000)	22.13	5,865,742
2019082703354	FWD	USDMXN	19/08/2020	(500,000)	21.24	10,619,327
2020031003247	FWD	USDMXN	19/08/2020	(180,000)	21.47	3,865,322
2020031703151	FWD	USDMXN	19/08/2020	(20,000,000)	23.64	472,780,000
2020031703168	FWD	USDMXN	19/08/2020	(5,000,000)	23.67	118,340,000
2020031703171	FWD	USDMXN	19/08/2020	(20,000,000)	23.67	473,360,000
2020031703248	FWD	USDMXN	19/08/2020	(55,000,000)	23.56	1,295,525,000
2020032403318	FWD	USDMXN	19/08/2020	250,000	25.54	(6,385,417)
2020032403393	FWD	USDMXN	19/08/2020	(500,000)	25.47	12,734,667
2020032703192	FWD	USDMXN	19/08/2020	250,000	23.96	(5,990,893)
2020032703340	FWD	USDMXN	19/08/2020	(300,000)	23.89	7,167,458
2020051903251	FWD	USDMXN	19/08/2020	500,000	23.91	(11,957,305)
2020052103587	FWD	USDMXN	19/08/2020	220,000	23.19	(5,101,300)
2020052103553	FWD	USDMXN	19/08/2020	(200,000)	23.08	4,616,920
2020052103574	FWD	USDMXN	19/08/2020	(20,000)	23.08	461,692
2020052203414	FWD	USDMXN	19/08/2020	691,000	23.08	(15,949,371)
2020052203358	FWD	USDMXN	19/08/2020	(691,000)	23.00	15,892,655
2020052503317	FWD	USDMXN	19/08/2020	300,000	22.83	(6,847,523)
2020052703365	FWD	USDMXN	19/08/2020	231,500	22.60	(5,231,746)
2020052703282	FWD	USDMXN	19/08/2020	(231,490)	22.51	5,211,650
2020060803207	FWD	USDMXN	19/08/2020	(10)	21.81	219
2020060903392	FWD	USDMXN	19/08/2020	100,000	22.06	(2,205,685)
2020060903393	FWD	USDMXN	19/08/2020	100,000	22.06	(2,205,685)
2020060903424	FWD	USDMXN	19/08/2020	(200,000)	22.07	4,414,440
2020062903159	FWD	USDMXN	19/08/2020	23,091	23.26	(537,084)
2020062903149	FWD	USDMXN	19/08/2020	(23,091)	23.34	538,833
2020072003139	FWD	USDMXN	19/08/2020	350,500	22.73	(7,968,130)
2020072803261	FWD	USDMXN	19/08/2020	301,208	22.04	(6,637,873)
2020072803123	FWD	USDMXN	19/08/2020	(301,208)	22.39	6,743,144
2020081203156	FWD	USDMXN	19/08/2020	5,000,000	22.34	(111,689,614)
2020081203158	FWD	USDMXN	19/08/2020	2,300,000	22.34	(51,371,312)
2020081203173	FWD	USDMXN	19/08/2020	47,965	22.34	(1,071,424)
2020081203169	FWD	USDMXN	19/08/2020	(7,347,965)	22.35	164,197,628
2020030603313	FWD	USDMXN	20/08/2020	100,000	20.50	(2,050,370)
2020030603364	FWD	USDMXN	20/08/2020	(100,000)	20.66	2,065,714
2020052003307	FWD	USDMXN	20/08/2020	500,000	23.55	(11,774,349)
2020070203162	FWD	USDMXN	20/08/2020	100,000	22.65	(2,265,368)
2020070203093	FWD	USDMXN	20/08/2020	(100,000)	22.82	2,281,620
2020071303027	FWD	USDMXN	20/08/2020	1,000,000	22.50	(22,498,582)
2020071303012	FWD	USDMXN	20/08/2020	(1,000,000)	22.52	22,516,100
2020073103384	FWD	USDMXN	20/08/2020	475,699	22.28	(10,600,000)
2020073103428	FWD	USDMXN	20/08/2020	(475,700)	22.29	10,604,758
2020080403014	FWD	USDMXN	20/08/2020	135,000	22.88	(3,088,800)
2020080403011	FWD	USDMXN	20/08/2020	(135,000)	22.93	3,094,958
2020081803001	FWD	USDMXN	20/08/2020	3,500,000	22.15	(77,525,000)
2020082003088	FWD	USDMXN	20/08/2020	(75,000)	22.18	1,663,430
2019101103157	FWD	USDMXN	21/08/2020	114,000	20.24	(2,307,814)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019101103245	FWD	USDMXN	21/08/2020	660	20.23	(13,344)
2020020503240	FWD	USDMXN	21/08/2020	50,000	19.14	(957,053)
2020020503206	FWD	USDMXN	21/08/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021403430	FWD	USDMXN	21/08/2020	60,000	19.05	(1,142,792)
2020021403426	FWD	USDMXN	21/08/2020	(60,000)	19.06	1,143,672
2020042203044	FWD	USDMXN	21/08/2020	7,000,000	24.98	(174,878,662)
2020042203042	FWD	USDMXN	21/08/2020	(7,000,000)	25.04	175,270,200
2020052003166	FWD	USDMXN	21/08/2020	100,000	23.65	(2,364,828)
2020052003097	FWD	USDMXN	21/08/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052203214	FWD	USDMXN	21/08/2020	250,000	23.09	(5,771,691)
2020052203166	FWD	USDMXN	21/08/2020	(250,000)	23.19	5,798,125
2020061503320	FWD	USDMXN	21/08/2020	689,410	22.39	(15,438,312)
2020061503335	FWD	USDMXN	21/08/2020	5,590	22.43	(125,402)
2020061503331	FWD	USDMXN	21/08/2020	(695,000)	22.42	15,579,935
2020072203388	FWD	USDMXN	21/08/2020	350,000	22.44	(7,853,168)
2020072203397	FWD	USDMXN	21/08/2020	500,000	22.43	(11,212,670)
2020072203401	FWD	USDMXN	21/08/2020	500	22.43	(11,213)
2020072203399	FWD	USDMXN	21/08/2020	(500,000)	22.42	11,209,607
2020073103351	FWD	USDMXN	21/08/2020	134,000	22.21	(2,976,783)
2020073103426	FWD	USDMXN	21/08/2020	(134,000)	22.25	2,981,950
2020081103235	FWD	USDMXN	21/08/2020	2,700,000	22.33	(60,298,035)
2020081103236	FWD	USDMXN	21/08/2020	(2,333,787)	22.34	52,136,812
2020081103249	FWD	USDMXN	21/08/2020	(366,213)	22.35	8,184,760
2020052103295	FWD	USDMXN	24/08/2020	25,000	23.21	(580,228)
2020052103199	FWD	USDMXN	24/08/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803546	FWD	USDMXN	24/08/2020	15,930	22.47	(357,986)
2020052903234	FWD	USDMXN	24/08/2020	25,000	22.45	(561,171)
2020052903178	FWD	USDMXN	24/08/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020060803255	FWD	USDMXN	24/08/2020	15,930	21.84	(347,867)
2020061003139	FWD	USDMXN	24/08/2020	(15,930)	22.15	352,845
2020070603102	FWD	USDMXN	24/08/2020	1,500,000	22.33	(33,502,076)
2020070603271	FWD	USDMXN	24/08/2020	8,800,000	22.48	(197,832,800)
2020070603074	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,500,000)	22.32	33,476,550
2020070603273	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,000,000)	22.49	22,488,163
2020070603274	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,000,000)	22.49	22,488,163
2020070603275	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,000,000)	22.49	22,488,363
2020070603276	FWD	USDMXN	24/08/2020	(800,000)	22.49	17,991,416
2020070603279	FWD	USDMXN	24/08/2020	(5,000,000)	22.48	112,419,685
2020072703166	FWD	USDMXN	24/08/2020	30,000	22.06	(661,927)
2020072703224	FWD	USDMXN	24/08/2020	180,000	22.10	(3,977,154)
2020072703159	FWD	USDMXN	24/08/2020	(30,000)	22.25	667,581
2020080303217	FWD	USDMXN	24/08/2020	(180,000)	22.64	4,075,630
2020080603102	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,000,000)	22.42	22,424,399
2020081403062	FWD	USDMXN	24/08/2020	350,000	22.03	(7,710,996)
2020081403102	FWD	USDMXN	24/08/2020	(350,000)	22.07	7,726,110
2019091203185	FWD	USDMXN	25/08/2020	3,500,000	20.47	(71,629,285)
2019091203188	FWD	USDMXN	25/08/2020	(3,485,000)	20.47	71,327,495
2019091203397	FWD	USDMXN	25/08/2020	(15,000)	20.42	306,368
2019102103283	FWD	USDMXN	25/08/2020	75,891	20.03	(1,520,258)
2019102803087	FWD	USDMXN	25/08/2020	1,036,003	19.87	(20,582,805)
2019102803083	FWD	USDMXN	25/08/2020	(1,036,003)	19.88	20,597,812
2019121603188	FWD	USDMXN	25/08/2020	1,546,142	19.64	(30,369,116)
2019121603181	FWD	USDMXN	25/08/2020	(773,071)	19.66	15,197,416
2019121603182	FWD	USDMXN	25/08/2020	(773,071)	19.64	15,181,955
2020030303193	FWD	USDMXN	25/08/2020	500,000	19.70	(9,851,742)
2020030603323	FWD	USDMXN	25/08/2020	(500,000)	20.76	10,379,938
2020060103369	FWD	USDMXN	25/08/2020	140,000	22.33	(3,126,689)
2020060103320	FWD	USDMXN	25/08/2020	(140,000)	22.31	3,123,792
2020060203464	FWD	USDMXN	25/08/2020	860,000	22.00	(18,921,229)
2020060203506	FWD	USDMXN	25/08/2020	(860,000)	22.04	18,955,862
2020061203368	FWD	USDMXN	25/08/2020	70,000	22.55	(1,578,741)
2020061203350	FWD	USDMXN	25/08/2020	(70,000)	22.56	1,579,445
2020061803277	FWD	USDMXN	25/08/2020	(100,000)	22.90	2,289,624
2020070103398	FWD	USDMXN	25/08/2020	70,000	22.93	(1,605,417)
2020070103361	FWD	USDMXN	25/08/2020	(70,000)	22.95	1,606,213
2020071003250	FWD	USDMXN	25/08/2020	70,000	22.62	(1,583,367)
2020071003338	FWD	USDMXN	25/08/2020	68,916	22.61	(1,558,471)
2020071003233	FWD	USDMXN	25/08/2020	(70,000)	22.63	1,583,911
2020071003351	FWD	USDMXN	25/08/2020	(68,916)	22.66	1,561,879
2020071503361	FWD	USDMXN	25/08/2020	70,000	22.52	(1,576,742)
2020071503334	FWD	USDMXN	25/08/2020	(70,000)	22.53	1,577,415
2020072103185	FWD	USDMXN	25/08/2020	10,000	22.42	(224,160)
2020072103208	FWD	USDMXN	25/08/2020	(10,000)	22.49	224,900
2020072203398	FWD	USDMXN	25/08/2020	18,650	22.44	(418,456)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020072203400	FWD	USDMXN	25/08/2020	(18,650)	22.50	419,662
2020080603281	FWD	USDMXN	25/08/2020	100,000	22.38	(2,238,425)
2020032403319	FWD	USDMXN	26/08/2020	250,000	25.57	(6,391,652)
2020032403394	FWD	USDMXN	26/08/2020	(500,000)	25.49	12,747,127
2020032703193	FWD	USDMXN	26/08/2020	250,000	23.99	(5,996,805)
2020032703341	FWD	USDMXN	26/08/2020	(300,000)	23.92	7,174,761
2020052503325	FWD	USDMXN	26/08/2020	300,000	22.85	(6,854,332)
2020052603241	FWD	USDMXN	26/08/2020	60,000	22.49	(1,349,479)
2020052603177	FWD	USDMXN	26/08/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603283	FWD	USDMXN	26/08/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060903394	FWD	USDMXN	26/08/2020	100,000	22.08	(2,207,709)
2020060903395	FWD	USDMXN	26/08/2020	100,000	22.08	(2,207,709)
2020060903425	FWD	USDMXN	26/08/2020	(200,000)	22.09	4,418,460
2020081403468	FWD	USDMXN	26/08/2020	250,000	22.06	(5,514,999)
2020081403397	FWD	USDMXN	26/08/2020	(250,000)	22.16	5,541,125
2020082603118	FWD	USDMXN	26/08/2020	(260,000)	21.91	5,697,272
2019102103284	FWD	USDMXN	27/08/2020	76,348	20.04	(1,529,840)
2020022803397	FWD	USDMXN	27/08/2020	150,000	20.28	(3,042,450)
2020022803436	FWD	USDMXN	27/08/2020	(150,000)	20.31	3,046,355
2020030603282	FWD	USDMXN	27/08/2020	200,000	20.42	(4,084,000)
2020030603316	FWD	USDMXN	27/08/2020	100,000	20.52	(2,052,090)
2020030603296	FWD	USDMXN	27/08/2020	(200,000)	20.74	4,148,678
2020030603365	FWD	USDMXN	27/08/2020	(100,000)	20.68	2,067,956
2020051903229	FWD	USDMXN	27/08/2020	2,000,000	23.92	(47,843,952)
2020051903267	FWD	USDMXN	27/08/2020	458,032	23.93	(10,961,187)
2020051903268	FWD	USDMXN	27/08/2020	44,149	23.92	(1,056,169)
2020051903207	FWD	USDMXN	27/08/2020	(251,091)	23.95	6,014,338
2020052603288	FWD	USDMXN	27/08/2020	3,563,543	22.61	(80,557,833)
2020070203166	FWD	USDMXN	27/08/2020	100,000	22.68	(2,267,954)
2020071503345	FWD	USDMXN	27/08/2020	1,000,000	22.49	(22,491,883)
2020071503338	FWD	USDMXN	27/08/2020	(1,000,000)	22.51	22,510,700
2020072103232	FWD	USDMXN	27/08/2020	(16,902,857)	22.42	378,948,118
2020072803426	FWD	USDMXN	27/08/2020	350,500	22.02	(7,718,904)
2020072803154	FWD	USDMXN	27/08/2020	(27,099,824)	22.04	597,391,745
2020080403015	FWD	USDMXN	27/08/2020	135,000	22.90	(3,090,825)
2020080403012	FWD	USDMXN	27/08/2020	(135,000)	22.95	3,098,423
2020080603158	FWD	USDMXN	27/08/2020	(100,000)	22.42	2,241,806
2019080603174	FWD	USDMXN	28/08/2020	(250,000)	20.92	5,229,232
2019101103745	FWD	USDMXN	28/08/2020	250,000	20.25	(5,061,757)
2020020503241	FWD	USDMXN	28/08/2020	50,000	19.16	(957,991)
2020020503207	FWD	USDMXN	28/08/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021403431	FWD	USDMXN	28/08/2020	60,000	19.06	(1,143,881)
2020021403427	FWD	USDMXN	28/08/2020	(60,000)	19.08	1,144,800
2020030303036	FWD	USDMXN	28/08/2020	(400,000)	19.99	7,995,725
2020030503162	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	20.30	2,029,874
2020031703164	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	23.63	2,363,028
2020042203156	FWD	USDMXN	28/08/2020	400,000	25.04	(10,016,484)
2020052003167	FWD	USDMXN	28/08/2020	100,000	23.66	(2,366,409)
2020052003108	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052203217	FWD	USDMXN	28/08/2020	250,000	23.11	(5,777,184)
2020052203169	FWD	USDMXN	28/08/2020	(250,000)	23.21	5,803,625
2020082603272	FWD	USDMXN	28/08/2020	13,445,761	21.94	(295,000,000)
2020082603104	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	21.92	2,191,950
2020082603107	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	21.92	2,191,950
2020082603109	FWD	USDMXN	28/08/2020	(100,000)	21.92	2,191,950
2020082603269	FWD	USDMXN	28/08/2020	(350,000)	21.94	7,679,235
2020082603279	FWD	USDMXN	28/08/2020	(10,000,000)	21.94	219,420,000
2020082603284	FWD	USDMXN	28/08/2020	(2,572,987)	21.95	56,477,328
2020031203134	FWD	USDMXN	31/08/2020	100,000	23.01	(2,301,000)
2020031203114	FWD	USDMXN	31/08/2020	(100,000)	22.87	2,287,497
2020031803341	FWD	USDMXN	31/08/2020	100,000	24.61	(2,461,220)
2020031803371	FWD	USDMXN	31/08/2020	(100,000)	24.48	2,447,670
2020051403227	FWD	USDMXN	31/08/2020	30,272,583	24.62	(745,300,000)
2020051403305	FWD	USDMXN	31/08/2020	26,051,244	24.56	(639,891,496)
2020051403204	FWD	USDMXN	31/08/2020	(26,051,244)	24.57	640,000,000
2020051403223	FWD	USDMXN	31/08/2020	(30,252,590)	24.64	745,300,000
2020051403490	FWD	USDMXN	31/08/2020	(19,993)	24.18	483,457
2020052103296	FWD	USDMXN	31/08/2020	25,000	23.23	(580,752)
2020052103200	FWD	USDMXN	31/08/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052503175	FWD	USDMXN	31/08/2020	30,000	22.94	(688,059)
2020052503143	FWD	USDMXN	31/08/2020	(30,000)	22.95	688,563
2020052803547	FWD	USDMXN	31/08/2020	15,930	22.49	(358,329)
2020052803568	FWD	USDMXN	31/08/2020	(15,930)	22.56	359,417
2020052903275	FWD	USDMXN	31/08/2020	25,000	22.47	(561,723)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052903181	FWD	USDMXN	31/08/2020	(25,000)	22.50	562,500
2020060803257	FWD	USDMXN	31/08/2020	15,930	21.86	(348,188)
2020061003141	FWD	USDMXN	31/08/2020	(15,930)	22.18	353,256
2020082403174	FWD	USDMXN	31/08/2020	33,000	22.02	(726,530)
2020082403163	FWD	USDMXN	31/08/2020	(33,000)	22.14	730,458
2020082703006	FWD	USDMXN	31/08/2020	50,000,000	21.93	(1,096,300,000)
2020082703013	FWD	USDMXN	31/08/2020	20,000,000	21.91	(438,276,000)
2020082703015	FWD	USDMXN	31/08/2020	30,000,000	21.92	(657,571,500)
2019101503208	FWD	USDMXN	01/09/2020	1,185,570	20.19	(23,939,812)
2019101503202	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,185,570)	20.20	23,948,514
2019101603104	FWD	USDMXN	01/09/2020	1,185,570	20.17	(23,907,846)
2019101603257	FWD	USDMXN	01/09/2020	2,371,140	20.13	(47,725,315)
2019101603101	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,185,570)	20.18	23,918,875
2019101603249	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,185,570)	20.15	23,886,864
2019101603250	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,185,570)	20.12	23,857,225
2019121103566	FWD	USDMXN	01/09/2020	495,944	19.86	(9,848,752)
2019121103602	FWD	USDMXN	01/09/2020	495,944	19.84	(9,838,936)
2019121103556	FWD	USDMXN	01/09/2020	(495,944)	19.87	9,851,928
2019121103599	FWD	USDMXN	01/09/2020	(495,944)	19.85	9,842,009
2019121303350	FWD	USDMXN	01/09/2020	495,944	19.76	(9,800,504)
2019121303242	FWD	USDMXN	01/09/2020	(495,944)	19.81	9,824,601
2020050603095	FWD	USDMXN	01/09/2020	(75,000)	24.74	1,855,836
2020071403426	FWD	USDMXN	01/09/2020	30,000	22.63	(678,815)
2020071403419	FWD	USDMXN	01/09/2020	(30,000)	22.64	679,110
2020072903365	FWD	USDMXN	01/09/2020	16,050	22.05	(353,907)
2020072903371	FWD	USDMXN	01/09/2020	(16,050)	22.12	355,026
2020073003160	FWD	USDMXN	01/09/2020	66,400	22.22	(1,475,287)
2020073003402	FWD	USDMXN	01/09/2020	16,100	22.17	(356,950)
2020073003017	FWD	USDMXN	01/09/2020	(66,400)	22.30	1,480,554
2020073003412	FWD	USDMXN	01/09/2020	(16,100)	22.25	358,209
2020080303054	FWD	USDMXN	01/09/2020	15,450	22.69	(350,535)
2020080303207	FWD	USDMXN	01/09/2020	32,200	22.67	(729,942)
2020080303273	FWD	USDMXN	01/09/2020	23,000	22.67	(521,357)
2020080303319	FWD	USDMXN	01/09/2020	380,000	22.71	(8,628,503)
2020080303058	FWD	USDMXN	01/09/2020	(15,450)	22.77	351,781
2020080303212	FWD	USDMXN	01/09/2020	(32,200)	22.74	732,325
2020080303236	FWD	USDMXN	01/09/2020	(23,000)	22.68	521,663
2020080503165	FWD	USDMXN	01/09/2020	83,000	22.50	(1,867,818)
2020080503145	FWD	USDMXN	01/09/2020	(83,000)	22.52	1,868,961
2020080703240	FWD	USDMXN	01/09/2020	2,000,000	22.45	(44,898,580)
2020080703251	FWD	USDMXN	01/09/2020	1,000,000	22.46	(22,460,904)
2020080703255	FWD	USDMXN	01/09/2020	2,000,000	22.44	(44,888,564)
2020080703233	FWD	USDMXN	01/09/2020	(2,000,000)	22.45	44,904,000
2020080703243	FWD	USDMXN	01/09/2020	(2,000,000)	22.46	44,912,000
2020080703245	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,000,000)	22.47	22,465,000
2020082003089	FWD	USDMXN	01/09/2020	75,000	22.21	(1,665,957)
2020082803261	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,500,000)	21.85	32,777,025
2020082803299	FWD	USDMXN	01/09/2020	(150,000)	21.87	3,280,706
2020082803301	FWD	USDMXN	01/09/2020	(150,000)	21.87	3,280,421
2020082803303	FWD	USDMXN	01/09/2020	(150,000)	21.87	3,280,533
2020082803305	FWD	USDMXN	01/09/2020	(150,000)	21.87	3,280,533
2020083103284	FWD	USDMXN	01/09/2020	2,000,000	21.94	(43,870,000)
2020083103288	FWD	USDMXN	01/09/2020	2,000,000	21.94	(43,870,000)
2020083103317	FWD	USDMXN	01/09/2020	(4,000,000)	21.94	87,740,460
2020090103130	FWD	USDMXN	01/09/2020	(100,000)	21.74	2,173,699
2020022803267	FWD	USDMXN	02/09/2020	(180,000)	20.34	3,661,007
2020030903237	FWD	USDMXN	02/09/2020	(420,000)	21.83	9,168,456
2020031003248	FWD	USDMXN	02/09/2020	(180,000)	21.53	3,874,539
2020032703342	FWD	USDMXN	02/09/2020	(300,000)	23.94	7,181,923
2020052503329	FWD	USDMXN	02/09/2020	300,000	22.87	(6,860,913)
2020052603242	FWD	USDMXN	02/09/2020	60,000	22.51	(1,350,678)
2020052603377	FWD	USDMXN	02/09/2020	250,000	22.81	(5,703,187)
2020052603180	FWD	USDMXN	02/09/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603285	FWD	USDMXN	02/09/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060903396	FWD	USDMXN	02/09/2020	100,000	22.10	(2,209,733)
2020060903397	FWD	USDMXN	02/09/2020	100,000	22.10	(2,209,733)
2020060903426	FWD	USDMXN	02/09/2020	(200,000)	22.11	4,422,500
2020061803267	FWD	USDMXN	02/09/2020	(250,000)	22.94	5,734,223
2020080403116	FWD	USDMXN	02/09/2020	380,000	22.85	(8,684,771)
2020080403117	FWD	USDMXN	02/09/2020	380,000	22.87	(8,690,492)
2020081403086	FWD	USDMXN	02/09/2020	180,000	22.10	(3,977,747)
2020081403466	FWD	USDMXN	02/09/2020	250,000	22.08	(5,519,787)
2020081403111	FWD	USDMXN	02/09/2020	(180,000)	22.15	3,986,640
2020081403402	FWD	USDMXN	02/09/2020	(250,000)	22.18	5,545,975

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020082803553	FWD	USDMXN	02/09/2020	103,218	21.88	(2,258,749)
2020082803247	FWD	USDMXN	02/09/2020	(4,729,548)	21.85	103,328,790
2020083103257	FWD	USDMXN	02/09/2020	(350,000)	21.93	7,674,674
2020083103408	FWD	USDMXN	02/09/2020	(29,500)	21.87	645,030
2020030903073	FWD	USDMXN	03/09/2020	100,000	20.78	(2,078,360)
2020030903051	FWD	USDMXN	03/09/2020	(100,000)	20.90	2,090,270
2020070203144	FWD	USDMXN	03/09/2020	100,000	22.79	(2,278,510)
2020070203100	FWD	USDMXN	03/09/2020	(100,000)	22.81	2,280,780
2020070603111	FWD	USDMXN	03/09/2020	150,000	22.40	(3,359,573)
2020070603089	FWD	USDMXN	03/09/2020	(150,000)	22.42	3,363,345
2020072203187	FWD	USDMXN	03/09/2020	1,000,000	22.35	(22,346,073)
2020072203173	FWD	USDMXN	03/09/2020	(1,000,000)	22.38	22,379,400
2020080503037	FWD	USDMXN	03/09/2020	380,000	22.54	(8,566,426)
2020080503114	FWD	USDMXN	03/09/2020	380,000	22.49	(8,547,086)
2020082503333	FWD	USDMXN	03/09/2020	34,000	21.90	(744,500)
2020082503330	FWD	USDMXN	03/09/2020	(34,000)	21.96	746,739
2020082803554	FWD	USDMXN	03/09/2020	82,484	21.89	(1,805,249)
2020082803555	FWD	USDMXN	03/09/2020	23,735	21.89	(519,466)
2020082803557	FWD	USDMXN	03/09/2020	82,484	21.89	(1,805,249)
2020082803759	FWD	USDMXN	03/09/2020	250,000	21.80	(5,449,188)
2020082803210	FWD	MXNUSD	03/09/2020	20,261,145	21.85	(927,293)
2020082803245	FWD	USDMXN	03/09/2020	(3,801,305)	21.85	83,067,646
2020082803620	FWD	USDMXN	03/09/2020	(82,484)	21.81	1,798,907
2020090103457	FWD	USDMXN	03/09/2020	(350,000)	21.82	7,637,480
2020090303194	FWD	USDMXN	03/09/2020	(200,000)	21.62	4,324,284
2020010903017	FWD	USDMXN	04/09/2020	365,200	19.44	(7,097,822)
2020010903072	FWD	USDMXN	04/09/2020	(365,200)	19.45	7,102,154
2020020503242	FWD	USDMXN	04/09/2020	50,000	19.18	(958,929)
2020020503208	FWD	USDMXN	04/09/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021703109	FWD	USDMXN	04/09/2020	490,000	19.09	(9,355,779)
2020031803171	FWD	USDMXN	04/09/2020	490,000	24.32	(11,917,738)
2020031803310	FWD	USDMXN	04/09/2020	666,667	24.41	(16,270,600)
2020031803019	FWD	USDMXN	04/09/2020	(490,000)	24.63	12,068,608
2020031803237	FWD	USDMXN	04/09/2020	(490,000)	24.60	12,056,437
2020031903129	FWD	USDMXN	04/09/2020	(666,667)	24.86	16,573,737
2020031903317	FWD	USDMXN	04/09/2020	(666,667)	24.73	16,485,486
2020032603227	FWD	USDMXN	04/09/2020	1,333,334	23.71	(31,619,833)
2020032603529	FWD	USDMXN	04/09/2020	500,000	23.75	(11,874,164)
2020032603176	FWD	USDMXN	04/09/2020	(666,667)	23.75	15,831,110
2020040603075	FWD	USDMXN	04/09/2020	(500,000)	25.36	12,678,434
2020040703162	FWD	USDMXN	04/09/2020	500,000	24.56	(12,279,799)
2020040703152	FWD	USDMXN	04/09/2020	(500,000)	24.70	12,351,600
2020050703235	FWD	USDMXN	04/09/2020	74,760	24.38	(1,822,931)
2020050703209	FWD	USDMXN	04/09/2020	(74,760)	24.39	1,823,561
2020051903051	FWD	USDMXN	04/09/2020	60,000	23.86	(1,431,667)
2020051903039	FWD	USDMXN	04/09/2020	(60,000)	23.88	1,432,866
2020052003168	FWD	USDMXN	04/09/2020	100,000	23.68	(2,368,366)
2020052003119	FWD	USDMXN	04/09/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052803429	FWD	USDMXN	04/09/2020	250,000	22.46	(5,614,485)
2020052803354	FWD	USDMXN	04/09/2020	(250,000)	22.56	5,640,950
2020071503060	FWD	USDMXN	04/09/2020	100,000	22.48	(2,247,881)
2020071503357	FWD	USDMXN	04/09/2020	84,000	22.55	(1,894,550)
2020071503054	FWD	USDMXN	04/09/2020	(100,000)	22.52	2,252,000
2020071503343	FWD	USDMXN	04/09/2020	(84,000)	22.56	1,895,351
2020072103147	FWD	USDMXN	04/09/2020	80,000	22.50	(1,799,825)
2020072103149	FWD	USDMXN	04/09/2020	4,000	22.46	(89,820)
2020072103130	FWD	USDMXN	04/09/2020	(84,000)	22.51	1,890,647
2020080403322	FWD	USDMXN	04/09/2020	(260,000)	22.94	5,964,138
2020080603246	FWD	USDMXN	04/09/2020	760,000	22.41	(17,031,372)
2020082503040	FWD	USDMXN	04/09/2020	170,000	21.97	(3,734,437)
2020082503035	FWD	USDMXN	04/09/2020	(170,000)	22.03	3,745,423
2020082603119	FWD	USDMXN	04/09/2020	260,000	21.94	(5,704,000)
2020082803293	FWD	USDMXN	04/09/2020	84,000	21.86	(1,836,111)
2020082803556	FWD	USDMXN	04/09/2020	120,395	21.89	(2,635,305)
2020082803206	FWD	MXNUSD	04/09/2020	103,328,790	21.86	(4,727,232)
2020082803285	FWD	USDMXN	04/09/2020	(84,000)	21.87	1,836,744
2020090203321	FWD	USDMXN	04/09/2020	(53,000)	21.73	1,151,588
2020090403182	FWD	USDMXN	04/09/2020	(250,000)	21.59	5,398,454
2020090403184	FWD	USDMXN	04/09/2020	(149,000)	21.60	3,219,095
2019101703171	FWD	USDMXN	08/09/2020	1,185,570	20.08	(23,810,946)
2019101703159	FWD	USDMXN	08/09/2020	(1,185,570)	20.09	23,822,251
2019101803383	FWD	USDMXN	08/09/2020	1,185,570	20.06	(23,777,616)
2019101803380	FWD	USDMXN	08/09/2020	(1,185,570)	20.06	23,787,039
2019102203063	FWD	USDMXN	08/09/2020	1,185,570	20.02	(23,731,703)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2019102203060	FWD	USDMXN	08/09/2020	(1,185,570)	20.03	23,744,596
2019121303345	FWD	USDMXN	08/09/2020	1,487,832	19.78	(29,430,061)
2019121303246	FWD	USDMXN	08/09/2020	(495,944)	19.81	9,824,403
2019121303250	FWD	USDMXN	08/09/2020	(495,944)	19.79	9,814,484
2019121303253	FWD	USDMXN	08/09/2020	(495,944)	19.77	9,804,565
2020031803195	FWD	USDMXN	08/09/2020	(168,530)	24.34	4,102,448
2020052103298	FWD	USDMXN	08/09/2020	25,000	23.25	(581,333)
2020052103205	FWD	USDMXN	08/09/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803548	FWD	USDMXN	08/09/2020	15,930	22.52	(358,788)
2020052803570	FWD	USDMXN	08/09/2020	(15,930)	22.59	359,792
2020060803258	FWD	USDMXN	08/09/2020	15,930	21.88	(348,555)
2020061003148	FWD	USDMXN	08/09/2020	(15,930)	22.20	353,678
2020080303068	FWD	USDMXN	08/09/2020	6,000,000	22.70	(136,202,490)
2020080303072	FWD	USDMXN	08/09/2020	(6,000,000)	22.71	136,254,000
2020080403397	FWD	USDMXN	08/09/2020	40,000	22.81	(912,554)
2020080403398	FWD	USDMXN	08/09/2020	(40,000)	22.89	915,440
2020080703124	FWD	USDMXN	08/09/2020	760,000	22.60	(17,176,917)
2020081403090	FWD	USDMXN	08/09/2020	350,000	22.12	(7,741,428)
2020081403117	FWD	USDMXN	08/09/2020	(350,000)	22.16	7,757,365
2020082403166	FWD	USDMXN	08/09/2020	50,000	22.00	(1,099,753)
2020082403143	FWD	USDMXN	08/09/2020	(50,000)	22.06	1,102,910
2020082703438	FWD	USDMXN	08/09/2020	123,000	22.09	(2,716,947)
2020082703439	FWD	USDMXN	08/09/2020	85,000	22.09	(1,877,565)
2020082703440	FWD	USDMXN	08/09/2020	82,000	22.09	(1,811,298)
2020082703443	FWD	USDMXN	08/09/2020	71,000	22.09	(1,568,319)
2020082703453	FWD	USDMXN	08/09/2020	123,000	22.09	(2,716,947)
2020082703456	FWD	USDMXN	08/09/2020	86,000	22.09	(1,899,654)
2020082703457	FWD	USDMXN	08/09/2020	70,000	22.09	(1,546,230)
2020082703479	FWD	USDMXN	08/09/2020	(640,000)	22.15	14,177,611
2020082803300	FWD	USDMXN	08/09/2020	150,000	21.89	(3,283,646)
2020082803561	FWD	USDMXN	08/09/2020	96,595	21.90	(2,115,422)
2020082803563	FWD	USDMXN	08/09/2020	33,306	21.90	(729,399)
2020082803168	FWD	USDMXN	08/09/2020	(150,000)	21.89	3,282,840
2020082803199	FWD	MXNUSD	08/09/2020	74,173,419	21.87	(3,391,092)
2020082803202	FWD	MXNUSD	08/09/2020	29,155,371	21.87	(1,333,005)
2020090103385	FWD	USDMXN	08/09/2020	105,000	21.74	(2,282,882)
2020090703092	FWD	USDMXN	08/09/2020	6,000,000	21.60	(129,600,000)
2020090703096	FWD	USDMXN	08/09/2020	(6,000,000)	21.60	129,608,760
2020020403140	FWD	USDMXN	09/09/2020	100,000	19.26	(1,925,826)
2020020403283	FWD	USDMXN	09/09/2020	(100,000)	19.28	1,928,164
2020031203067	FWD	USDMXN	09/09/2020	(150,000)	22.72	3,407,363
2020052603243	FWD	USDMXN	09/09/2020	60,000	22.53	(1,351,839)
2020052603181	FWD	USDMXN	09/09/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603289	FWD	USDMXN	09/09/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060203284	FWD	USDMXN	09/09/2020	555,000	21.99	(12,207,199)
2020060203293	FWD	USDMXN	09/09/2020	(500,000)	22.11	11,056,450
2020060203320	FWD	USDMXN	09/09/2020	(50,000)	22.11	1,105,645
2020060203336	FWD	USDMXN	09/09/2020	(5,000)	22.11	110,565
2020060903398	FWD	USDMXN	09/09/2020	100,000	22.12	(2,211,757)
2020060903399	FWD	USDMXN	09/09/2020	100,000	22.12	(2,211,757)
2020060903427	FWD	USDMXN	09/09/2020	(200,000)	22.13	4,426,540
2020070603105	FWD	USDMXN	09/09/2020	500,000	22.38	(11,190,661)
2020070603076	FWD	USDMXN	09/09/2020	(500,000)	22.32	11,158,850
2020071303317	FWD	USDMXN	09/09/2020	150,000	22.73	(3,409,462)
2020081003239	FWD	USDMXN	09/09/2020	380,000	22.51	(8,554,873)
2020081403476	FWD	USDMXN	09/09/2020	250,000	22.10	(5,524,571)
2020081403488	FWD	USDMXN	09/09/2020	1,300,000	22.09	(28,711,487)
2020081403404	FWD	USDMXN	09/09/2020	(250,000)	22.20	5,551,175
2020082803560	FWD	USDMXN	09/09/2020	133,839	21.90	(2,931,425)
2020082803562	FWD	USDMXN	09/09/2020	30,962	21.90	(678,149)
2020082803564	FWD	USDMXN	09/09/2020	115,264	21.90	(2,524,583)
2020082803187	FWD	MXNUSD	09/09/2020	79,434,564	21.87	(3,632,180)
2020082803189	FWD	MXNUSD	09/09/2020	23,894,227	21.87	(1,092,372)
2020082803196	FWD	MXNUSD	09/09/2020	103,328,790	21.88	(4,723,297)
2020090403434	FWD	USDMXN	09/09/2020	(100,000)	21.55	2,154,579
2020090703059	FWD	USDMXN	09/09/2020	(4,789,283)	21.60	103,434,155
2020090703206	FWD	USDMXN	09/09/2020	(29,500)	21.59	636,766
2020090703208	FWD	USDMXN	09/09/2020	(29,000)	21.59	625,973
2019112903470	FWD	USDMXN	10/09/2020	104,952	20.38	(2,138,994)
2020022803447	FWD	USDMXN	10/09/2020	(230,000)	20.41	4,693,443
2020030303192	FWD	USDMXN	10/09/2020	500,000	19.75	(9,875,301)
2020030603330	FWD	USDMXN	10/09/2020	(500,000)	20.81	10,403,325
2020030903077	FWD	USDMXN	10/09/2020	100,000	20.81	(2,080,600)
2020030903048	FWD	USDMXN	10/09/2020	(100,000)	20.93	2,092,509

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020042703066	FWD	USDMXN	10/09/2020	(29,500)	25.33	747,194
2020070203143	FWD	USDMXN	10/09/2020	100,000	22.81	(2,280,566)
2020070203556	FWD	USDMXN	10/09/2020	(100,000)	22.83	2,282,830
2020070603112	FWD	USDMXN	10/09/2020	150,000	22.42	(3,362,606)
2020070603090	FWD	USDMXN	10/09/2020	(150,000)	22.44	3,366,390
2020071003251	FWD	USDMXN	10/09/2020	70,000	22.67	(1,586,755)
2020071003234	FWD	USDMXN	10/09/2020	(70,000)	22.68	1,587,299
2020071503358	FWD	USDMXN	10/09/2020	210,000	22.57	(4,740,069)
2020071503337	FWD	USDMXN	10/09/2020	(210,000)	22.58	4,742,052
2020071703138	FWD	USDMXN	10/09/2020	105,000	22.62	(2,375,407)
2020071703136	FWD	USDMXN	10/09/2020	(105,000)	22.63	2,376,150
2020072103145	FWD	USDMXN	10/09/2020	210,000	22.52	(4,728,225)
2020072103119	FWD	USDMXN	10/09/2020	(210,000)	22.53	4,730,271
2020072203188	FWD	USDMXN	10/09/2020	1,000,000	22.39	(22,386,021)
2020072203177	FWD	USDMXN	10/09/2020	(1,000,000)	22.38	22,380,500
2020072403443	FWD	USDMXN	10/09/2020	105,000	22.48	(2,360,824)
2020072403417	FWD	USDMXN	10/09/2020	(105,000)	22.49	2,361,524
2020081103262	FWD	USDMXN	10/09/2020	380,000	22.47	(8,537,684)
2020082703468	FWD	USDMXN	10/09/2020	20,000	22.10	(441,900)
2020082703472	FWD	USDMXN	10/09/2020	122,000	22.10	(2,695,590)
2020082703474	FWD	USDMXN	10/09/2020	81,000	22.10	(1,789,695)
2020082703478	FWD	USDMXN	10/09/2020	94,000	22.10	(2,076,930)
2020082703481	FWD	USDMXN	10/09/2020	(317,000)	22.16	7,024,088
2020082803302	FWD	USDMXN	10/09/2020	150,000	21.89	(3,284,175)
2020082803569	FWD	USDMXN	10/09/2020	149,297	21.91	(3,270,400)
2020082803758	FWD	USDMXN	10/09/2020	250,000	21.82	(5,454,001)
2020082803174	FWD	USDMXN	10/09/2020	(150,000)	21.89	3,283,650
2020082803185	FWD	MXNUSD	10/09/2020	103,328,790	21.88	(4,723,265)
2020083103376	FWD	USDMXN	10/09/2020	15,930	21.91	(349,106)
2020083103409	FWD	USDMXN	10/09/2020	29,500	21.89	(645,688)
2020083103377	FWD	USDMXN	10/09/2020	(15,930)	21.96	349,823
2020090103541	FWD	USDMXN	10/09/2020	34,000	21.70	(737,718)
2020090103536	FWD	USDMXN	10/09/2020	(34,000)	21.80	741,254
2020091003139	FWD	USDMXN	10/09/2020	150,000	21.26	(3,188,637)
2020091003141	FWD	USDMXN	10/09/2020	300,000	21.26	(6,377,019)
2019121703410	FWD	USDMXN	11/09/2020	1,000,000	19.63	(19,625,899)
2019121703422	FWD	USDMXN	11/09/2020	(1,000,000)	19.64	19,639,200
2020020403284	FWD	USDMXN	11/09/2020	100,000	19.29	(1,928,893)
2020020403145	FWD	USDMXN	11/09/2020	(100,000)	19.34	1,934,100
2020020503243	FWD	USDMXN	11/09/2020	50,000	19.20	(959,874)
2020020503209	FWD	USDMXN	11/09/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021203453	FWD	USDMXN	11/09/2020	168,300	19.18	(3,227,391)
2020021203428	FWD	USDMXN	11/09/2020	(168,300)	19.19	3,229,761
2020032603531	FWD	USDMXN	11/09/2020	500,000	23.77	(11,886,830)
2020040603084	FWD	USDMXN	11/09/2020	(500,000)	25.39	12,696,894
2020040703163	FWD	USDMXN	11/09/2020	500,000	24.58	(12,291,038)
2020040703153	FWD	USDMXN	11/09/2020	(500,000)	24.70	12,351,600
2020051903050	FWD	USDMXN	11/09/2020	60,000	23.88	(1,432,911)
2020051903044	FWD	USDMXN	11/09/2020	(60,000)	23.94	1,436,286
2020052003169	FWD	USDMXN	11/09/2020	100,000	23.71	(2,370,536)
2020052003116	FWD	USDMXN	11/09/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052803431	FWD	USDMXN	11/09/2020	250,000	22.48	(5,619,512)
2020052803359	FWD	USDMXN	11/09/2020	(250,000)	22.58	5,646,100
2020061803409	FWD	USDMXN	11/09/2020	(100,000)	23.01	2,300,884
2020071503062	FWD	USDMXN	11/09/2020	50,000	22.50	(1,124,987)
2020071503055	FWD	USDMXN	11/09/2020	(50,000)	22.52	1,126,000
2020073003404	FWD	USDMXN	11/09/2020	(147,527)	22.20	3,274,572
2020081203154	FWD	USDMXN	11/09/2020	380,000	22.41	(8,515,481)
2020082003398	FWD	USDMXN	11/09/2020	(194,981)	22.18	4,324,992
2020082603105	FWD	USDMXN	11/09/2020	100,000	21.96	(2,195,929)
2020082603031	FWD	USDMXN	11/09/2020	(100,000)	21.99	2,199,440
2020082703487	FWD	USDMXN	11/09/2020	49,000	22.10	(1,082,802)
2020082703480	FWD	USDMXN	11/09/2020	(49,000)	22.16	1,085,877
2020082803570	FWD	USDMXN	11/09/2020	13,084	21.91	(286,645)
2020082803571	FWD	USDMXN	11/09/2020	152,008	21.91	(3,330,197)
2020082803179	FWD	MXNUSD	11/09/2020	94,246,085	21.86	(4,310,729)
2020082803182	FWD	MXNUSD	11/09/2020	9,082,706	21.87	(415,320)
2020090103082	FWD	USDMXN	11/09/2020	300,000	21.73	(6,519,774)
2020090103131	FWD	USDMXN	11/09/2020	100,000	21.76	(2,176,493)
2020090103054	FWD	USDMXN	11/09/2020	(300,000)	21.80	6,540,630
2020091103068	FWD	USDMXN	11/09/2020	(1,000,000)	21.30	21,300,669
2020031903387	FWD	USDMXN	14/09/2020	(53,000)	25.00	1,325,065
2020052103318	FWD	USDMXN	14/09/2020	25,000	23.27	(581,769)
2020052103210	FWD	USDMXN	14/09/2020	(25,000)	23.31	582,713

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052803549	FWD	USDMXN	14/09/2020	15,930	22.54	(359,068)
2020052803573	FWD	USDMXN	14/09/2020	(15,930)	22.60	360,072
2020060803259	FWD	USDMXN	14/09/2020	15,930	21.90	(348,812)
2020061003152	FWD	USDMXN	14/09/2020	(15,930)	22.21	353,793
2020061603262	FWD	USDMXN	14/09/2020	3,500,000	22.48	(78,691,466)
2020061603275	FWD	USDMXN	14/09/2020	33,622	22.50	(756,476)
2020071403213	FWD	USDMXN	14/09/2020	1,672,000	22.77	(38,076,270)
2020071403398	FWD	USDMXN	14/09/2020	347	22.66	(7,860)
2020071403401	FWD	USDMXN	14/09/2020	347	22.67	(7,862)
2020071403407	FWD	USDMXN	14/09/2020	(347)	22.66	7,857
2020072103227	FWD	USDMXN	14/09/2020	1,940,000	22.47	(43,599,680)
2020072103243	FWD	USDMXN	14/09/2020	685	22.49	(15,404)
2020080403311	FWD	USDMXN	14/09/2020	(10,000,000)	22.89	228,923,890
2020080403312	FWD	USDMXN	14/09/2020	(66,416)	22.92	1,522,424
2020081103185	FWD	USDMXN	14/09/2020	(10,000,000)	22.38	223,820,931
2020081303103	FWD	USDMXN	14/09/2020	380,000	22.39	(8,506,777)
2020081303328	FWD	USDMXN	14/09/2020	380,000	22.25	(8,454,544)
2020081403337	FWD	USDMXN	14/09/2020	200,000	22.08	(4,416,594)
2020081403347	FWD	USDMXN	14/09/2020	(200,000)	22.14	4,427,500
2020082503057	FWD	USDMXN	14/09/2020	5,000,000	22.03	(110,152,400)
2020082503067	FWD	USDMXN	14/09/2020	2,923,088	22.02	(64,374,363)
2020082803572	FWD	USDMXN	14/09/2020	140,664	21.92	(3,082,815)
2020082803576	FWD	USDMXN	14/09/2020	26,459	21.92	(579,880)
2020082803166	FWD	MXNUSD	14/09/2020	15,178,439	21.89	(693,536)
2020082803175	FWD	MXNUSD	14/09/2020	88,150,351	21.87	(4,030,077)
2020090203313	FWD	USDMXN	14/09/2020	143,000	21.83	(3,121,776)
2020090203322	FWD	USDMXN	14/09/2020	53,000	21.76	(1,153,057)
2020090203158	FWD	USDMXN	14/09/2020	(143,000)	21.85	3,124,493
2019101703606	FWD	USDMXN	15/09/2020	219,000	20.17	(4,417,957)
2019102403076	FWD	USDMXN	15/09/2020	1,185,570	19.99	(23,694,672)
2019102403074	FWD	USDMXN	15/09/2020	(1,185,570)	19.99	23,704,287
2019102503465	FWD	USDMXN	15/09/2020	1,185,570	19.95	(23,656,887)
2019102503458	FWD	USDMXN	15/09/2020	(1,185,570)	19.96	23,663,622
2019112903472	FWD	USDMXN	15/09/2020	85,344	20.40	(1,740,615)
2019121303340	FWD	USDMXN	15/09/2020	1,487,832	19.80	(29,460,677)
2019121303255	FWD	USDMXN	15/09/2020	(495,944)	19.77	9,804,565
2019121303265	FWD	USDMXN	15/09/2020	(495,944)	19.75	9,794,646
2019121303268	FWD	USDMXN	15/09/2020	(495,944)	19.74	9,789,687
2020022803556	FWD	USDMXN	15/09/2020	100,000	20.48	(2,047,520)
2020022803520	FWD	USDMXN	15/09/2020	(100,000)	20.47	2,046,929
2020030603510	FWD	USDMXN	15/09/2020	100,000	20.75	(2,075,110)
2020030603501	FWD	USDMXN	15/09/2020	(100,000)	20.81	2,081,136
2020030903350	FWD	USDMXN	15/09/2020	100,000	22.06	(2,205,870)
2020030903278	FWD	USDMXN	15/09/2020	(100,000)	21.92	2,192,178
2020032403173	FWD	USDMXN	15/09/2020	200,000	25.58	(5,116,000)
2020032403171	FWD	USDMXN	15/09/2020	(200,000)	25.68	5,136,045
2020052103267	FWD	USDMXN	15/09/2020	200,000	23.25	(4,649,034)
2020052103320	FWD	USDMXN	15/09/2020	100,000	23.31	(2,331,249)
2020052103072	FWD	USDMXN	15/09/2020	(200,000)	23.34	4,668,900
2020052103223	FWD	USDMXN	15/09/2020	(100,000)	23.43	2,342,730
2020060503209	FWD	USDMXN	15/09/2020	30,000	22.05	(661,458)
2020060503072	FWD	USDMXN	15/09/2020	(30,000)	22.10	663,060
2020072003232	FWD	USDMXN	15/09/2020	22,000	22.74	(500,277)
2020072003229	FWD	USDMXN	15/09/2020	(22,000)	22.76	500,678
2020072803332	FWD	USDMXN	15/09/2020	18,000	22.10	(397,833)
2020072803306	FWD	USDMXN	15/09/2020	(18,000)	22.12	398,158
2020080703299	FWD	USDMXN	15/09/2020	54,000	22.49	(1,214,407)
2020080703287	FWD	USDMXN	15/09/2020	(54,000)	22.50	1,214,973
2020081003203	FWD	USDMXN	15/09/2020	3,000,000	22.53	(67,579,467)
2020081003201	FWD	USDMXN	15/09/2020	(3,000,000)	22.53	67,599,000
2020081303324	FWD	USDMXN	15/09/2020	380,000	22.25	(8,456,238)
2020081303478	FWD	USDMXN	15/09/2020	17,100	22.26	(380,727)
2020081303329	FWD	USDMXN	15/09/2020	(380,000)	22.25	8,455,217
2020081303479	FWD	USDMXN	15/09/2020	(17,100)	22.33	381,758
2020081403475	FWD	USDMXN	15/09/2020	250,000	22.11	(5,528,656)
2020081403419	FWD	USDMXN	15/09/2020	(250,000)	22.22	5,554,875
2020082103004	FWD	USDMXN	15/09/2020	28,400	22.18	(629,837)
2020082103006	FWD	USDMXN	15/09/2020	(28,400)	22.27	632,553
2020082403165	FWD	USDMXN	15/09/2020	50,000	22.01	(1,100,747)
2020082403140	FWD	USDMXN	15/09/2020	(50,000)	22.08	1,103,905
2020082803575	FWD	USDMXN	15/09/2020	179,524	21.92	(3,934,966)
2020082803160	FWD	MXNUSD	15/09/2020	103,328,790	21.89	(4,720,491)
2020091103028	FWD	USDMXN	15/09/2020	(50,000,000)	21.25	1,062,450,000
2020091103082	FWD	USDMXN	15/09/2020	(50,000,000)	21.33	1,066,570,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020091403242	FWD	USDMXN	15/09/2020	3,000,000	21.12	(63,360,000)
2020091403247	FWD	USDMXN	15/09/2020	(3,000,000)	21.09	63,276,930
2019121603484	FWD	USDMXN	17/09/2020	750,000	19.71	(14,780,388)
2020030903078	FWD	USDMXN	17/09/2020	100,000	20.82	(2,081,800)
2020030903050	FWD	USDMXN	17/09/2020	(100,000)	20.95	2,094,721
2020031803170	FWD	USDMXN	17/09/2020	750,000	24.37	(18,276,024)
2020031803311	FWD	USDMXN	17/09/2020	666,667	24.46	(16,304,800)
2020031803020	FWD	USDMXN	17/09/2020	(750,000)	24.68	18,507,725
2020031803239	FWD	USDMXN	17/09/2020	(750,000)	24.66	18,496,542
2020031903131	FWD	USDMXN	17/09/2020	(666,667)	24.88	16,583,888
2020031903318	FWD	USDMXN	17/09/2020	(666,667)	24.77	16,513,110
2020032603180	FWD	USDMXN	17/09/2020	666,667	23.77	(15,849,413)
2020052603244	FWD	USDMXN	17/09/2020	60,000	22.55	(1,353,165)
2020052603183	FWD	USDMXN	17/09/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603290	FWD	USDMXN	17/09/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060203285	FWD	USDMXN	17/09/2020	555,000	22.02	(12,219,948)
2020060203298	FWD	USDMXN	17/09/2020	(500,000)	22.11	11,056,450
2020060203321	FWD	USDMXN	17/09/2020	(50,000)	22.11	1,105,645
2020060203338	FWD	USDMXN	17/09/2020	(5,000)	22.11	110,565
2020060903400	FWD	USDMXN	17/09/2020	100,000	22.14	(2,213,916)
2020060903401	FWD	USDMXN	17/09/2020	100,000	22.14	(2,213,916)
2020060903428	FWD	USDMXN	17/09/2020	(200,000)	22.16	4,431,040
2020061503323	FWD	USDMXN	17/09/2020	889,462	22.49	(20,000,000)
2020061503336	FWD	USDMXN	17/09/2020	10,538	22.51	(237,258)
2020061503327	FWD	USDMXN	17/09/2020	(900,000)	22.49	20,241,015
2020070203145	FWD	USDMXN	17/09/2020	100,000	22.83	(2,282,549)
2020070203102	FWD	USDMXN	17/09/2020	(100,000)	22.85	2,284,810
2020072703232	FWD	USDMXN	17/09/2020	1,000,000	22.30	(22,303,119)
2020072703385	FWD	USDMXN	17/09/2020	500,000	22.13	(11,064,847)
2020072703188	FWD	USDMXN	17/09/2020	(1,000,000)	22.34	22,335,200
2020072703330	FWD	USDMXN	17/09/2020	(500,000)	22.14	11,067,600
2020072803259	FWD	USDMXN	17/09/2020	252,494	22.12	(5,585,457)
2020072803132	FWD	USDMXN	17/09/2020	(252,494)	22.39	5,652,583
2020082803577	FWD	USDMXN	17/09/2020	87,396	21.92	(1,916,096)
2020082803578	FWD	USDMXN	17/09/2020	98,984	21.92	(2,170,155)
2020082803593	FWD	USDMXN	17/09/2020	87,396	21.92	(1,916,096)
2020082803760	FWD	USDMXN	17/09/2020	250,000	21.83	(5,458,734)
2020082803155	FWD	MXNUSD	17/09/2020	57,338,830	21.89	(2,619,060)
2020082803240	FWD	USDMXN	17/09/2020	(2,100,284)	21.90	45,989,960
2020090903464	FWD	USDMXN	17/09/2020	34,000	21.49	(730,779)
2020090903476	FWD	USDMXN	17/09/2020	(34,000)	21.57	733,288
2019121703153	FWD	USDMXN	18/09/2020	19,875,000	19.65	(390,495,812)
2019121703160	FWD	USDMXN	18/09/2020	(19,875,000)	19.65	390,525,863
2020020503244	FWD	USDMXN	18/09/2020	50,000	19.22	(960,827)
2020020503212	FWD	USDMXN	18/09/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020031303162	FWD	USDMXN	18/09/2020	(100,000,000)	22.59	2,259,000,000
2020032603530	FWD	USDMXN	18/09/2020	500,000	23.80	(11,899,495)
2020040603088	FWD	USDMXN	18/09/2020	(500,000)	25.41	12,703,739
2020040703164	FWD	USDMXN	18/09/2020	500,000	24.61	(12,303,297)
2020040703154	FWD	USDMXN	18/09/2020	(500,000)	24.70	12,351,600
2020051903049	FWD	USDMXN	18/09/2020	60,000	23.90	(1,434,156)
2020051903045	FWD	USDMXN	18/09/2020	(60,000)	23.96	1,437,540
2020052003170	FWD	USDMXN	18/09/2020	100,000	23.72	(2,372,333)
2020052003113	FWD	USDMXN	18/09/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052103321	FWD	USDMXN	18/09/2020	100,000	23.32	(2,332,135)
2020052103225	FWD	USDMXN	18/09/2020	(100,000)	23.44	2,343,620
2020052803435	FWD	USDMXN	18/09/2020	250,000	22.50	(5,624,540)
2020052803360	FWD	USDMXN	18/09/2020	(250,000)	22.61	5,651,250
2020071503061	FWD	USDMXN	18/09/2020	50,000	22.52	(1,126,024)
2020071503057	FWD	USDMXN	18/09/2020	(50,000)	22.52	1,126,000
2020081803230	FWD	USDMXN	18/09/2020	380,000	22.25	(8,455,325)
2020082603108	FWD	USDMXN	18/09/2020	100,000	21.98	(2,197,908)
2020082603032	FWD	USDMXN	18/09/2020	(100,000)	21.99	2,199,440
2020082803582	FWD	USDMXN	18/09/2020	196,393	21.93	(4,306,311)
2020082803153	FWD	MXNUSD	18/09/2020	103,328,790	21.90	(4,718,901)
2020090103081	FWD	USDMXN	18/09/2020	60,000	21.75	(1,305,064)
2020090103055	FWD	USDMXN	18/09/2020	(60,000)	21.82	1,309,230
2020091703093	FWD	USDMXN	18/09/2020	(900,000)	20.99	18,889,475
2020091703097	FWD	USDMXN	18/09/2020	(1,200,000)	20.98	25,180,866
2020091703099	FWD	USDMXN	18/09/2020	(1,900,000)	20.98	39,853,460
2020030303194	FWD	USDMXN	21/09/2020	500,000	19.78	(9,891,215)
2020030603326	FWD	USDMXN	21/09/2020	(500,000)	20.84	10,418,607
2020052103311	FWD	USDMXN	21/09/2020	25,000	23.29	(582,277)
2020052103212	FWD	USDMXN	21/09/2020	(25,000)	23.31	582,713

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052803550	FWD	USDMXN	21/09/2020	15,930	22.59	(359,861)
2020060803260	FWD	USDMXN	21/09/2020	15,930	21.92	(349,113)
2020062903231	FWD	USDMXN	21/09/2020	(100,000)	23.37	2,337,103
2020081903108	FWD	USDMXN	21/09/2020	380,000	22.14	(8,412,340)
2020082803581	FWD	USDMXN	21/09/2020	62,311	21.94	(1,366,800)
2020082803583	FWD	USDMXN	21/09/2020	143,918	21.94	(3,156,860)
2020082803147	FWD	MXNUSD	21/09/2020	70,251,105	21.90	(3,207,391)
2020082803149	FWD	MXNUSD	21/09/2020	33,077,686	21.90	(1,510,066)
2020090103189	FWD	USDMXN	21/09/2020	50,000	21.83	(1,091,654)
2020090103190	FWD	USDMXN	21/09/2020	(50,000)	21.90	1,094,825
2020090403435	FWD	USDMXN	21/09/2020	100,000	21.58	(2,157,783)
2020091003265	FWD	USDMXN	21/09/2020	955,000	21.30	(20,341,571)
2020091003242	FWD	USDMXN	21/09/2020	(955,000)	21.30	20,343,410
2020091803220	FWD	USDMXN	21/09/2020	(1,000,000)	20.99	20,993,982
2020091803222	FWD	USDMXN	21/09/2020	(1,000,000)	21.00	20,995,182
2019102803086	FWD	USDMXN	22/09/2020	1,185,570	19.94	(23,641,392)
2019102803084	FWD	USDMXN	22/09/2020	(1,185,570)	19.96	23,659,235
2019121603186	FWD	USDMXN	22/09/2020	991,888	19.72	(19,558,274)
2019121603183	FWD	USDMXN	22/09/2020	(495,944)	19.73	9,787,207
2019121603184	FWD	USDMXN	22/09/2020	(495,944)	19.71	9,777,288
2020070603043	FWD	USDMXN	22/09/2020	100,000	22.44	(2,243,775)
2020070603175	FWD	USDMXN	22/09/2020	(100,000)	22.49	2,249,200
2020080303274	FWD	USDMXN	22/09/2020	10,000	22.73	(227,283)
2020080303239	FWD	USDMXN	22/09/2020	(10,000)	22.74	227,417
2020081403285	FWD	USDMXN	22/09/2020	46,000	22.11	(1,017,120)
2020081403295	FWD	USDMXN	22/09/2020	(46,000)	22.12	1,017,658
2020082403167	FWD	USDMXN	22/09/2020	50,000	22.03	(1,101,743)
2020082403147	FWD	USDMXN	22/09/2020	(50,000)	22.10	1,104,920
2020082503039	FWD	USDMXN	22/09/2020	200,000	22.02	(4,403,796)
2020082503036	FWD	USDMXN	22/09/2020	(200,000)	22.08	4,416,740
2020082803304	FWD	USDMXN	22/09/2020	150,000	21.93	(3,289,174)
2020082803584	FWD	USDMXN	22/09/2020	211,047	21.94	(4,629,915)
2020082803809	FWD	USDMXN	22/09/2020	37,000	21.85	(808,313)
2020082803144	FWD	MXNUSD	22/09/2020	103,328,790	21.91	(4,716,310)
2020082803693	FWD	USDMXN	22/09/2020	(37,000)	21.86	808,909
2020090303426	FWD	USDMXN	22/09/2020	26,250	21.71	(569,956)
2020090303430	FWD	USDMXN	22/09/2020	(26,250)	21.78	571,704
2020090903393	FWD	USDMXN	22/09/2020	2,500	21.46	(53,656)
2020090903388	FWD	USDMXN	22/09/2020	(2,500)	21.48	53,704
2020091003140	FWD	USDMXN	22/09/2020	(150,000)	21.29	3,193,166
2020052603245	FWD	USDMXN	23/09/2020	60,000	22.57	(1,354,248)
2020052603184	FWD	USDMXN	23/09/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603294	FWD	USDMXN	23/09/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060203287	FWD	USDMXN	23/09/2020	555,000	22.04	(12,229,510)
2020060203304	FWD	USDMXN	23/09/2020	(500,000)	22.11	11,056,450
2020060203322	FWD	USDMXN	23/09/2020	(50,000)	22.11	1,105,645
2020060203341	FWD	USDMXN	23/09/2020	(5,000)	22.11	110,565
2020060903402	FWD	USDMXN	23/09/2020	100,000	22.16	(2,215,555)
2020060903403	FWD	USDMXN	23/09/2020	100,000	22.16	(2,215,555)
2020060903429	FWD	USDMXN	23/09/2020	(200,000)	22.17	4,434,360
2020062903160	FWD	USDMXN	23/09/2020	49,882	23.36	(1,165,454)
2020062903150	FWD	USDMXN	23/09/2020	(12,627)	23.34	294,654
2020062903166	FWD	USDMXN	23/09/2020	(37,255)	23.38	870,876
2020070103347	FWD	USDMXN	23/09/2020	12,060	23.02	(277,673)
2020070103333	FWD	USDMXN	23/09/2020	(12,060)	23.13	279,003
2020081403492	FWD	USDMXN	23/09/2020	1,539,212	22.12	(34,049,006)
2020082103195	FWD	USDMXN	23/09/2020	380,000	22.10	(8,396,748)
2020082103300	FWD	USDMXN	23/09/2020	380,000	22.10	(8,399,056)
2020082803592	FWD	USDMXN	23/09/2020	206,284	21.94	(4,525,981)
2020082803594	FWD	USDMXN	23/09/2020	17,929	21.94	(393,372)
2020082803137	FWD	MXNUSD	23/09/2020	94,512,249	21.91	(4,312,728)
2020082803318	FWD	USDMXN	23/09/2020	(402,338)	21.91	8,816,541
2020092103031	FWD	USDMXN	23/09/2020	50,000,000	21.49	(1,074,415,500)
2020092103040	FWD	USDMXN	23/09/2020	50,000,000	21.51	(1,075,250,000)
2020092103052	FWD	USDMXN	23/09/2020	100,000,000	21.47	(2,147,000,000)
2020092103261	FWD	USDMXN	23/09/2020	100,000,000	21.51	(2,150,500,000)
2020092103362	FWD	USDMXN	23/09/2020	50,000,000	21.46	(1,072,800,000)
2020030503117	FWD	USDMXN	24/09/2020	(344,000)	20.39	7,014,161
2020030903081	FWD	USDMXN	24/09/2020	100,000	20.84	(2,083,990)
2020030903049	FWD	USDMXN	24/09/2020	(100,000)	20.97	2,096,915
2020070203146	FWD	USDMXN	24/09/2020	100,000	22.85	(2,284,533)
2020070203103	FWD	USDMXN	24/09/2020	(100,000)	22.87	2,286,780
2020070603106	FWD	USDMXN	24/09/2020	500,000	22.42	(11,211,626)
2020070603113	FWD	USDMXN	24/09/2020	150,000	22.46	(3,368,485)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020070603077	FWD	USDMXN	24/09/2020	(500,000)	22.32	11,158,850
2020072703233	FWD	USDMXN	24/09/2020	1,000,000	22.34	(22,338,401)
2020072703387	FWD	USDMXN	24/09/2020	500,000	22.15	(11,075,117)
2020072703193	FWD	USDMXN	24/09/2020	(1,000,000)	22.34	22,336,500
2020072703336	FWD	USDMXN	24/09/2020	(500,000)	22.16	11,078,250
2020073003297	FWD	USDMXN	24/09/2020	71,760,000	22.26	(1,597,449,360)
2020073003336	FWD	USDMXN	24/09/2020	(71,760,000)	22.30	1,600,248,000
2020082803306	FWD	USDMXN	24/09/2020	150,000	21.93	(3,289,986)
2020082803595	FWD	USDMXN	24/09/2020	176,980	21.94	(3,883,514)
2020082803596	FWD	USDMXN	24/09/2020	51,066	21.94	(1,120,553)
2020082803761	FWD	USDMXN	24/09/2020	250,000	21.85	(5,463,462)
2020082803132	FWD	MXNUSD	24/09/2020	21,994,980	21.92	(1,003,614)
2020082803134	FWD	MXNUSD	24/09/2020	81,333,810	21.92	(3,709,821)
2020091003205	FWD	USDMXN	24/09/2020	34,000	21.30	(724,364)
2020091003142	FWD	USDMXN	24/09/2020	(300,000)	21.29	6,387,545
2020091003146	FWD	USDMXN	24/09/2020	(34,000)	21.44	728,906
2019101103484	FWD	USDMXN	25/09/2020	5,400,000	20.34	(109,854,592)
2019101103575	FWD	USDMXN	25/09/2020	40,000	20.35	(814,125)
2019101103559	FWD	USDMXN	25/09/2020	(5,440,000)	20.35	110,695,840
2019112603560	FWD	USDMXN	25/09/2020	40,000	20.41	(816,441)
2019112603600	FWD	USDMXN	25/09/2020	36	20.42	(730)
2019112603561	FWD	USDMXN	25/09/2020	(40,036)	20.42	817,650
2020020403143	FWD	USDMXN	25/09/2020	100,000	19.30	(1,930,176)
2020020403149	FWD	USDMXN	25/09/2020	(100,000)	19.38	1,937,900
2020020503245	FWD	USDMXN	25/09/2020	50,000	19.24	(961,780)
2020020503213	FWD	USDMXN	25/09/2020	(50,000)	19.07	953,510
2020021703108	FWD	USDMXN	25/09/2020	490,000	19.15	(9,383,126)
2020031803172	FWD	USDMXN	25/09/2020	490,000	24.40	(11,957,875)
2020031803312	FWD	USDMXN	25/09/2020	666,666	24.49	(16,324,934)
2020031803459	FWD	USDMXN	25/09/2020	10,000	24.57	(245,661)
2020031803021	FWD	USDMXN	25/09/2020	(490,000)	24.71	12,105,664
2020031803241	FWD	USDMXN	25/09/2020	(500,000)	24.69	12,346,957
2020031903135	FWD	USDMXN	25/09/2020	(666,667)	24.91	16,609,786
2020031903319	FWD	USDMXN	25/09/2020	(666,666)	24.80	16,530,939
2020032603229	FWD	USDMXN	25/09/2020	666,667	23.79	(15,862,853)
2020050603097	FWD	USDMXN	25/09/2020	(149,000)	24.81	3,696,283
2020051903047	FWD	USDMXN	25/09/2020	60,000	23.92	(1,435,399)
2020051903318	FWD	USDMXN	25/09/2020	30,000	23.99	(719,649)
2020051903046	FWD	USDMXN	25/09/2020	(60,000)	23.98	1,438,794
2020051903313	FWD	USDMXN	25/09/2020	(30,000)	24.04	721,200
2020052003171	FWD	USDMXN	25/09/2020	100,000	23.74	(2,374,289)
2020052003110	FWD	USDMXN	25/09/2020	(100,000)	23.74	2,374,000
2020052803436	FWD	USDMXN	25/09/2020	250,000	22.52	(5,629,567)
2020052803361	FWD	USDMXN	25/09/2020	(250,000)	22.63	5,656,375
2020060903195	FWD	USDMXN	25/09/2020	3,400,000	22.05	(74,959,565)
2020060903076	FWD	USDMXN	25/09/2020	(3,400,000)	22.05	74,983,600
2020071503063	FWD	USDMXN	25/09/2020	50,000	22.54	(1,127,009)
2020071503359	FWD	USDMXN	25/09/2020	210,000	22.61	(4,749,117)
2020071503058	FWD	USDMXN	25/09/2020	(50,000)	22.52	1,126,000
2020071503341	FWD	USDMXN	25/09/2020	(210,000)	22.62	4,751,082
2020071703139	FWD	USDMXN	25/09/2020	105,000	22.67	(2,379,945)
2020071703137	FWD	USDMXN	25/09/2020	(105,000)	22.67	2,380,644
2020072103146	FWD	USDMXN	25/09/2020	210,000	22.56	(4,737,362)
2020072103123	FWD	USDMXN	25/09/2020	(210,000)	22.57	4,739,343
2020072403442	FWD	USDMXN	25/09/2020	105,000	22.53	(2,365,333)
2020072403419	FWD	USDMXN	25/09/2020	(105,000)	22.53	2,365,997
2020082603110	FWD	USDMXN	25/09/2020	100,000	22.00	(2,199,887)
2020082603033	FWD	USDMXN	25/09/2020	(100,000)	21.99	2,199,440
2020082803598	FWD	USDMXN	25/09/2020	239,233	21.95	(5,250,192)
2020082803130	FWD	MXNUSD	25/09/2020	103,328,790	21.92	(4,713,001)
2020090203164	FWD	USDMXN	25/09/2020	50,000	21.83	(1,091,567)
2020090203159	FWD	USDMXN	25/09/2020	(50,000)	21.93	1,096,370
2020090403185	FWD	USDMXN	25/09/2020	149,000	21.66	(3,227,561)
2020091003136	FWD	USDMXN	25/09/2020	150,000	21.29	(3,194,097)
2020091003074	FWD	USDMXN	25/09/2020	(150,000)	21.30	3,195,585
2020092303230	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.21	(4,441,398)
2020092303232	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.21	(4,441,368)
2020092303238	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.20	(4,440,464)
2020092303241	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.20	(4,439,804)
2020092303243	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.21	(4,441,374)
2020092303250	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.20	(4,440,522)
2020092303252	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.20	(4,439,062)
2020092303254	FWD	USDMXN	25/09/2020	200,000	22.21	(4,442,938)
2020052103312	FWD	USDMXN	28/09/2020	25,000	23.31	(582,786)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020052103215	FWD	USDMXN	28/09/2020	(25,000)	23.31	582,713
2020052803554	FWD	USDMXN	28/09/2020	15,930	22.59	(359,932)
2020052803575	FWD	USDMXN	28/09/2020	(15,930)	22.66	360,974
2020060803261	FWD	USDMXN	28/09/2020	15,930	21.93	(349,423)
2020060803286	FWD	USDMXN	28/09/2020	(15,930)	22.04	351,092
2020080603391	FWD	USDMXN	28/09/2020	9,925	22.53	(223,621)
2020080603293	FWD	USDMXN	28/09/2020	(727,600)	22.50	16,371,493
2020081303271	FWD	USDMXN	28/09/2020	(1,076,858)	22.32	24,031,380
2020082803597	FWD	USDMXN	28/09/2020	131,131	21.95	(2,878,854)
2020082803599	FWD	USDMXN	28/09/2020	114,027	21.95	(2,503,353)
2020082803116	FWD	MXNUSD	28/09/2020	46,256,125	21.96	(2,106,083)
2020082803122	FWD	MXNUSD	28/09/2020	57,072,666	21.95	(2,600,012)
2020090103083	FWD	USDMXN	28/09/2020	220,000	21.78	(4,790,848)
2020090103056	FWD	USDMXN	28/09/2020	(220,000)	21.85	4,806,230
2020090903454	FWD	USDMXN	28/09/2020	1,000,000	21.44	(21,442,132)
2020090903458	FWD	USDMXN	28/09/2020	(1,000,000)	21.48	21,477,100
2020092103148	FWD	USDMXN	28/09/2020	79,000	21.50	(1,698,800)
2020092103150	FWD	USDMXN	28/09/2020	57,000	21.50	(1,225,717)
2020092103151	FWD	USDMXN	28/09/2020	24,000	21.50	(516,091)
2020092103153	FWD	USDMXN	28/09/2020	109,000	21.50	(2,343,914)
2020092103154	FWD	USDMXN	28/09/2020	70,000	21.50	(1,505,266)
2020092103163	FWD	USDMXN	28/09/2020	48,000	21.50	(1,032,182)
2020092103205	FWD	USDMXN	28/09/2020	(387,000)	21.56	8,344,829
2020060503211	FWD	USDMXN	29/09/2020	40,000	22.09	(883,543)
2020060503073	FWD	USDMXN	29/09/2020	(40,000)	22.14	885,664
2020072803331	FWD	USDMXN	29/09/2020	28,000	22.14	(619,949)
2020072803310	FWD	USDMXN	29/09/2020	(28,000)	22.16	620,449
2020080403277	FWD	USDMXN	29/09/2020	523,000	22.95	(12,005,255)
2020080403364	FWD	USDMXN	29/09/2020	349	22.93	(8,001)
2020080503110	FWD	USDMXN	29/09/2020	34,500	22.55	(777,878)
2020080503099	FWD	USDMXN	29/09/2020	(34,500)	22.57	778,544
2020081103188	FWD	USDMXN	29/09/2020	891,000	22.44	(19,989,941)
2020081103264	FWD	USDMXN	29/09/2020	458	22.47	(10,291)
2020081703119	FWD	USDMXN	29/09/2020	83,650	22.16	(1,853,452)
2020081703086	FWD	USDMXN	29/09/2020	(83,650)	22.26	1,861,720
2020082403168	FWD	USDMXN	29/09/2020	50,000	22.05	(1,102,730)
2020082403149	FWD	USDMXN	29/09/2020	(50,000)	22.12	1,105,925
2020082803600	FWD	USDMXN	29/09/2020	254,285	21.96	(5,583,272)
2020082803110	FWD	MXNUSD	29/09/2020	103,328,790	21.95	(4,706,794)
2020090103315	FWD	USDMXN	29/09/2020	(23,813,588)	21.80	519,247,023
2020090203314	FWD	USDMXN	29/09/2020	162,000	21.87	(3,542,750)
2020090203163	FWD	USDMXN	29/09/2020	(162,000)	21.89	3,545,937
2020090403454	FWD	USDMXN	29/09/2020	6,500	21.61	(140,434)
2020090403424	FWD	USDMXN	29/09/2020	(6,500)	21.63	140,616
2020090803287	FWD	USDMXN	29/09/2020	4,042,027	21.76	(87,945,323)
2020091103406	FWD	USDMXN	29/09/2020	200,000	21.30	(4,260,071)
2020091103407	FWD	USDMXN	29/09/2020	(200,000)	21.31	4,261,800
2020092103164	FWD	USDMXN	29/09/2020	116,000	21.51	(2,494,719)
2020092103165	FWD	USDMXN	29/09/2020	102,000	21.51	(2,193,632)
2020092103206	FWD	USDMXN	29/09/2020	(218,000)	21.57	4,701,240
2020092203214	FWD	USDMXN	29/09/2020	5,000,000	21.70	(108,480,564)
2020092203229	FWD	USDMXN	29/09/2020	12,813,508	21.69	(277,946,295)
2019080603175	FWD	USDMXN	30/09/2020	(250,000)	21.02	5,254,371
2019101103748	FWD	USDMXN	30/09/2020	250,000	20.34	(5,084,407)
2019102803066	FWD	USDMXN	30/09/2020	8,000,000	19.97	(159,746,744)
2019102803058	FWD	USDMXN	30/09/2020	(8,000,000)	19.98	159,800,000
2020031203135	FWD	USDMXN	30/09/2020	100,000	23.01	(2,301,000)
2020031203115	FWD	USDMXN	30/09/2020	(100,000)	23.00	2,299,526
2020031803343	FWD	USDMXN	30/09/2020	100,000	24.61	(2,461,220)
2020031803372	FWD	USDMXN	30/09/2020	(100,000)	24.58	2,458,295
2020052503176	FWD	USDMXN	30/09/2020	30,000	23.03	(690,818)
2020052503148	FWD	USDMXN	30/09/2020	(30,000)	23.04	691,167
2020052603248	FWD	USDMXN	30/09/2020	60,000	22.59	(1,355,489)
2020052603186	FWD	USDMXN	30/09/2020	(50,000)	22.63	1,131,675
2020052603297	FWD	USDMXN	30/09/2020	(10,000)	22.62	226,185
2020060203291	FWD	USDMXN	30/09/2020	555,000	22.06	(12,240,665)
2020060203323	FWD	USDMXN	30/09/2020	(50,000)	22.11	1,105,645
2020060203343	FWD	USDMXN	30/09/2020	(5,000)	22.11	110,565
2020060203371	FWD	USDMXN	30/09/2020	(500,000)	22.11	11,056,450
2020060903404	FWD	USDMXN	30/09/2020	100,000	22.17	(2,217,467)
2020060903405	FWD	USDMXN	30/09/2020	100,000	22.17	(2,217,467)
2020060903441	FWD	USDMXN	30/09/2020	(200,000)	22.19	4,438,240
2020082703565	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,782,443	22.03	(61,288,867)
2020082703553	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,782,443)	22.05	61,343,417

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020082803286	FWD	USDMXN	30/09/2020	380,000	21.92	(8,329,024)
2020082803496	FWD	USDMXN	30/09/2020	4,000,000	21.95	(87,783,520)
2020082803601	FWD	USDMXN	30/09/2020	64,461	21.96	(1,415,528)
2020082803602	FWD	USDMXN	30/09/2020	200,807	21.96	(4,409,611)
2020082803105	FWD	MXNUSD	30/09/2020	77,067,646	21.94	(3,512,996)
2020082803108	FWD	MXNUSD	30/09/2020	26,261,145	21.96	(1,195,691)
2020091003266	FWD	USDMXN	30/09/2020	1,377,000	21.33	(29,366,175)
2020091003243	FWD	USDMXN	30/09/2020	(1,377,000)	21.33	29,370,033
2020092803360	FWD	USDMXN	30/09/2020	15,930	22.43	(357,363)
2020092903109	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,752,026	22.23	(61,177,538)
2020092903112	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,642,635	22.23	(58,745,776)
2020092903114	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,502,617	22.23	(55,633,176)
2020092903116	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,346,055	22.23	(52,152,803)
2020092903119	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,213,542	22.23	(49,207,039)
2020092903122	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,109,887	22.23	(46,902,788)
2020092903125	FWD	USDMXN	30/09/2020	1,967,561	22.23	(43,738,881)
2020092903127	FWD	USDMXN	30/09/2020	1,850,665	22.23	(41,140,283)
2020092903129	FWD	USDMXN	30/09/2020	1,704,765	22.23	(37,896,926)
2020092903138	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,845,328	22.23	(63,251,641)
2020092903033	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,845,328)	22.20	63,177,404
2020092903039	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,752,026)	22.20	61,102,405
2020092903042	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,642,635)	22.21	58,703,031
2020092903044	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,502,617)	22.23	55,627,486
2020092903047	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,346,055)	22.24	52,179,137
2020092903049	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,213,542)	22.23	49,196,358
2020092903051	FWD	USDMXN	30/09/2020	(2,109,887)	22.24	46,915,711
2020092903053	FWD	USDMXN	30/09/2020	(1,967,561)	22.24	43,754,612
2020092903055	FWD	USDMXN	30/09/2020	(1,850,665)	22.24	41,161,685
2020092903058	FWD	USDMXN	30/09/2020	(1,704,765)	22.25	37,938,209
2020072703367	FWD	EURMXN	29/07/2020	154,035	25.49	(3,925,572)
2020072703368	FWD	EURMXN	29/07/2020	(2,374)	25.88	0
2020090303290	FWD	EURMXN	04/09/2020	235,000	25.66	(6,029,107)
2020031803274	FWD	USDMXN	01/07/2020	400,000	24.09	(9,635,840)
2020032703276	FWD	USDMXN	01/07/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703073	FWD	USDMXN	01/07/2020	(400,000)	24.09	9,635,840
2020052503192	FWD	USDMXN	01/07/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020062503003	FWD	USDMXN	02/07/2020	116,000	22.86	(2,651,412)
2019102103093	FWD	USDMXN	06/07/2020	(1,500,000)	19.89	29,835,000
2020030603047	FWD	USDMXN	06/07/2020	1,500,000	19.89	(29,835,000)
2020063003366	FWD	USDMXN	07/07/2020	3,000,000	22.97	(68,900,400)
2020063003358	FWD	USDMXN	07/07/2020	(1)	22.96	23
2020032403295	FWD	USDMXN	08/07/2020	250,000	25.26	(6,314,450)
2020032703278	FWD	USDMXN	08/07/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703074	FWD	USDMXN	08/07/2020	(250,000)	25.26	6,314,450
2020052503193	FWD	USDMXN	08/07/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020070603314	FWD	USDMXN	08/07/2020	(1,000,000)	22.35	22,346,740
2020070903253	FWD	USDMXN	09/07/2020	(10,000)	22.69	226,900
2020031903107	FWD	USDMXN	10/07/2020	9,300	24.30	(225,990)
2020070303162	FWD	USDMXN	10/07/2020	(100,000)	22.47	2,246,990
2020050703218	FWD	USDMXN	13/07/2020	137,000	24.23	(3,319,457)
2020050703216	FWD	USDMXN	13/07/2020	(137,716)	24.23	3,336,991
2020062503372	FWD	USDMXN	13/07/2020	313,000	22.83	(7,144,427)
2020062303137	FWD	USDMXN	14/07/2020	(5,576,700)	22.41	124,990,585
2020063003359	FWD	USDMXN	14/07/2020	13,266,000	23.00	(305,078,149)
2020071403067	FWD	USDMXN	14/07/2020	(20,000,000)	22.64	452,745,000
2019071603118	FWD	USDMXN	15/07/2020	(5,700,000)	20.19	115,071,600
2020022803633	FWD	USDMXN	15/07/2020	(100,000)	20.07	2,006,569
2020032403296	FWD	USDMXN	15/07/2020	250,000	25.28	(6,320,650)
2020032703280	FWD	USDMXN	15/07/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703075	FWD	USDMXN	15/07/2020	(250,000)	25.28	6,320,650
2020040103413	FWD	USDMXN	15/07/2020	5,700,000	24.64	(140,459,400)
2020052503194	FWD	USDMXN	15/07/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020011603064	FWD	USDMXN	16/07/2020	(500,000)	19.25	9,624,200
2020031803026	FWD	USDMXN	16/07/2020	500,000	19.25	(9,624,200)
2020071403068	FWD	USDMXN	16/07/2020	20,000,000	22.64	(452,866,000)
2020032403299	FWD	USDMXN	22/07/2020	250,000	25.31	(6,326,850)
2020032703290	FWD	USDMXN	22/07/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703081	FWD	USDMXN	22/07/2020	(250,000)	25.31	6,326,850
2020052503195	FWD	USDMXN	22/07/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2019121303254	FWD	USDMXN	23/07/2020	(1,000,000)	19.71	19,714,900
2020061103432	FWD	USDMXN	23/07/2020	135,000	22.75	(3,071,250)
2020071503475	FWD	USDMXN	23/07/2020	(135,000)	22.75	3,071,250
2020072303000	FWD	USDMXN	23/07/2020	20,000,000	22.44	(448,800,000)
2020072303131	FWD	USDMXN	23/07/2020	(9,700,000)	22.33	216,601,000

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020060403256	FWD	USDMXN	24/07/2020	15,000	22.00	(330,045)
2020061503307	FWD	USDMXN	24/07/2020	690,582	22.36	(15,438,312)
2020070603058	FWD	USDMXN	24/07/2020	(1,300,000)	22.32	29,013,010
2020070903141	FWD	USDMXN	24/07/2020	(15,000)	22.00	330,045
2020072203340	FWD	USDMXN	24/07/2020	4,000,000	22.36	(89,450,000)
2020072303132	FWD	USDMXN	24/07/2020	9,700,000	22.33	(216,630,100)
2020072303001	FWD	USDMXN	24/07/2020	(20,000,000)	22.44	448,861,000
2020072403117	FWD	USDMXN	24/07/2020	(15,000,000)	22.37	335,506,575
2020062403317	FWD	USDMXN	27/07/2020	1,000,000	22.82	(22,818,806)
2020062403320	FWD	USDMXN	27/07/2020	(1,000,000)	22.84	22,839,800
2020062503417	FWD	USDMXN	27/07/2020	(1,000,000)	22.75	22,754,300
2020072403118	FWD	USDMXN	27/07/2020	15,000,000	22.38	(335,645,100)
2019121303256	FWD	USDMXN	28/07/2020	(1,000,000)	19.73	19,729,700
2019121303829	FWD	USDMXN	28/07/2020	(1,000,000)	19.68	19,675,000
2020031803028	FWD	USDMXN	28/07/2020	1,000,000	19.68	(19,675,000)
2020072103361	FWD	USDMXN	28/07/2020	200,000	19.73	(3,945,940)
2020072103363	FWD	USDMXN	28/07/2020	(800,000)	19.73	15,783,760
2020072203341	FWD	USDMXN	28/07/2020	(4,000,000)	22.37	89,495,702
2020032403302	FWD	USDMXN	29/07/2020	250,000	25.33	(6,333,050)
2020032703294	FWD	USDMXN	29/07/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703083	FWD	USDMXN	29/07/2020	(250,000)	25.33	6,333,050
2020052503196	FWD	USDMXN	29/07/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020060203572	FWD	USDMXN	29/07/2020	(161,655)	21.96	3,549,591
2020062503420	FWD	USDMXN	29/07/2020	(1,000,000)	22.74	22,739,399
2020063003361	FWD	USDMXN	29/07/2020	(13,000,000)	23.04	299,566,423
2020072903131	FWD	USDMXN	29/07/2020	(13,000)	22.00	285,965
2020072903253	FWD	USDMXN	29/07/2020	(11,500)	21.99	252,897
2019080603146	FWD	USDMXN	30/07/2020	250,000	20.40	(5,100,000)
2019101103600	FWD	USDMXN	30/07/2020	(250,000)	20.40	5,100,000
2020022803203	FWD	USDMXN	30/07/2020	20,000	20.14	(402,800)
2020030303047	FWD	USDMXN	30/07/2020	400,000	19.87	(7,948,320)
2020033003229	FWD	USDMXN	30/07/2020	8,500	24.53	(208,505)
2020042203201	FWD	USDMXN	30/07/2020	(400,000)	24.97	9,987,480
2020050603094	FWD	USDMXN	30/07/2020	11,500	24.53	(282,095)
2020060903356	FWD	USDMXN	30/07/2020	836,000	22.00	(18,396,046)
2020062603145	FWD	USDMXN	30/07/2020	20,375,000	23.12	(470,978,313)
2020070803054	FWD	USDMXN	30/07/2020	135,000	22.85	(3,085,155)
2020072203345	FWD	USDMXN	30/07/2020	(135,000)	22.85	3,085,155
2020072403279	FWD	USDMXN	30/07/2020	(20,000)	20.14	402,800
2020072403287	FWD	USDMXN	30/07/2020	(8,500)	24.53	208,505
2020072403290	FWD	USDMXN	30/07/2020	(11,500)	24.53	282,095
2020072403372	FWD	USDMXN	30/07/2020	(20,000)	20.14	402,800
2020072403374	FWD	USDMXN	30/07/2020	(8,500)	24.53	208,505
2020072403377	FWD	USDMXN	30/07/2020	(11,500)	24.53	282,095
2020022703325	FWD	USDMXN	31/07/2020	500,000	19.75	(9,875,900)
2020031803340	FWD	USDMXN	31/07/2020	100,000	24.61	(2,461,220)
2020061103251	FWD	USDMXN	31/07/2020	(500,000)	19.75	9,875,900
2020072403112	FWD	USDMXN	31/07/2020	(1)	22.38	22
2020073103000	FWD	USDMXN	31/07/2020	10,900,000	22.16	(241,544,000)
2020052603356	FWD	USDMXN	03/08/2020	(250,000)	22.72	5,681,225
2020061103433	FWD	USDMXN	03/08/2020	11,500	22.77	(261,855)
2020061803245	FWD	USDMXN	03/08/2020	250,000	22.72	(5,681,225)
2020072903254	FWD	USDMXN	03/08/2020	11,500	22.01	(253,077)
2020073103001	FWD	USDMXN	03/08/2020	(10,900,000)	22.17	241,642,100
2020070603018	FWD	USDMXN	04/08/2020	(2,000,000)	22.30	44,590,000
2020080403071	FWD	USDMXN	04/08/2020	(24,000,000)	22.82	547,680,000
2020032403304	FWD	USDMXN	05/08/2020	250,000	25.36	(6,339,250)
2020032703296	FWD	USDMXN	05/08/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703084	FWD	USDMXN	05/08/2020	(250,000)	25.36	6,339,250
2020052503197	FWD	USDMXN	05/08/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020072003075	FWD	USDMXN	06/08/2020	135,000	22.63	(3,055,320)
2020072903367	FWD	USDMXN	06/08/2020	(135,000)	22.63	3,055,320
2020080403072	FWD	USDMXN	06/08/2020	24,000,000	22.83	(547,825,200)
2020040303057	FWD	USDMXN	07/08/2020	27,500	24.85	(683,375)
2020070603060	FWD	USDMXN	07/08/2020	(1,300,000)	22.32	29,013,010
2020072403168	FWD	USDMXN	07/08/2020	(1)	22.50	23
2020080603007	FWD	USDMXN	07/08/2020	(10,000,000)	22.46	224,600,000
2020051103012	FWD	USDMXN	10/08/2020	26,100	24.18	(631,098)
2020072903167	FWD	USDMXN	10/08/2020	(26,100)	24.18	631,098
2020080603008	FWD	USDMXN	10/08/2020	10,000,000	22.47	(224,689,000)
2020080703271	FWD	USDMXN	10/08/2020	(1,000,000)	22.38	22,379,000
2020072703167	FWD	USDMXN	11/08/2020	(450,000)	22.09	9,939,240
2020080703321	FWD	USDMXN	11/08/2020	2,000,000	22.40	(44,798,600)
2020032403305	FWD	USDMXN	12/08/2020	250,000	25.38	(6,345,450)

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020032703300	FWD	USDMXN	12/08/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703086	FWD	USDMXN	12/08/2020	(250,000)	25.38	6,345,450
2020052503198	FWD	USDMXN	12/08/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020062303147	FWD	USDMXN	13/08/2020	2,000,000	22.50	(45,005,892)
2020072103220	FWD	USDMXN	13/08/2020	(447,400)	22.38	10,011,434
2020073103317	FWD	USDMXN	13/08/2020	11,500	22.20	(255,300)
2019121703414	FWD	USDMXN	14/08/2020	(1,000,000)	19.57	19,567,200
2020030303183	FWD	USDMXN	14/08/2020	(500,000)	19.76	9,878,350
2020030603048	FWD	USDMXN	14/08/2020	500,000	19.76	(9,878,350)
2020081303454	FWD	USDMXN	14/08/2020	1,000,000	22.19	(22,194,026)
2020081403004	FWD	USDMXN	14/08/2020	27,100,000	22.16	(600,536,000)
2019121603475	FWD	USDMXN	17/08/2020	(750,000)	19.70	14,771,250
2020031803029	FWD	USDMXN	17/08/2020	750,000	19.70	(14,771,250)
2020052803563	FWD	USDMXN	17/08/2020	(15,930)	22.52	358,731
2020060803272	FWD	USDMXN	17/08/2020	(15,930)	21.92	349,202
2020061003028	FWD	USDMXN	17/08/2020	15,930	21.92	(349,202)
2020072703168	FWD	USDMXN	17/08/2020	(150,000)	22.11	3,315,780
2020080303093	FWD	USDMXN	17/08/2020	150,000	22.11	(3,315,780)
2020081303183	FWD	USDMXN	17/08/2020	50,000,000	22.26	(1,112,750,000)
2020081403005	FWD	USDMXN	17/08/2020	(27,100,000)	22.17	600,758,220
2020032403308	FWD	USDMXN	19/08/2020	250,000	25.41	(6,351,650)
2020032703309	FWD	USDMXN	19/08/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703089	FWD	USDMXN	19/08/2020	(250,000)	25.41	6,351,650
2020052503199	FWD	USDMXN	19/08/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020052003279	FWD	USDMXN	20/08/2020	(500,000)	23.60	11,797,500
2020061503312	FWD	USDMXN	21/08/2020	689,410	22.39	(15,438,312)
2020081903100	FWD	USDMXN	21/08/2020	114,660	20.25	(2,321,741)
2020081903102	FWD	USDMXN	21/08/2020	0	22.04	(205,413)
2020052803566	FWD	USDMXN	24/08/2020	(15,930)	22.54	359,073
2020060803273	FWD	USDMXN	24/08/2020	(15,930)	21.94	349,527
2020061003032	FWD	USDMXN	24/08/2020	15,930	21.94	(349,527)
2020070603061	FWD	USDMXN	24/08/2020	(1,500,000)	22.32	33,476,550
2020072703172	FWD	USDMXN	24/08/2020	(180,000)	22.13	3,982,752
2020080303109	FWD	USDMXN	24/08/2020	180,000	22.13	(3,982,752)
2020030303185	FWD	USDMXN	25/08/2020	(500,000)	19.76	9,878,350
2020030603049	FWD	USDMXN	25/08/2020	500,000	19.76	(9,878,350)
2020061803278	FWD	USDMXN	25/08/2020	100,000	22.83	(2,283,000)
2020080603234	FWD	USDMXN	25/08/2020	(100,000)	22.83	2,283,000
2020032403311	FWD	USDMXN	26/08/2020	250,000	25.43	(6,357,850)
2020032703317	FWD	USDMXN	26/08/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020032703090	FWD	USDMXN	26/08/2020	(250,000)	25.43	6,357,850
2020052503200	FWD	USDMXN	26/08/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020081803029	FWD	USDMXN	26/08/2020	(3,500,000)	22.07	77,252,956
2020082003376	FWD	USDMXN	26/08/2020	(5,000,000)	22.13	110,662,850
2020082403267	FWD	USDMXN	26/08/2020	(69,973,500)	21.98	1,537,815,307
2020070203097	FWD	USDMXN	27/08/2020	(100,000)	22.84	2,283,700
2020080603094	FWD	USDMXN	27/08/2020	100,000	22.84	(2,283,700)
2019080603147	FWD	USDMXN	28/08/2020	250,000	20.40	(5,100,000)
2019101103604	FWD	USDMXN	28/08/2020	(250,000)	20.40	5,100,000
2020030303049	FWD	USDMXN	28/08/2020	400,000	19.96	(7,982,400)
2020042203202	FWD	USDMXN	28/08/2020	(400,000)	25.06	10,023,400
2020082703606	FWD	USDMXN	28/08/2020	(10,000,000)	22.15	221,543,450
2020082803008	FWD	USDMXN	28/08/2020	20,000,000	21.85	(437,000,000)
2020060803281	FWD	USDMXN	31/08/2020	(15,930)	21.96	349,850
2020061003030	FWD	USDMXN	31/08/2020	15,930	21.96	(349,850)
2020082703607	FWD	USDMXN	31/08/2020	10,000,000	22.16	(221,627,200)
2020082803009	FWD	USDMXN	31/08/2020	(20,000,000)	21.86	437,161,000
2020050603079	FWD	USDMXN	01/09/2020	75,000	24.65	(1,848,750)
2020082003029	FWD	USDMXN	01/09/2020	(75,000)	24.65	1,848,750
2020082403268	FWD	USDMXN	01/09/2020	69,973,500	21.99	(1,539,004,856)
2020082803139	FWD	USDMXN	01/09/2020	(1,400,000)	21.85	30,594,228
2020083103279	FWD	USDMXN	01/09/2020	4,000,000	21.94	(87,740,460)
2020030903243	FWD	USDMXN	02/09/2020	420,000	21.83	(9,167,760)
2020032703319	FWD	USDMXN	02/09/2020	300,000	23.66	(7,096,620)
2020052503201	FWD	USDMXN	02/09/2020	(300,000)	23.66	7,096,620
2020052603382	FWD	USDMXN	02/09/2020	(250,000)	22.82	5,703,875
2020061803246	FWD	USDMXN	02/09/2020	250,000	22.82	(5,703,875)
2020021703087	FWD	USDMXN	04/09/2020	(490,000)	19.15	9,383,010
2020031803030	FWD	USDMXN	04/09/2020	490,000	19.15	(9,383,010)
2020031803252	FWD	USDMXN	04/09/2020	(666,667)	24.35	16,233,408
2020031903042	FWD	USDMXN	04/09/2020	666,667	24.35	(16,233,408)
2020031903151	FWD	USDMXN	04/09/2020	666,667	24.70	(16,467,075)
2020032603073	FWD	USDMXN	04/09/2020	(666,667)	24.70	16,467,075
2020032603497	FWD	USDMXN	04/09/2020	(500,000)	23.86	11,930,350

External Deal Number	ProductID	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020040603023	FWD	USDMXN	04/09/2020	500,000	23.86	(11,930,350)
2020072403169	FWD	USDMXN	04/09/2020	1	22.60	(23)
2020080403324	FWD	USDMXN	04/09/2020	260,000	22.90	(5,954,000)
2020082603057	FWD	USDMXN	04/09/2020	(260,000)	22.90	5,954,000
2020090403127	FWD	USDMXN	04/09/2020	(213,545)	21.57	4,606,432
2020060803283	FWD	USDMXN	08/09/2020	(15,930)	21.99	350,221
2020061003034	FWD	USDMXN	08/09/2020	15,930	21.99	(350,221)
20200901033508	FWD	USDMXN	08/09/2020	284,918	21.82	(6,217,479)
2020090103394	FWD	USDMXN	08/09/2020	(105,086)	21.75	2,285,404
2020090103501	FWD	USDMXN	08/09/2020	(284,918)	21.86	6,227,449
2020090103537	FWD	USDMXN	08/09/2020	(284,918)	21.86	6,227,449
2020090303304	FWD	USDMXN	08/09/2020	(24,850,000)	21.69	538,923,193
2020031203180	FWD	USDMXN	09/09/2020	150,000	22.00	(3,300,000)
2020070603062	FWD	USDMXN	09/09/2020	(500,000)	22.32	11,158,850
2020071303283	FWD	USDMXN	09/09/2020	(150,000)	22.00	3,300,000
2020090403311	FWD	USDMXN	09/09/2020	20,000,000	21.60	(431,932,400)
2020030303188	FWD	USDMXN	10/09/2020	(500,000)	19.76	9,878,350
2020030603050	FWD	USDMXN	10/09/2020	500,000	19.76	(9,878,350)
2020042703073	FWD	USDMXN	10/09/2020	29,500	25.23	(744,285)
2020083103394	FWD	USDMXN	10/09/2020	(29,500)	25.23	744,285
2020032603498	FWD	USDMXN	11/09/2020	(500,000)	23.86	11,930,350
2020040603024	FWD	USDMXN	11/09/2020	500,000	23.86	(11,930,350)
2020061803410	FWD	USDMXN	11/09/2020	100,000	22.93	(2,293,000)
2020090103051	FWD	USDMXN	11/09/2020	(100,000)	22.93	2,293,000
2020090803487	FWD	USDMXN	11/09/2020	18,013	21.74	(391,616)
2020091103002	FWD	USDMXN	11/09/2020	20,000,000	21.30	(426,000,000)
2020031903434	FWD	USDMXN	14/09/2020	53,000	24.85	(1,317,050)
2020060803284	FWD	USDMXN	14/09/2020	(15,930)	22.00	350,481
2020061003036	FWD	USDMXN	14/09/2020	15,930	22.00	(350,481)
2020090203297	FWD	USDMXN	14/09/2020	(53,000)	24.85	1,317,050
2020090403128	FWD	USDMXN	14/09/2020	213,545	21.60	(4,612,373)
2020091103003	FWD	USDMXN	14/09/2020	(20,000,000)	21.31	426,154,000
2017091303237	FWD	USDMXN	15/09/2020	(1)	20.51	21
2019121303258	FWD	USDMXN	15/09/2020	(495,944)	19.77	9,804,565
2019121303295	FWD	USDMXN	15/09/2020	(495,944)	19.75	9,794,646
2019121603478	FWD	USDMXN	17/09/2020	(750,000)	19.70	14,771,250
2020031803032	FWD	USDMXN	17/09/2020	750,000	19.70	(14,771,250)
2020031803253	FWD	USDMXN	17/09/2020	(666,667)	24.35	16,233,408
2020031903043	FWD	USDMXN	17/09/2020	666,667	24.35	(16,233,408)
2020031903154	FWD	USDMXN	17/09/2020	666,667	24.70	(16,467,075)
2020032603074	FWD	USDMXN	17/09/2020	(666,667)	24.70	16,467,075
2020090403312	FWD	USDMXN	17/09/2020	(20,000,000)	21.62	432,353,880
2020032603500	FWD	USDMXN	18/09/2020	(500,000)	23.86	11,930,350
2020040603025	FWD	USDMXN	18/09/2020	500,000	23.86	(11,930,350)
2020030303190	FWD	USDMXN	21/09/2020	(500,000)	19.76	9,878,350
2020030603051	FWD	USDMXN	21/09/2020	500,000	19.76	(9,878,350)
2020052803574	FWD	USDMXN	21/09/2020	(15,930)	22.62	360,399
2020060803285	FWD	USDMXN	21/09/2020	(15,930)	22.02	350,783
2020062903237	FWD	USDMXN	21/09/2020	100,000	23.31	(2,331,000)
2020090403326	FWD	USDMXN	21/09/2020	(100,000)	23.31	2,331,000
2020082803177	FWD	USDMXN	22/09/2020	(150,000)	21.92	3,288,525
2020091003059	FWD	USDMXN	22/09/2020	150,000	21.92	(3,288,525)
2020070603098	FWD	USDMXN	24/09/2020	(150,000)	22.48	3,372,270
2020082803178	FWD	USDMXN	24/09/2020	(150,000)	21.93	3,289,335
2020091003060	FWD	USDMXN	24/09/2020	150,000	22.48	(3,372,270)
2020091003061	FWD	USDMXN	24/09/2020	150,000	21.93	(3,289,335)
2019101103490	FWD	USDMXN	25/09/2020	(5,440,000)	20.35	110,695,840
2020021703092	FWD	USDMXN	25/09/2020	(490,000)	19.15	9,383,010
2020031803033	FWD	USDMXN	25/09/2020	490,000	19.15	(9,383,010)
2020031803263	FWD	USDMXN	25/09/2020	(666,666)	24.35	16,233,384
2020031903044	FWD	USDMXN	25/09/2020	666,666	24.35	(16,233,384)
2020031903157	FWD	USDMXN	25/09/2020	666,666	24.70	(16,467,050)
2020032603077	FWD	USDMXN	25/09/2020	(666,666)	24.70	16,467,050
2020050603092	FWD	USDMXN	25/09/2020	149,000	24.72	(3,683,280)
2020060903054	FWD	USDMXN	25/09/2020	3,400,000	22.05	(74,959,565)
2020090403124	FWD	USDMXN	25/09/2020	(149,000)	24.72	3,683,280
2020090103299	FWD	USDMXN	29/09/2020	23,813,588	21.79	(518,779,015)
2019080603148	FWD	USDMXN	30/09/2020	250,000	20.40	(5,100,000)
2019101103605	FWD	USDMXN	30/09/2020	(250,000)	20.40	5,100,000
2020082803493	FWD	USDMXN	30/09/2020	(4,000,000)	21.96	87,832,000
2020092803074	FWD	USDMXN	30/09/2020	4,000,000	21.96	(87,832,000)
2020093003000	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,389,880	22.33	(53,372,425)
2020093003016	FWD	USDMXN	30/09/2020	2,389,880	22.33	(53,366,020)

Liquidados anticipadamente

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P13051	Cap	16/10/2020	Sell	U	MXN					318,462,895
P13154	Cap	04/10/2023	Buy	U	MXN					175,000,000
P13254	Cap	05/09/2022	Sell	U	MXN					600,000,000
P13256	Cap	05/09/2022	Buy	U	MXN					600,000,000
P13563	Cap	03/06/2022	Sell	U	MXN					150,000,000
P14470	Cap	24/08/2023	Buy	U	USD					1,532,155
P14593	Cap	31/08/2023	Buy	U	MXN					50,000,000
P14631	Cap	04/02/2021	Buy	U	MXN					350,000,000
P14632	Cap	04/02/2021	Sell	U	MXN					350,000,000
P14634	Cap	04/02/2021	Sell	U	MXN					350,000,000
P14635	Cap	04/02/2021	Buy	U	MXN					350,000,000
P14766	Cap	03/12/2021	Buy	U	MXN					6,000,300
P14958	Cap	03/12/2021	Buy	U	MXN					5,999,700
P15948	Cap	25/03/2022	Sell	U	MXN					40,000,000
P16207	Cap	15/03/2023	Buy	U	MXN					20,000,000
P16309	Cap	24/08/2023	Sell	U	USD					1,532,155
P16310	Cap	24/08/2023	Sell	U	USD					1,532,155
P16312	Cap	24/08/2023	Sell	U	MXN					17,984,000
P16313	Cap	24/08/2023	Sell	U	MXN					17,984,000
P16314	Cap	24/08/2023	Buy	U	MXN					17,984,000
P16325	Cap	24/08/2023	Buy	U	USD					1,532,155
P16361	Cap	24/08/2023	Buy	U	MXN					17,984,000
P16362	Cap	29/08/2023	Buy	U	MXN					19,000,000
C38366	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	USD	145,560,140	MXN	7,898,000	USD	
C39290	CC Swap	21/01/2026	Buy	U	USD	12,584,000	USD	231,923,120	MXN	
C44655	CC Swap	12/02/2026	Buy	U	USD	1,421,250,000	MXN	75,000,000	USD	
C44714	CC Swap	12/02/2026	Buy	U	USD	75,000,000	USD	1,421,250,000	MXN	
C46272	CC Swap	31/10/2026	Buy	U	USD	2,500,000	USD	48,550,000	MXN	
C46273	CC Swap	31/10/2026	Buy	U	USD	48,550,000	MXN	2,500,000	USD	
C46790	CC Swap	02/05/2023	Buy	U	USD	95,512,500	MXN	5,000,000	USD	
C46791	CC Swap	02/05/2023	Buy	U	USD	5,000,000	USD	95,512,500	MXN	
C51523	CC Swap	15/03/2022	Buy	U	USD	10,000,000	USD	205,450,000	MXN	
C52116	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	USD	10,000,000	USD	193,300,000	MXN	
C52117	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	USD	10,000,000	USD	193,450,000	MXN	
C52118	CC Swap	02/10/2023	Buy	U	USD	10,000,000	USD	193,550,000	MXN	
C52146	CC Swap	06/03/2024	Buy	U	USD	4,000,000	EUR	4,518,000	USD	
C52147	CC Swap	06/03/2024	Buy	U	USD	4,518,000	USD	87,100,000	MXN	
C54548	CC Swap	04/08/2021	Buy	U	USD	5,000,000	USD	98,250,000	MXN	
C55455	CC Swap	30/09/2020	Buy	U	USD	-	MXN	-	USD	
C55518	CC Swap	04/08/2021	Buy	U	USD	98,250,000	MXN	5,000,000	USD	
C60352	CC Swap	31/01/2023	Buy	U	USD	51,413,371	MXN	2,120,139	USD	
C60353	CC Swap	31/01/2023	Buy	U	USD	2,120,139	USD	51,413,371	MXN	
C60354	CC Swap	01/03/2022	Buy	U	USD	22,101,525	MXN	924,750	USD	
C60355	CC Swap	01/03/2022	Buy	U	USD	924,750	USD	22,101,525	MXN	
E52798	Eq Option	13/10/2020	Buy	U	MXN					210,146,830
E52799	Eq Option	13/10/2020	Sell	U	MXN					210,146,830
E52800	Eq Option	13/10/2020	Buy	U	MXN					210,146,830
E52801	Eq Option	13/10/2020	Sell	U	MXN					210,146,830
E56658	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	MXN					71,891,500
E56659	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	MXN					71,891,500
E56660	Eq Option	06/04/2021	Buy	U	MXN					71,891,500
E56661	Eq Option	06/04/2021	Sell	U	MXN					71,891,500
E57576	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	MXN					121,860,000
E57622	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	MXN					121,860,000
E57623	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	MXN					121,860,000
E57624	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	MXN					121,860,000
E62469	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	MXN					114,060,000
E62470	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	MXN					114,060,000
E62471	Eq Option	18/05/2021	Sell	U	MXN					114,060,000
E62473	Eq Option	18/05/2021	Buy	U	MXN					114,060,000
E63420	Eq Option	21/03/2023	Buy	U	MXN					658,991,000
E63421	Eq Option	21/03/2023	Sell	U	MXN					658,991,000
E63422	Eq Option	21/03/2023	Sell	U	MXN					658,991,000
P14633	Floor	04/02/2021	Buy	U	MXN					350,000,000
P14636	Floor	04/02/2021	Sell	U	MXN					350,000,000
SAA012	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	1,383,241	MXN	1,383,241	MXN	
SAA016	SC Swap	31/05/2021	Buy	U	MXN	300,690	MXN	300,690	MXN	
SAA017	SC Swap	30/04/2021	Buy	U	MXN	462,616	MXN	462,616	MXN	
SAA019	SC Swap	30/04/2021	Buy	U	MXN	365,517	MXN	365,517	MXN	
SAA021	SC Swap	31/08/2020	Buy	U	MXN	252,138	MXN	252,138	MXN	

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SAA024	SC Swap	31/08/2022	Buy	U	MXN	1,797,885	MXN	1,797,885	MXN		
SAA026	SC Swap	30/06/2022	Buy	U	MXN	498,165	MXN	498,165	MXN		
SAA030	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	3,147,259	MXN	3,147,259	MXN		
SAA031	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	313,793	MXN	313,793	MXN		
SAA244	SC Swap	29/04/2022	Buy	U	MXN	334,759	MXN	334,759	MXN		
SAC835	SC Swap	17/08/2022	Buy	U	MXN	475,471	MXN	475,471	MXN		
SAC836	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	MXN	2,069,655	MXN	2,069,655	MXN		
SAC837	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	1,792,966	MXN	1,792,966	MXN		
SAC840	SC Swap	31/08/2020	Buy	U	MXN	168,959	MXN	168,959	MXN		
SAC878	SC Swap	31/08/2020	Buy	U	MXN	168,959	MXN	168,959	MXN		
SAC880	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	1,792,966	MXN	1,792,966	MXN		
SAC881	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	MXN	2,069,655	MXN	2,069,655	MXN		
SAC882	SC Swap	17/08/2022	Buy	U	MXN	475,471	MXN	475,471	MXN		
SAE187	SC Swap	28/01/2021	Buy	U	MXN	11,250,000	MXN	11,250,000	MXN		
SAE238	SC Swap	28/01/2021	Buy	U	MXN	11,250,000	MXN	11,250,000	MXN		
SAE522	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	MXN	12,206,667	MXN	12,206,667	MXN		
SAE557	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	MXN	12,206,667	MXN	12,206,667	MXN		
SAE558	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	MXN	12,206,667	MXN	12,206,667	MXN		
SAF715	SC Swap	18/09/2023	Buy	U	MXN	4,068,000	MXN	4,068,000	MXN		
SAF749	SC Swap	18/09/2023	Buy	U	MXN	4,068,000	MXN	4,068,000	MXN		
SAH543	SC Swap	21/12/2028	Buy	U	MXN	60,000,000	MXN	60,000,000	MXN		
SAI209	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	1,784,348	USD	1,784,348	USD		
SAI210	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	1,784,348	USD	1,784,348	USD		
SAI327	SC Swap	29/10/2021	Buy	U	MXN	510,155	MXN	510,155	MXN		
SAI332	SC Swap	29/10/2021	Buy	U	MXN	510,155	MXN	510,155	MXN		
SAJ827	SC Swap	30/03/2023	Buy	U	MXN	12,500,000	MXN	12,500,000	MXN		
SAJ837	SC Swap	30/09/2020	Buy	U	MXN	856,621	MXN	856,621	MXN		
SAJ846	SC Swap	30/03/2023	Buy	U	MXN	12,500,000	MXN	12,500,000	MXN		
SAJ847	SC Swap	30/09/2020	Buy	U	MXN	856,621	MXN	856,621	MXN		
SAL163	SC Swap	01/01/2025	Buy	U	MXN	357,692,609	MXN	357,692,609	MXN		
SAL166	SC Swap	01/01/2025	Buy	U	MXN	357,692,609	MXN	357,692,609	MXN		
SAL319	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	999,894,149	MXN	999,894,149	MXN		
SAL320	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	999,894,149	MXN	999,894,149	MXN		
SAL321	SC Swap	01/06/2022	Buy	U	MXN	581,019,505	MXN	581,019,505	MXN		
SAL322	SC Swap	01/06/2022	Buy	U	MXN	581,019,505	MXN	581,019,505	MXN		
SAL323	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	696,389,800	MXN	696,389,800	MXN		
SAL324	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	696,389,800	MXN	696,389,800	MXN		
SAL325	SC Swap	01/06/2021	Buy	U	MXN	788,942,462	MXN	788,942,462	MXN		
SAL326	SC Swap	01/06/2021	Buy	U	MXN	788,942,462	MXN	788,942,462	MXN		
SAL329	SC Swap	01/06/2021	Buy	U	MXN	407,813,173	MXN	407,813,173	MXN		
SAL330	SC Swap	01/06/2021	Buy	U	MXN	407,813,173	MXN	407,813,173	MXN		
SAL331	SC Swap	01/11/2022	Buy	U	MXN	916,111,092	MXN	916,111,092	MXN		
SAL332	SC Swap	01/11/2022	Buy	U	MXN	916,111,092	MXN	916,111,092	MXN		
SAL333	SC Swap	01/05/2021	Buy	U	MXN	233,259,613	MXN	233,259,613	MXN		
SAL334	SC Swap	01/05/2021	Buy	U	MXN	233,259,613	MXN	233,259,613	MXN		
SAL335	SC Swap	01/07/2020	Buy	U	MXN	417,504,602	MXN	417,504,602	MXN		
SAL336	SC Swap	01/07/2020	Buy	U	MXN	417,504,602	MXN	417,504,602	MXN		
SAL344	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	374,435,365	MXN	374,435,365	MXN		
SAL345	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	374,435,365	MXN	374,435,365	MXN		
SAL346	SC Swap	01/05/2023	Buy	U	MXN	304,042,012	MXN	304,042,012	MXN		
SAL348	SC Swap	01/05/2023	Buy	U	MXN	304,042,012	MXN	304,042,012	MXN		
SAL352	SC Swap	01/08/2023	Buy	U	MXN	382,697,698	MXN	382,697,698	MXN		
SAL365	SC Swap	01/08/2023	Buy	U	MXN	382,697,698	MXN	382,697,698	MXN		
SAL366	SC Swap	01/11/2023	Buy	U	MXN	449,344,668	MXN	449,344,668	MXN		
SAL367	SC Swap	01/11/2023	Buy	U	MXN	449,344,668	MXN	449,344,668	MXN		
SAL368	SC Swap	01/11/2023	Buy	U	MXN	432,640,890	MXN	432,640,890	MXN		
SAL372	SC Swap	01/11/2023	Buy	U	MXN	432,640,890	MXN	432,640,890	MXN		
SAL373	SC Swap	01/12/2024	Buy	U	MXN	322,175,545	MXN	322,175,545	MXN		
SAL375	SC Swap	01/12/2024	Buy	U	MXN	322,175,545	MXN	322,175,545	MXN		
SAL416	SC Swap	22/03/2024	Buy	U	MXN	3,000,000,000	MXN	3,000,000,000	MXN		
SAL939	SC Swap	01/07/2020	Buy	U	MXN	4,955,584,204	MXN	4,955,584,204	MXN		
SAL940	SC Swap	01/07/2020	Buy	U	MXN	4,955,584,204	MXN	4,955,584,204	MXN		
SAL944	SC Swap	01/09/2021	Buy	U	MXN	396,791,758	MXN	396,791,758	MXN		
SAL945	SC Swap	01/09/2021	Buy	U	MXN	396,791,758	MXN	396,791,758	MXN		
SAL947	SC Swap	01/10/2021	Buy	U	MXN	720,471,811	MXN	720,471,811	MXN		
SAL948	SC Swap	01/10/2021	Buy	U	MXN	720,471,811	MXN	720,471,811	MXN		
SAL949	SC Swap	01/11/2021	Buy	U	MXN	614,563,093	MXN	614,563,093	MXN		
SAL950	SC Swap	01/11/2021	Buy	U	MXN	614,563,093	MXN	614,563,093	MXN		
SAL951	SC Swap	01/12/2021	Buy	U	MXN	359,844,676	MXN	359,844,676	MXN		
SAL952	SC Swap	01/12/2021	Buy	U	MXN	359,844,676	MXN	359,844,676	MXN		
SAL953	SC Swap	01/01/2022	Buy	U	MXN	383,639,354	MXN	383,639,354	MXN		
SAL954	SC Swap	01/01/2022	Buy	U	MXN	383,639,354	MXN	383,639,354	MXN		
SAL955	SC Swap	01/02/2022	Buy	U	MXN	365,952,254	MXN	365,952,254	MXN		
SAL957	SC Swap	01/02/2022	Buy	U	MXN	365,952,254	MXN	365,952,254	MXN		

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SAL958	SC Swap	01/03/2022	Buy	U	MXN	304,849,293	MXN	304,849,293	MXN		
SAL959	SC Swap	01/03/2022	Buy	U	MXN	304,849,293	MXN	304,849,293	MXN		
SAL960	SC Swap	01/05/2022	Buy	U	MXN	551,284,523	MXN	551,284,523	MXN		
SAL961	SC Swap	01/05/2022	Buy	U	MXN	551,284,523	MXN	551,284,523	MXN		
SAL962	SC Swap	01/06/2022	Buy	U	MXN	341,977,337	MXN	341,977,337	MXN		
SAL963	SC Swap	01/06/2022	Buy	U	MXN	341,977,337	MXN	341,977,337	MXN		
SAL964	SC Swap	01/07/2022	Buy	U	MXN	304,122,144	MXN	304,122,144	MXN		
SAL965	SC Swap	01/07/2022	Buy	U	MXN	304,122,144	MXN	304,122,144	MXN		
SAL967	SC Swap	01/08/2022	Buy	U	MXN	319,646,475	MXN	319,646,475	MXN		
SAL968	SC Swap	01/08/2022	Buy	U	MXN	319,646,475	MXN	319,646,475	MXN		
SAL972	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	316,958,540	MXN	316,958,540	MXN		
SAL973	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	316,958,540	MXN	316,958,540	MXN		
SAL974	SC Swap	01/12/2022	Buy	U	MXN	843,178,880	MXN	843,178,880	MXN		
SAL978	SC Swap	01/12/2022	Buy	U	MXN	843,178,880	MXN	843,178,880	MXN		
SAL979	SC Swap	01/12/2021	Buy	U	MXN	458,669,543	MXN	458,669,543	MXN		
SAL980	SC Swap	01/12/2021	Buy	U	MXN	458,669,543	MXN	458,669,543	MXN		
SAL982	SC Swap	01/01/2022	Buy	U	MXN	417,323,949	MXN	417,323,949	MXN		
SAL984	SC Swap	01/01/2022	Buy	U	MXN	417,323,949	MXN	417,323,949	MXN		
SAL993	SC Swap	01/04/2021	Buy	U	MXN	304,294,123	MXN	304,294,123	MXN		
SAL994	SC Swap	01/04/2021	Buy	U	MXN	304,294,123	MXN	304,294,123	MXN		
SAL995	SC Swap	01/05/2021	Buy	U	MXN	371,789,372	MXN	371,789,372	MXN		
SAL996	SC Swap	01/05/2021	Buy	U	MXN	371,789,372	MXN	371,789,372	MXN		
SAL997	SC Swap	01/07/2021	Buy	U	MXN	303,647,375	MXN	303,647,375	MXN		
SAL998	SC Swap	01/07/2021	Buy	U	MXN	303,647,375	MXN	303,647,375	MXN		
SAL999	SC Swap	01/01/2023	Buy	U	MXN	453,656,733	MXN	453,656,733	MXN		
SAM002	SC Swap	01/01/2023	Buy	U	MXN	453,656,733	MXN	453,656,733	MXN		
SAM024	SC Swap	01/02/2023	Buy	U	MXN	405,862,428	MXN	405,862,428	MXN		
SAM027	SC Swap	01/02/2023	Buy	U	MXN	405,862,428	MXN	405,862,428	MXN		
SAM030	SC Swap	01/03/2022	Buy	U	MXN	355,297,936	MXN	355,297,936	MXN		
SAM031	SC Swap	01/03/2022	Buy	U	MXN	355,297,936	MXN	355,297,936	MXN		
SAM032	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	357,138,073	MXN	357,138,073	MXN		
SAM033	SC Swap	01/04/2023	Buy	U	MXN	357,138,073	MXN	357,138,073	MXN		
SAM034	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	874,417,952	MXN	874,417,952	MXN		
SAM037	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	874,417,952	MXN	874,417,952	MXN		
SAM039	SC Swap	01/07/2023	Buy	U	MXN	291,068,118	MXN	291,068,118	MXN		
SAM040	SC Swap	01/07/2023	Buy	U	MXN	291,068,118	MXN	291,068,118	MXN		
SAM041	SC Swap	01/08/2024	Buy	U	MXN	343,064,504	MXN	343,064,504	MXN		
SAM042	SC Swap	01/08/2024	Buy	U	MXN	343,064,504	MXN	343,064,504	MXN		
SAM043	SC Swap	01/09/2024	Buy	U	MXN	198,700,855	MXN	198,700,855	MXN		
SAM045	SC Swap	01/09/2024	Buy	U	MXN	198,700,855	MXN	198,700,855	MXN		
SAM049	SC Swap	01/11/2024	Buy	U	MXN	311,158,492	MXN	311,158,492	MXN		
SAM050	SC Swap	01/11/2024	Buy	U	MXN	311,158,492	MXN	311,158,492	MXN		
SAN828	SC Swap	29/03/2021	Buy	U	MXN	1,773,354	MXN	1,773,354	MXN		
SAN836	SC Swap	29/03/2021	Buy	U	MXN	1,773,354	MXN	1,773,354	MXN		
SAN903	SC Swap	29/07/2020	Buy	U	USD	2,125,181	USD	2,125,181	USD		
SAN917	SC Swap	29/07/2020	Buy	U	USD	2,125,181	USD	2,125,181	USD		
SAR290	SC Swap	21/04/2024	Buy	U	MXN	23,370,000	MXN	23,370,000	MXN		
SAR319	SC Swap	21/04/2024	Buy	U	MXN	23,370,000	MXN	23,370,000	MXN		
SAS943	SC Swap	20/05/2021	Buy	U	MXN	2,691,378	MXN	2,691,378	MXN		
SAS974	SC Swap	20/05/2021	Buy	U	MXN	2,691,378	MXN	2,691,378	MXN		
SAT576	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		
SAT577	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		
SAU079	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		
SAU385	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		
SAU617	SC Swap	31/07/2023	Buy	U	MXN	25,000,000	MXN	25,000,000	MXN		
SAU619	SC Swap	31/07/2023	Buy	U	MXN	25,000,000	MXN	25,000,000	MXN		
SAU881	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	30,000,000	USD	30,000,000	USD		
SAU882	SC Swap	13/09/2029	Buy	U	USD	30,000,000	USD	30,000,000	USD		
SAV204	SC Swap	28/06/2024	Buy	U	MXN	62,948,402	MXN	62,948,402	MXN		
SAV557	SC Swap	11/07/2020	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SAV643	SC Swap	11/07/2024	Buy	U	MXN	44,398,626	MXN	44,398,626	MXN		
SAV685	SC Swap	11/07/2024	Buy	U	MXN	44,398,626	MXN	44,398,626	MXN		
SAV708	SC Swap	29/06/2029	Buy	U	MXN	220,000,000	MXN	220,000,000	MXN		
SAW059	SC Swap	31/05/2022	Buy	U	MXN	16,000,000	MXN	16,000,000	MXN		
SAW089	SC Swap	31/05/2022	Buy	U	MXN	16,000,000	MXN	16,000,000	MXN		
SAW330	SC Swap	23/07/2020	Buy	U	MXN	100,000	MXN	100,000	MXN		
SAY445	SC Swap	07/06/2024	Buy	U	MXN	81,900,000	MXN	81,900,000	MXN		
SAY991	SC Swap	21/08/2020	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SAY992	SC Swap	21/08/2021	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SAZ062	SC Swap	22/08/2020	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SAZ069	SC Swap	22/08/2021	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SAZ662	SC Swap	29/08/2024	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		
SAZ719	SC Swap	29/08/2024	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		
SAZ812	SC Swap	02/09/2024	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CuriD	PaySide Current Notional	PaySide CuriD	RcvSide Current Notional	RcvSide CuriD	Option	Notional
SAZ957	SC Swap	28/08/2020	Buy	U	USD	971,618	USD	971,618	USD		USD
SBA025	SC Swap	28/08/2020	Buy	U	USD	971,618	USD	971,618	USD		USD
SBA074	SC Swap	01/01/2025	Buy	U	MXN	4,532,762,474	MXN	4,532,762,474	MXN		MXN
SBA075	SC Swap	01/01/2025	Buy	U	MXN	4,532,762,474	MXN	4,532,762,474	MXN		MXN
SBA079	SC Swap	01/02/2025	Buy	U	MXN	512,021,414	MXN	512,021,414	MXN		MXN
SBA080	SC Swap	01/02/2025	Buy	U	MXN	512,021,414	MXN	512,021,414	MXN		MXN
SBA081	SC Swap	01/04/2024	Buy	U	MXN	443,251,822	MXN	443,251,822	MXN		MXN
SBA082	SC Swap	01/04/2024	Buy	U	MXN	443,251,822	MXN	443,251,822	MXN		MXN
SBA083	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	650,084,221	MXN	650,084,221	MXN		MXN
SBA087	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	650,084,221	MXN	650,084,221	MXN		MXN
SBA088	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	222,999,504	MXN	222,999,504	MXN		MXN
SBA089	SC Swap	01/05/2024	Buy	U	MXN	222,999,504	MXN	222,999,504	MXN		MXN
SBA459	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	3,487,005	MXN	3,487,005	MXN		MXN
SBA484	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	3,487,005	MXN	3,487,005	MXN		MXN
SBE666	SC Swap	14/07/2020	Buy	U	MXN	6,459,994	MXN	6,459,994	MXN		MXN
SBE681	SC Swap	14/07/2020	Buy	U	MXN	6,459,994	MXN	6,459,994	MXN		MXN
SBE791	SC Swap	24/10/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SBE889	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		USD
SBE893	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		USD
SBF033	SC Swap	01/11/2024	Buy	U	MXN	3,589,205,874	MXN	3,589,205,874	MXN		MXN
SBF034	SC Swap	01/11/2024	Buy	U	MXN	3,589,205,874	MXN	3,589,205,874	MXN		MXN
SBF035	SC Swap	01/08/2023	Buy	U	MXN	199,755,399	MXN	199,755,399	MXN		MXN
SBF036	SC Swap	01/08/2023	Buy	U	MXN	199,755,399	MXN	199,755,399	MXN		MXN
SBF037	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	547,519,477	MXN	547,519,477	MXN		MXN
SBF038	SC Swap	01/09/2022	Buy	U	MXN	547,519,477	MXN	547,519,477	MXN		MXN
SBF039	SC Swap	01/12/2024	Buy	U	MXN	471,675,452	MXN	471,675,452	MXN		MXN
SBF040	SC Swap	01/12/2024	Buy	U	MXN	471,675,452	MXN	471,675,452	MXN		MXN
SBF041	SC Swap	01/06/2025	Buy	U	MXN	252,178,445	MXN	252,178,445	MXN		MXN
SBF042	SC Swap	01/06/2025	Buy	U	MXN	252,178,445	MXN	252,178,445	MXN		MXN
SBF902	SC Swap	31/10/2024	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		MXN
SBJ675	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	19,944,000	MXN	19,944,000	MXN		MXN
SBJ678	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	19,944,000	MXN	19,944,000	MXN		MXN
SBL282	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	10,000,000	USD	10,000,000	USD		USD
SBL405	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		USD
SBM467	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	MXN	19,607,173	MXN	19,607,173	MXN		MXN
SBM537	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	MXN	19,607,173	MXN	19,607,173	MXN		MXN
SBO862	SC Swap	21/04/2024	Buy	U	MXN	20,866,071	MXN	20,866,071	MXN		MXN
SBO926	SC Swap	21/04/2024	Buy	U	MXN	20,866,071	MXN	20,866,071	MXN		MXN
SBO941	SC Swap	08/03/2021	Buy	U	USD	331,063	USD	331,063	USD		USD
SBQ911	SC Swap	08/03/2021	Buy	U	USD	331,063	USD	331,063	USD		USD
SBW808	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	10,000,000	USD	10,000,000	USD		USD
SBW810	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		USD
SBW819	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD		USD
SBX309	SC Swap	01/02/2026	Buy	U	MXN	526,216,790	MXN	526,216,790	MXN		MXN
SBX310	SC Swap	01/02/2026	Buy	U	MXN	526,216,790	MXN	526,216,790	MXN		MXN
SCB751	SC Swap	16/10/2020	Buy	U	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN		MXN
SCB837	SC Swap	16/10/2020	Buy	U	MXN	4,000,000	MXN	4,000,000	MXN		MXN
SCD539	SC Swap	30/08/2022	Buy	U	MXN	162,000,000	MXN	162,000,000	MXN		MXN
SCD541	SC Swap	29/02/2024	Buy	U	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN		MXN
SCD831	SC Swap	07/06/2024	Buy	U	MXN	81,900,000	MXN	81,900,000	MXN		MXN
SCD856	SC Swap	07/06/2024	Buy	U	MXN	81,900,000	MXN	81,900,000	MXN		MXN
SCD908	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	10,056,000	MXN	10,056,000	MXN		MXN
SCD909	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	10,056,000	MXN	10,056,000	MXN		MXN
SCG387	SC Swap	30/08/2022	Buy	U	MXN	162,000,000	MXN	162,000,000	MXN		MXN
SCJ595	SC Swap	09/07/2025	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
SCN725	SC Swap	16/08/2030	Buy	U	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN		MXN
SCN727	SC Swap	16/08/2030	Buy	U	MXN	130,000,000	MXN	130,000,000	MXN		MXN
SCN928	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN		MXN
ST1066	SC Swap	09/06/2022	Buy	U	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN		MXN
ST1127	SC Swap	11/05/2023	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		MXN
ST5292	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
ST5346	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
ST6203	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SU0411	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SU0416	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SU0418	SC Swap	28/03/2024	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SU5225	SC Swap	17/11/2021	Buy	U	MXN	3,300,000	MXN	3,300,000	MXN		MXN
SU5244	SC Swap	17/11/2021	Buy	U	MXN	6,700,000	MXN	6,700,000	MXN		MXN
SU5341	SC Swap	01/07/2021	Buy	U	MXN	28,966,667	MXN	28,966,667	MXN		MXN
SU5346	SC Swap	03/08/2021	Buy	U	MXN	41,607,067	MXN	41,607,067	MXN		MXN
SU6288	SC Swap	31/03/2021	Buy	U	MXN	15,000,000	MXN	15,000,000	MXN		MXN
SU6492	SC Swap	31/12/2026	Buy	U	MXN	67,000,000	MXN	67,000,000	MXN		MXN
SU6756	SC Swap	04/08/2020	Buy	U	USD	30,000,000	USD	30,000,000	USD		USD
SU6810	SC Swap	05/10/2023	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SU6819	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	MXN	14,200,000	MXN	14,200,000	MXN		
SU7020	SC Swap	11/03/2022	Buy	U	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN		
SU7281	SC Swap	19/02/2021	Buy	U	MXN	22,600,000	MXN	22,600,000	MXN		
SU7418	SC Swap	04/08/2020	Buy	U	USD	30,000,000	USD	30,000,000	USD		
SU7527	SC Swap	04/12/2020	Buy	U	MXN	16,936,795	MXN	16,936,795	MXN		
SU7676	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	3,155,724	MXN	3,155,724	MXN		
SU8010	SC Swap	11/03/2022	Buy	U	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN		
SU9578	SC Swap	19/02/2021	Buy	U	MXN	22,600,000	MXN	22,600,000	MXN		
SU9585	SC Swap	31/03/2021	Buy	U	MXN	15,000,000	MXN	15,000,000	MXN		
SU9625	SC Swap	04/03/2021	Buy	U	MXN	14,200,000	MXN	14,200,000	MXN		
SU9642	SC Swap	17/11/2021	Buy	U	MXN	6,700,000	MXN	6,700,000	MXN		
SU9646	SC Swap	01/07/2021	Buy	U	MXN	28,966,667	MXN	28,966,667	MXN		
SU9647	SC Swap	03/08/2021	Buy	U	MXN	41,607,067	MXN	41,607,067	MXN		
SU9707	SC Swap	11/03/2022	Buy	U	MXN	2,000,000	MXN	2,000,000	MXN		
SU9721	SC Swap	20/12/2021	Buy	U	MXN	19,030,250	MXN	19,030,250	MXN		
SU9731	SC Swap	11/03/2022	Buy	U	MXN	1,000,000	MXN	1,000,000	MXN		
SU9738	SC Swap	17/11/2021	Buy	U	MXN	3,300,000	MXN	3,300,000	MXN		
SU9763	SC Swap	04/12/2020	Buy	U	MXN	16,936,795	MXN	16,936,795	MXN		
SU9770	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	3,155,724	MXN	3,155,724	MXN		
SV0954	SC Swap	14/07/2021	Buy	U	MXN	6,329,543	MXN	6,329,543	MXN		
SV0958	SC Swap	14/07/2020	Buy	U	MXN	6,459,994	MXN	6,459,994	MXN		
SV0963	SC Swap	14/07/2020	Buy	U	MXN	6,459,994	MXN	6,459,994	MXN		
SV1092	SC Swap	14/07/2021	Buy	U	MXN	6,329,543	MXN	6,329,543	MXN		
SV1907	SC Swap	26/07/2021	Buy	U	MXN	12,343,072	MXN	12,343,072	MXN		
SV1927	SC Swap	26/07/2021	Buy	U	MXN	12,343,072	MXN	12,343,072	MXN		
SV2985	SC Swap	06/08/2021	Buy	U	MXN	35,000,000	MXN	35,000,000	MXN		
SV2987	SC Swap	06/08/2021	Buy	U	MXN	35,000,000	MXN	35,000,000	MXN		
SV3941	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV3942	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV3943	SC Swap	23/12/2020	Buy	U	MXN	211,552,608	MXN	211,552,608	MXN		
SV3947	SC Swap	20/06/2021	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SV3948	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	143,678,161	MXN	143,678,161	MXN		
SV3949	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	106,321,839	MXN	106,321,839	MXN		
SV3950	SC Swap	29/09/2021	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN		
SV3951	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	MXN	105,000,000	MXN	105,000,000	MXN		
SV3957	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	MXN	3,000,000,000	MXN	3,000,000,000	MXN		
SV4001	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV4002	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV4007	SC Swap	20/06/2021	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SV4008	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	143,678,161	MXN	143,678,161	MXN		
SV4009	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	106,321,839	MXN	106,321,839	MXN		
SV4010	SC Swap	29/09/2021	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN		
SV4011	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	MXN	105,000,000	MXN	105,000,000	MXN		
SV4061	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV4062	SC Swap	01/12/2020	Buy	U	MXN	138,333,333	MXN	138,333,333	MXN		
SV4067	SC Swap	20/06/2021	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SV4068	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	143,678,161	MXN	143,678,161	MXN		
SV4069	SC Swap	28/09/2021	Buy	U	MXN	106,321,839	MXN	106,321,839	MXN		
SV4070	SC Swap	29/09/2021	Buy	U	MXN	300,000,000	MXN	300,000,000	MXN		
SV4071	SC Swap	30/09/2021	Buy	U	MXN	105,000,000	MXN	105,000,000	MXN		
SV4077	SC Swap	08/03/2023	Buy	U	MXN	3,000,000,000	MXN	3,000,000,000	MXN		
SV4167	SC Swap	09/06/2022	Buy	U	MXN	250,000,000	MXN	250,000,000	MXN		
SV4195	SC Swap	11/05/2023	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SV4833	SC Swap	30/08/2020	Buy	U	MXN	4,595,453	MXN	4,595,453	MXN		
SV4834	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	7,034,137	MXN	7,034,137	MXN		
SV4852	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	7,034,137	MXN	7,034,137	MXN		
SV4855	SC Swap	30/08/2020	Buy	U	MXN	4,595,453	MXN	4,595,453	MXN		
SV4991	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SV5006	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		
SV5007	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SV5024	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	100,000,000	MXN	100,000,000	MXN		
SV5034	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		
SV5118	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	85,000,000	MXN	85,000,000	MXN		
SV5143	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	85,000,000	MXN	85,000,000	MXN		
SV5144	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	85,000,000	MXN	85,000,000	MXN		
SV6682	SC Swap	14/09/2022	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		
SV6719	SC Swap	19/09/2021	Buy	U	MXN	7,274,940	MXN	7,274,940	MXN		
SV6720	SC Swap	19/09/2020	Buy	U	MXN	2,469,174	MXN	2,469,174	MXN		
SV6911	SC Swap	19/09/2021	Buy	U	MXN	7,274,940	MXN	7,274,940	MXN		
SV6912	SC Swap	19/09/2020	Buy	U	MXN	2,469,174	MXN	2,469,174	MXN		
SV7072	SC Swap	16/09/2022	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		
SV7545	SC Swap	14/09/2022	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		
SV7546	SC Swap	16/09/2022	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN		
SV8375	SC Swap	06/10/2020	Buy	U	MXN	5,410,028	MXN	5,410,028	MXN		

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SV8376	SC Swap	06/10/2021	Buy	U	MXN	3,249,719	MXN	3,249,719	MXN		MXN
SV8403	SC Swap	06/10/2020	Buy	U	MXN	5,410,028	MXN	5,410,028	MXN		MXN
SV8404	SC Swap	06/10/2021	Buy	U	MXN	3,249,719	MXN	3,249,719	MXN		MXN
SV9788	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	778,305	USD	778,305	USD		USD
SV9789	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	778,305	USD	778,305	USD		USD
SV9973	SC Swap	23/10/2020	Buy	U	MXN	3,353,899	MXN	3,353,899	MXN		MXN
SV9974	SC Swap	23/10/2021	Buy	U	MXN	4,364,286	MXN	4,364,286	MXN		MXN
SW0003	SC Swap	23/10/2020	Buy	U	MXN	3,353,899	MXN	3,353,899	MXN		MXN
SW0004	SC Swap	23/10/2021	Buy	U	MXN	4,364,286	MXN	4,364,286	MXN		MXN
SW2159	SC Swap	31/10/2022	Buy	U	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN		MXN
SW2255	SC Swap	16/11/2020	Buy	U	MXN	3,736,897	MXN	3,736,897	MXN		MXN
SW2256	SC Swap	16/11/2021	Buy	U	MXN	2,721,793	MXN	2,721,793	MXN		MXN
SW2276	SC Swap	16/11/2020	Buy	U	MXN	3,736,897	MXN	3,736,897	MXN		MXN
SW2277	SC Swap	16/11/2021	Buy	U	MXN	2,721,793	MXN	2,721,793	MXN		MXN
SW2621	SC Swap	31/10/2022	Buy	U	MXN	10,000,000	MXN	10,000,000	MXN		MXN
SW4451	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	341,963	USD	341,963	USD		USD
SW4462	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	341,963	USD	341,963	USD		USD
SW4575	SC Swap	11/12/2020	Buy	U	MXN	11,104,607	MXN	11,104,607	MXN		MXN
SW4579	SC Swap	11/12/2021	Buy	U	MXN	8,771,870	MXN	8,771,870	MXN		MXN
SW4585	SC Swap	11/12/2021	Buy	U	MXN	8,771,870	MXN	8,771,870	MXN		MXN
SW4590	SC Swap	11/12/2020	Buy	U	MXN	11,104,607	MXN	11,104,607	MXN		MXN
SW5279	SC Swap	15/12/2021	Buy	U	MXN	4,296,637	MXN	4,296,637	MXN		MXN
SW5293	SC Swap	15/12/2021	Buy	U	MXN	4,296,637	MXN	4,296,637	MXN		MXN
SW5898	SC Swap	26/12/2020	Buy	U	MXN	2,098,869	MXN	2,098,869	MXN		MXN
SW5908	SC Swap	26/12/2020	Buy	U	MXN	2,098,869	MXN	2,098,869	MXN		MXN
SW6863	SC Swap	31/10/2022	Buy	U	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN		MXN
SW6864	SC Swap	31/10/2022	Buy	U	MXN	6,000,000	MXN	6,000,000	MXN		MXN
SW9108	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	MXN	27,000,000	MXN	27,000,000	MXN		MXN
SW9119	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	MXN	27,000,000	MXN	27,000,000	MXN		MXN
SX4085	SC Swap	30/11/2021	Buy	U	MXN	193,087,327	MXN	193,087,327	MXN		MXN
SX4276	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	43,500,000	USD	43,500,000	USD		USD
SX4317	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	MXN	21,947,684	MXN	21,947,684	MXN		MXN
SX4321	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	USD	592,080	USD	592,080	USD		USD
SX4324	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	43,500,000	USD	43,500,000	USD		USD
SX4326	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	USD	1,888,120	USD	1,888,120	USD		USD
SX4327	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	MXN	17,326,251	MXN	17,326,251	MXN		MXN
SX4337	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	MXN	21,947,684	MXN	21,947,684	MXN		MXN
SX4338	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	USD	592,080	USD	592,080	USD		USD
SX4339	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	USD	1,888,120	USD	1,888,120	USD		USD
SX4340	SC Swap	23/02/2023	Buy	U	MXN	17,326,251	MXN	17,326,251	MXN		MXN
SX4973	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	192,653	USD	192,653	USD		USD
SX4981	SC Swap	30/09/2022	Buy	U	USD	192,653	USD	192,653	USD		USD
SX5669	SC Swap	10/03/2022	Buy	U	MXN	14,255,324	MXN	14,255,324	MXN		MXN
SX5673	SC Swap	12/03/2021	Buy	U	MXN	8,146,930	MXN	8,146,930	MXN		MXN
SX5674	SC Swap	12/03/2022	Buy	U	MXN	12,884,032	MXN	12,884,032	MXN		MXN
SX5684	SC Swap	10/03/2022	Buy	U	MXN	14,255,324	MXN	14,255,324	MXN		MXN
SX5686	SC Swap	12/03/2022	Buy	U	MXN	12,884,032	MXN	12,884,032	MXN		MXN
SX5687	SC Swap	12/03/2021	Buy	U	MXN	8,146,930	MXN	8,146,930	MXN		MXN
SX6075	SC Swap	01/03/2021	Buy	U	MXN	225,000,000	MXN	225,000,000	MXN		MXN
SX6132	SC Swap	04/10/2023	Buy	U	MXN	175,000,000	MXN	175,000,000	MXN		MXN
SX6133	SC Swap	04/10/2023	Buy	U	MXN	175,000,000	MXN	175,000,000	MXN		MXN
SX6137	SC Swap	05/10/2023	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SX6138	SC Swap	05/10/2023	Buy	U	MXN	500,000,000	MXN	500,000,000	MXN		MXN
SX6139	SC Swap	30/08/2022	Buy	U	MXN	162,000,000	MXN	162,000,000	MXN		MXN
SX6155	SC Swap	04/08/2021	Buy	U	MXN	295,000,000	MXN	295,000,000	MXN		MXN
SX6208	SC Swap	31/12/2026	Buy	U	MXN	67,000,000	MXN	67,000,000	MXN		MXN
SX6540	SC Swap	30/11/2022	Buy	U	MXN	17,871,000	MXN	17,871,000	MXN		MXN
SX7326	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	3,983,264	USD	3,983,264	USD		USD
SX7329	SC Swap	27/01/2023	Buy	U	USD	3,983,264	USD	3,983,264	USD		USD
SX9024	SC Swap	26/03/2022	Buy	U	MXN	2,266,966	MXN	2,266,966	MXN		MXN
SX9025	SC Swap	26/03/2021	Buy	U	MXN	1,248,950	MXN	1,248,950	MXN		MXN
SX9048	SC Swap	26/03/2022	Buy	U	MXN	2,266,966	MXN	2,266,966	MXN		MXN
SX9049	SC Swap	26/03/2021	Buy	U	MXN	1,248,950	MXN	1,248,950	MXN		MXN
SY0665	SC Swap	16/03/2023	Buy	U	MXN	570,000,000	MXN	570,000,000	MXN		MXN
SY2899	SC Swap	25/04/2021	Buy	U	MXN	3,313,597	MXN	3,313,597	MXN		MXN
SY2901	SC Swap	25/04/2022	Buy	U	MXN	4,721,869	MXN	4,721,869	MXN		MXN
SY2945	SC Swap	25/04/2021	Buy	U	MXN	3,313,597	MXN	3,313,597	MXN		MXN
SY2947	SC Swap	25/04/2022	Buy	U	MXN	4,721,869	MXN	4,721,869	MXN		MXN
SY3806	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN		MXN
SY3877	SC Swap	04/05/2023	Buy	U	USD	2,525,710	USD	2,525,710	USD		USD
SY3878	SC Swap	04/05/2023	Buy	U	USD	2,525,710	USD	2,525,710	USD		USD
SY3910	SC Swap	23/03/2023	Buy	U	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN		MXN
SY3915	SC Swap	04/05/2023	Buy	U	USD	2,525,710	USD	2,525,710	USD		USD
SY4269	SC Swap	09/05/2021	Buy	U	MXN	5,049,708	MXN	5,049,708	MXN		MXN

TransID	ProductID	MaturityDate	Buy/Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Current Notional	PaySide CurID	RcvSide Current Notional	RcvSide CurID	Option	Notional
SY4275	SC Swap	09/05/2022	Buy	U	MXN	12,147,595	MXN	12,147,595	MXN		
SY4286	SC Swap	09/05/2022	Buy	U	MXN	12,147,595	MXN	12,147,595	MXN		
SY4288	SC Swap	09/05/2021	Buy	U	MXN	5,049,708	MXN	5,049,708	MXN		
SY5493	SC Swap	30/04/2021	Buy	U	MXN	50,000,000	MXN	50,000,000	MXN		
SY5666	SC Swap	23/05/2021	Buy	U	MXN	6,661,154	MXN	6,661,154	MXN		
SY5671	SC Swap	23/04/2022	Buy	U	MXN	4,295,757	MXN	4,295,757	MXN		
SY5677	SC Swap	23/05/2021	Buy	U	MXN	6,661,154	MXN	6,661,154	MXN		
SY5681	SC Swap	23/04/2022	Buy	U	MXN	4,295,757	MXN	4,295,757	MXN		
SY6938	SC Swap	31/03/2022	Buy	U	MXN	166,666,667	MXN	166,666,667	MXN		
SY6940	SC Swap	31/03/2022	Buy	U	MXN	166,666,667	MXN	166,666,667	MXN		
SY6942	SC Swap	31/03/2022	Buy	U	MXN	166,666,667	MXN	166,666,667	MXN		
SY7121	SC Swap	05/06/2021	Buy	U	MXN	30,000,000	MXN	30,000,000	MXN		
SY7910	SC Swap	12/06/2023	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SY7911	SC Swap	12/06/2023	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SY7931	SC Swap	20/12/2021	Buy	U	MXN	6,682,946	MXN	6,682,946	MXN		
SY7944	SC Swap	12/06/2023	Buy	U	MXN	150,000,000	MXN	150,000,000	MXN		
SY7945	SC Swap	20/12/2021	Buy	U	MXN	6,682,946	MXN	6,682,946	MXN		
SY7971	SC Swap	29/03/2022	Buy	U	MXN	33,333,333	MXN	33,333,333	MXN		
SY7994	SC Swap	31/12/2020	Buy	U	MXN	34,559,649	MXN	34,559,649	MXN		
SY7998	SC Swap	12/06/2021	Buy	U	MXN	3,026,026	MXN	3,026,026	MXN		
SY7999	SC Swap	12/06/2022	Buy	U	MXN	5,224,735	MXN	5,224,735	MXN		
SY8002	SC Swap	13/05/2021	Buy	U	MXN	1,739,310	MXN	1,739,310	MXN		
SY8028	SC Swap	29/03/2022	Buy	U	MXN	33,333,333	MXN	33,333,333	MXN		
SY8030	SC Swap	31/12/2020	Buy	U	MXN	34,559,649	MXN	34,559,649	MXN		
SY8032	SC Swap	13/05/2021	Buy	U	MXN	1,739,310	MXN	1,739,310	MXN		
SY8033	SC Swap	12/06/2021	Buy	U	MXN	3,026,026	MXN	3,026,026	MXN		
SY8034	SC Swap	12/06/2022	Buy	U	MXN	5,224,735	MXN	5,224,735	MXN		
SY8311	SC Swap	31/05/2023	Buy	U	MXN	7,979,822	MXN	7,979,822	MXN		
SY8341	SC Swap	31/05/2023	Buy	U	MXN	7,979,822	MXN	7,979,822	MXN		
SZ2444	SC Swap	17/07/2020	Buy	U	MXN	620,662	MXN	620,662	MXN		
SZ2584	SC Swap	17/07/2020	Buy	U	MXN	620,662	MXN	620,662	MXN		
SZ5102	SC Swap	31/07/2020	Buy	U	MXN	552,701	MXN	552,701	MXN		
SZ5103	SC Swap	31/07/2021	Buy	U	MXN	2,063,352	MXN	2,063,352	MXN		
SZ5130	SC Swap	31/07/2020	Buy	U	MXN	552,701	MXN	552,701	MXN		
SZ5133	SC Swap	31/07/2021	Buy	U	MXN	2,063,352	MXN	2,063,352	MXN		
SZ5149	SC Swap	31/07/2022	Buy	U	MXN	4,862,419	MXN	4,862,419	MXN		
SZ5167	SC Swap	31/07/2022	Buy	U	MXN	4,862,419	MXN	4,862,419	MXN		
SZ6255	SC Swap	07/08/2020	Buy	U	MXN	11,428,572	MXN	11,428,572	MXN		
SZ6283	SC Swap	07/08/2020	Buy	U	MXN	11,428,572	MXN	11,428,572	MXN		
SZ6687	SC Swap	30/08/2020	Buy	U	MXN	344,828	MXN	344,828	MXN		
SZ6698	SC Swap	05/08/2022	Buy	U	MXN	2,141,028	MXN	2,141,028	MXN		
SZ6699	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	2,193,163	MXN	2,193,163	MXN		
SZ6734	SC Swap	30/08/2020	Buy	U	MXN	344,828	MXN	344,828	MXN		
SZ6736	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	2,193,163	MXN	2,193,163	MXN		
SZ6737	SC Swap	05/08/2022	Buy	U	MXN	2,141,028	MXN	2,141,028	MXN		
SZ6889	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN		
SZ6992	SC Swap	30/08/2021	Buy	U	MXN	5,000,000	MXN	5,000,000	MXN		
SZ7550	SC Swap	11/04/2021	Buy	U	MXN	53,859,000	MXN	53,859,000	MXN		
SZ7551	SC Swap	11/04/2021	Buy	U	MXN	55,000,000	MXN	55,000,000	MXN		
SZ7552	SC Swap	11/04/2021	Buy	U	MXN	15,000,000	MXN	15,000,000	MXN		
SZ8046	SC Swap	18/09/2023	Buy	U	MXN	16,500,000	MXN	16,500,000	MXN		
SZ8065	SC Swap	18/09/2023	Buy	U	MXN	16,500,000	MXN	16,500,000	MXN		
SZ8302	SC Swap	21/09/2021	Buy	U	MXN	2,373,000	MXN	2,373,000	MXN		
SZ8310	SC Swap	21/09/2021	Buy	U	MXN	3,455,693	MXN	3,455,693	MXN		
SZ8312	SC Swap	21/09/2022	Buy	U	MXN	5,015,657	MXN	5,015,657	MXN		
SZ8326	SC Swap	21/09/2021	Buy	U	MXN	3,455,693	MXN	3,455,693	MXN		
SZ8327	SC Swap	21/09/2022	Buy	U	MXN	5,015,657	MXN	5,015,657	MXN		
SZ8329	SC Swap	21/09/2020	Buy	U	MXN	786,130	MXN	786,130	MXN		
SZ8336	SC Swap	21/09/2021	Buy	U	MXN	2,373,000	MXN	2,373,000	MXN		
SZ8347	SC Swap	21/09/2020	Buy	U	MXN	786,130	MXN	786,130	MXN		
SZ9885	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	1,383,241	MXN	1,383,241	MXN		
SZ9901	SC Swap	31/05/2021	Buy	U	MXN	300,690	MXN	300,690	MXN		
SZ9909	SC Swap	30/04/2021	Buy	U	MXN	462,616	MXN	462,616	MXN		
SZ9913	SC Swap	30/04/2021	Buy	U	MXN	365,517	MXN	365,517	MXN		
SZ9916	SC Swap	31/08/2020	Buy	U	MXN	252,138	MXN	252,138	MXN		
SZ9939	SC Swap	31/08/2022	Buy	U	MXN	1,797,885	MXN	1,797,885	MXN		
SZ9940	SC Swap	30/06/2022	Buy	U	MXN	498,165	MXN	498,165	MXN		
SZ9941	SC Swap	29/04/2022	Buy	U	MXN	334,759	MXN	334,759	MXN		
SZ9942	SC Swap	31/08/2021	Buy	U	MXN	3,147,259	MXN	3,147,259	MXN		
SZ9947	SC Swap	30/06/2021	Buy	U	MXN	313,793	MXN	313,793	MXN		
MAJ365	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	USD			10,000,000	USD		
MAJ367	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	USD			10,000,000	USD		
MAJ368	Term Deposit	02/10/2023	Buy	U	USD			10,000,000	USD		
MBX477	Term Deposit	15/03/2022	Buy	U	USD			10,000,000	USD		
MGW029	Term Deposit	07/06/2024	Buy	U	MXN			81,900,000	MXN		
MN1829	Term Deposit	28/09/2021	Buy	U	MXN			106,321,839	MXN		
MN1831	Term Deposit	01/12/2020	Buy	U	MXN			138,333,333	MXN		
MN1832	Term Deposit	01/12/2020	Buy	U	MXN			138,333,333	MXN		
MN3060	Term Deposit	31/08/2021	Buy	U	MXN			100,000,000	MXN		
MN4916	Term Deposit	29/09/2021	Buy	U	MXN			300,000,000	MXN		
MN4917	Term Deposit	30/09/2021	Buy	U	MXN			105,000,000	MXN		
MN4920	Term Deposit	08/03/2023	Buy	U	MXN			3,000,000,000	MXN		
MQ0558	Term Deposit	04/05/2023	Buy	U	USD			2,525,710	USD		
MR0353	Term Deposit	31/03/2022	Buy	U	MXN			166,666,667	MXN		
MR2606	Term Deposit	12/06/2023	Buy	U	MXN			150,000,000	MXN		
MX2911	Term Deposit	04/03/2021	Buy	U	MXN			12,206,667	MXN		

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	Style	Portfolio	Status
2054119	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2054120	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2054121	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2054122	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2054123	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2054124	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057239	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057240	FX	100,000	13/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057241	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057242	FX	100,000	12/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057243	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2057244	FX	100,000	11/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061247	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061248	FX	200,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2061249	FX	200,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061250	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061251	FX	200,000	26/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2061252	FX	200,000	26/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061253	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2061254	FX	200,000	25/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2061255	FX	200,000	25/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2062867	FX	100,000	29/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2062868	FX	100,000	29/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063629	FX	125,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063630	FX	125,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063631	FX	125,000	09/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063632	FX	125,000	09/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063837	FX	100,000	03/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063838	FX	100,000	03/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063839	FX	100,000	10/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063840	FX	100,000	10/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063841	FX	100,000	17/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063842	FX	100,000	17/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063843	FX	100,000	24/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063844	FX	100,000	24/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063845	FX	100,000	31/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063846	FX	100,000	31/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063847	FX	100,000	07/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063848	FX	100,000	07/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063849	FX	100,000	14/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063850	FX	100,000	14/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063851	FX	100,000	21/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063852	FX	100,000	21/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063853	FX	100,000	28/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063854	FX	100,000	28/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063855	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063856	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063924	FX	100,000	09/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063925	FX	100,000	09/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2063926	FX	100,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2063927	FX	100,000	04/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2064542	FX	100,000	27/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2064543	FX	100,000	27/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2064544	FX	100,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2064545	FX	100,000	28/09/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2064963	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2064964	FX	50,000	13/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2064965	FX	50,000	13/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065000	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065001	FX	50,000	06/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2065002	FX	50,000	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065003	FX	3,093	06/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065004	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065005	FX	50,000	20/08/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2065006	FX	50,000	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2065007	FX	3,093	20/08/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2066160	FX	100	22/07/2020	USD	CALL	EURO	NEGO	REVERSED
2066161	FX	100	22/07/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	REVERSED
2066391	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2066401	FX	400,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2066590	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2066600	FX	250,000	28/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2067095	FX	60,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2067097	FX	60,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2067115	FX	60,000	04/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED
2067117	FX	60,000	21/09/2020	USD	PUT	EURO	NEGO	TRIGGERED

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

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de septiembre de 2020 se tienen los siguientes saldos:

CONTRAPARTE	MONEDA	COLATERAL RECIBIDO	COLATERAL ENVIADO
CLIENTE 1	USD	-	(32,193,883)
CLIENTE 2	MXN	-	(257,700,000)
CLIENTE 3	MXN	47,700,000	(62,800,000)
CLIENTE 4	MXN	-	(71,669,399)
CLIENTE 5	MXN	-	(1,000,000)
CLIENTE 6	MXN	1,000,000	-
CLIENTE 7	MXN	116,900,000	(76,700,000)
CLIENTE 8	MXN	1,834,513,627	(517,100,000)
CLIENTE 9	USD	43,640,000	(50,090,000)
CLIENTE 10	MXN	737,500,000	(947,300,000)
CLIENTE 11	USD	10,110,000	(13,640,000)
CLIENTE 12	USD	541,400,000	(75,800,000)
CLIENTE 13	USD	290,000	-
CLIENTE 14	USD	2,470,000	(3,190,000)
CLIENTE 15	MXN	34,500,000	(493,700,000)
CLIENTE 16	MXN	3,035,000	(36,300,000)
CLIENTE 17	MXN	0	(53,600,000)
CLIENTE 18	USD	100,000	(150,000)
CLIENTE 19	MXN	0	(2,903,246,962)
CLIENTE 20	USD	45,360,000	(28,490,000)
CLIENTE 21	MXN	154,174,242	(8,461,788,351)
CLIENTE 22	USD	5,080,000	(19,260,000)
CLIENTE 23	MXN	84,100,000	(67,900,000)
CLIENTE 24	USD	1,990,742	-
CLIENTE 25	USD	880,000	(260,000)
CLIENTE 26	USD	840,000	(1,090,000)
TOTAL		3,665,583,611	(14,174,968,595)

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

Deal	Fecha de evento	Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento	Producto
SAK055	28/07/2020	Cliente 1	MXN	1,055,254	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SX6539	29/07/2020	Cliente 2	MXN	1,241,636	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
2020070903005	29/07/2020	Cliente 3	MXN	4,546,000	No fondeo su cuenta	Forwards FX
SAI085	30/07/2020	Cliente 4	MXN	507,195	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
P15698	30/07/2020	Cliente 5	MXN	5,047	No fondeo su cuenta	Caps & Floors
SAR958	30/07/2020	Cliente 6	MXN	80,538	No envío los fondos	Interest Rate Swap
SBA823	30/07/2020	Cliente 6	MXN	16,510	No envío los fondos	Interest Rate Swap
SAR594	03/08/2020	Cliente 7	MXN	1,184,238	No envío los fondos	Interest Rate Swap
E63926	14/08/2020	Cliente 8	MXN	2,658,600	No encontraban su operación	Equity Options
E56658	26/08/2020	Cliente 9	MXN	6,540	No envió los fondos	Equity Options
SAK055	28/08/2020	Cliente 10	MXN	1,160,488	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
P15698	31/08/2020	Cliente 11	MXN	5,789	No fondeo su cuenta	Caps & Floors
SAR958	31/08/2020	Cliente 12	MXN	88,744	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SBA823	31/08/2020	Cliente 13	MXN	18,340	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SX6539	31/08/2020	Cliente 14	MXN	1,406,799	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SAK055	28/09/2020	Cliente 15	MXN	1,310,671	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SCD904	28/09/2020	Cliente 16	MXN	150,295	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SX6539	29/09/2020	Cliente 17	MXN	1,418,185	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
P15698	30/09/2020	Cliente 18	MXN	7,213	No fondeo su cuenta	Caps & Floors
SAR958	30/09/2020	Cliente 19	MXN	95,696	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap
SBA823	30/09/2020	Cliente 20	MXN	20,408	No fondeo su cuenta	Interest Rate Swap

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

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	39,869,558,461	Compra	Divisas	Divisas	80,962,456,854	88,929,635,098	37,436,300,425	2,433,258,036	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	Nego	49,431,200,709	Venta	Divisas	Divisas	(80,872,344,393)	(88,514,772,729)	41,116,195,172	8,315,005,537	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	342,722,230	Compra	Acción	Acción	34,102,284	47,408,914	-	342,722,230	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	342,722,230	Venta	Acción	Acción	(21,571,170)	(24,568,326)	-	342,722,230	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	273,838,502	Compra	Divisas	Divisas	1,322,833,159	260,769,638	273,438,502	400,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	273,838,502	Venta	Divisas	Divisas	(1,303,360,642)	(240,911,544)	273,438,502	400,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	3,295,782,700	Compra	Índice	Índice	206,804,724	208,914,259	209,960,000	3,085,822,700	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,809,531,700	Venta	Índice	Índice	(62,281,089)	(52,214,876)	419,920,000	1,389,611,700	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	24,898,774,969	Compra	Tasas	Tasas	148,729,717	123,065,507	1,343,700,000	19,878,825,541	3,676,249,427	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	24,575,606,951	Venta	Tasas	Tasas	(148,493,574)	(122,289,742)	1,343,700,000	19,454,321,900	3,777,585,051	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	209,012,230	Compra	Acción NE	Acción NE	2,104,109	1,510,025	-	209,012,230	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	209,012,230	Venta	Acción NE	Acción NE	(14,635,222)	(24,348,095)	-	209,012,230	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,010,621,700	Compra	Índice	Índice NE	23,223,780	18,127,829	419,920,000	590,701,700	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	2,496,472,700	Venta	Índice	Índice NE	(167,747,416)	(174,078,543)	209,960,000	2,286,512,700	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	22,251,078	Compra	Divisas NE	Divisas NE	83,231,649	57,181,757	22,251,078	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	22,251,078	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(102,704,167)	(77,039,851)	22,251,078	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933	Compra	Tasas NE	Tasas NE	1,512	0.10	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Opción	Nego	1,309,933	Venta	Tasas NE	Tasas NE	(5,498)	(0.52)	-	1,309,933	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	340,290,397	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(189,977,322)	11,638,241	-	140,515,454	199,774,943	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	4,518,000	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	(21,469,670)	(16,438,238)	-	4,518,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	45,483,519,051	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	(2,808,054,950)	(2,378,785,081)	-	27,610,907,473	17,872,611,577	LINEA DE CREDITO
Swaps	Cobe	4,000,000	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	(895,823)	(6,756,266)	-	4,000,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	24,996,781	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	(32,711,868)	(53,068,112)	-	7,046,683	17,950,099	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	1,311,076,316	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(2,609,602,420)	(2,196,812,308)	-	549,366,593	761,709,724	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	269,511,506,600	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIIE MXN	(10,277,893,920)	(8,761,570,030)	29,753,604,019	104,253,179,271	135,504,723,309	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	1,843,684,796	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	478,210,547	726,059,512	129,545,548	951,797,860	762,341,388	LINEA DE CREDITO
Swaps	Nego	266,238,792,272	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	12,252,942,646	9,894,092,430	31,549,659,845	94,138,006,381	140,551,126,046	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			A C T I V O	666,454,354,140	553,826,317,200
110000000000			DISPONIBILIDADES	35,939,342,758	32,919,639,739
115000000000			CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	2,603,798,317	993,503,948
120000000000			INVERSIONES EN VALORES	132,213,676,698	80,839,611,546
	120100000000		Títulos para negociar	68,099,295,278	38,603,503,108
	120200000000		Títulos disponibles para la venta	59,079,120,549	37,301,989,805
	120300000000		Títulos conservados a vencimiento	5,035,260,871	4,934,118,633
120800000000			DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)	28,335,888,285	19,676,264
120700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
121400000000			DERIVADOS	23,124,160,965	12,763,516,149
	121406000000		Con fines de negociación	18,874,092,875	9,516,561,023
	121407000000		Con fines de cobertura	4,250,068,090	3,246,955,126
121700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	684,482,188	322,549,239
128000000000			TOTAL DE CARTERA DE CRÉDITO NETO	407,413,788,651	393,643,454,777
129000000000			CARTERA DE CRÉDITO NETA	407,413,788,651	393,643,454,777
129500000000			Cartera de crédito	423,354,343,348	404,615,218,527
130000000000			CARTERA DE CRÉDITO VIGENTE	412,269,358,603	395,588,509,043
	130100000000		Créditos comerciales	226,107,420,450	222,463,595,009
		130107010000	Actividad empresarial o comercial	180,786,493,424	179,983,874,949
		130107020000	Entidades financieras	31,618,581,469	33,567,600,772
		130107030000	Entidades gubernamentales	13,702,345,557	8,912,119,288
	131100000000		Créditos de consumo	41,904,355,745	44,329,144,111
	132100000000		Créditos a la vivienda	144,257,582,408	128,795,769,923
		132107010000	Media y residencial	138,934,387,366	124,804,941,749
		132107020000	De interés social	8,405,693	91,473,124
		132107030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,314,789,349	3,899,355,050
		132107040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
	133100000000		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
135000000000			CARTERA DE CRÉDITO VENCIDA	11,084,984,745	9,026,709,484
	135051000000		Créditos comerciales	5,081,432,596	4,004,983,957
		135051010000	Actividad empresarial o comercial	4,999,917,333	3,923,468,694
		135051020000	Entidades financieras	81,515,263	81,515,263
		135051030000	Entidades gubernamentales	0	0
	135061000000		Créditos de consumo	1,224,345,491	1,687,804,519
	135071000000		Créditos a la vivienda	4,779,206,658	3,333,921,008
		135071010000	Media y residencial	4,712,778,908	3,317,274,363
		135071020000	De interés social	20,633,395	14,280,447
		135071030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	45,794,355	2,366,198
		135071040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
139000000000			ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-15,940,554,697	-10,971,763,750
139700000000			Derechos de cobro (neto)	0	0
	139798000000		DERECHOS DE COBRO ADQUIRIDOS	0	0
	139799000000		ESTIMACIÓN POR IRRECUPERABILIDAD O DIFÍCIL COBRO	0	0
179700000000			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
140000000000			Otras cuentas por cobrar	20,604,376,327	18,038,942,305
150000000000			Bienes adjudicados	241,489,526	97,893,937
160000000000			Propiedades, mobiliario y equipo	3,302,451,667	3,656,355,233
170000000000			INVERSIONES PERMANENTES	51,439,297	51,204,797
179500000000			ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA	21,650,131	27,998,826
180000000000			Impuestos y ptu diferidos (a favor)	6,128,722,494	4,667,185,875
190000000000			OTROS ACTIVOS	5,789,086,836	5,784,784,565
	190300000000		Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	5,789,067,131	5,784,446,328
	191600000000		Otros activos a corto y largo plazo	19,705	338,237
200000000000			P A S I V O	611,786,150,448	501,316,519,371
210000000000			CAPTACIÓN TRADICIONAL	407,167,197,517	368,532,900,287
	210100000000		Depósitos de exigibilidad inmediata	189,258,320,401	173,008,110,348
	211100000000		Depósitos a plazo	181,270,911,209	158,604,177,151
		211101000000	Del público en general	154,040,516,077	107,290,906,337
		211102000000	Mercado de dinero	27,230,395,132	51,313,270,814
		211103000000	Fondos especiales	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
	212500000000		Títulos de crédito emitidos	36,030,368,920	36,337,784,465
	216100000000		Cuenta global de captación sin movimientos	607,596,987	582,828,323
230000000000			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	65,675,414,050	42,629,727,360
	230100000000		De exigibilidad inmediata	0	408,433,701
	230200000000		De corto plazo	23,851,409,575	16,228,335,896
	230300000000		De largo plazo	41,824,004,475	25,992,957,763
203000000000			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	10,989,056,425	4,721,056,159
220800000000			ACREEDORES POR REPORTE	46,965,594,933	35,229,508,918
220700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	13,710	0
220900000000			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	587,737,307	15,580
	220901000000		Reportos	0	0
	220902000000		Préstamo de valores	587,737,307	15,580
	220903000000		Derivados	0	0
	220990000000		Otros colaterales vendidos	0	0
221400000000			DERIVADOS	25,392,994,853	13,969,371,039
	221406000000		Con fines de negociación	18,752,289,795	10,010,323,667
	221407000000		Con fines de cobertura	6,640,705,058	3,959,047,372
221700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	14,262,822	19,535,744
221900000000			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
225000000000			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
240000000000			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	44,219,663,118	25,607,775,882
	240200000000		Impuestos a la utilidad por pagar	1,219,779,953	824,031,340
	240800000000		Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar	0	0
	240300000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	240900000000		Acreedores por liquidación de operaciones	30,806,955,509	14,870,353,547
	241000000000		Acreedores por cuentas de margen	0	0
	241300000000		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	1,371,456,480	518,787,262
	240100000000		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	10,821,471,176	9,394,603,733
270000000000			OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,093,676,837	9,088,347,572
280000000000			Impuestos y ptu diferidos (a cargo)	0	0
290000000000			CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	1,680,538,876	1,518,280,830
400000000000			CAPITAL CONTABLE	54,668,203,692	52,509,797,829
450000000000			Participación controladora	54,667,991,167	52,509,604,324
410000000000			CAPITAL CONTRIBUIDO	10,876,764,482	10,876,764,482
	410100000000		Capital social	10,404,165,369	10,404,165,369
	410700000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
	410400000000		Prima en venta de acciones	472,599,113	472,599,113
	411100000000		Obligaciones subordinadas en circulación	0	0
420000000000			CAPITAL GANADO	43,791,226,685	41,632,839,842
	420100000000		Reservas de capital	6,757,848,750	6,263,000,124
	420300000000		Resultado de ejercicios anteriores	36,427,621,378	31,951,370,585
	420500000000		Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	477,980,484	-85,517
	421500000000		Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-1,021,371,876	-143,824,170
	421700000000		Efecto acumulado por conversión	0	0
	422300000000		Remediones por beneficios definidos a los empleados	-787,771,543	-467,869,643
	420900000000		Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	421100000000		Resultado neto	1,936,919,492	4,030,248,463
430000000000			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	212,525	193,505
	431000000000		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	8,959	10,603
	439000000000		Otra participación no controladora	203,566	182,902
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	2,858,128,842,116	2,529,843,586,523
710000000000			Avales otorgados	0	0
790000000000			Activos y pasivos contingentes	0	2,977,405
730000000000			Compromisos crediticios	274,944,059,448	274,332,905,692
740000000000			Bienes en fideicomiso o mandato	377,739,798,384	234,017,262,835
	740100000000		Fideicomisos	348,627,341,299	204,692,980,768
	740200000000		Mandatos	29,112,457,085	29,324,282,067
770300000000			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
750000000000			Bienes en custodia o en administración	598,896,474,687	413,177,437,829
773100000000			Colaterales recibidos por la entidad	56,239,194,468	32,031,319,063

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
773200000000			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	2,547,743,524	1,801,252,154
760000000000			Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros	134,249,223,638	94,637,387,653
771000000000			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	596,181,241	453,443,302
780000000000			Otras cuentas de registro	1,412,916,166,726	1,479,389,600,590

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2020**

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

ESTADO DE RESULTADOS DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
510000000000	Ingresos por intereses	37,067,149,564	37,858,029,379
610000000000	Gastos por intereses	18,303,578,000	20,458,118,604
520000000000	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
670100000000	MARGEN FINANCIERO	18,763,571,564	17,399,910,775
620000000000	Estimación preventiva para riesgos crediticios	8,010,592,529	4,185,383,680
670200000000	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	10,752,979,035	13,214,527,095
530000000000	Comisiones y tarifas cobradas	3,563,583,870	3,854,622,115
630000000000	Comisiones y tarifas pagadas	742,629,680	615,913,029
540000000000	Resultado por intermediación	1,825,551,237	528,689,116
505000000000	Otros ingresos (egresos) de la operación	1,139,643,216	1,649,261,307
590000000000	Subsidios	0	0
640000000000	Gastos de administración y promoción	13,960,217,419	12,865,475,918
670400000000	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	2,578,910,259	5,765,710,686
570000000000	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	1,011,758	683,460
672500000000	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	2,579,922,017	5,766,394,146
660000000000	Impuestos a la utilidad causados	1,906,651,535	1,865,995,358
560000000000	Impuestos a la utilidad diferidos	1,263,657,969	129,860,278
670700000000	RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS	1,936,928,451	4,030,259,066
580000000000	Operaciones discontinuadas	0	0
671100000000	RESULTADO NETO	1,936,919,492	4,030,248,463
670900000000	Participación controladora	1,936,919,492	4,030,248,463
671300000000	Participación no controladora	8,959	10,603

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820103500000		Resultado neto	1,936,928,451	4,030,259,066
820103600000		Ajustes por partidas que no implican flujo de efectivo:	9,792,001,558	5,977,914,203
	820103600100	Pérdidas por deterioro o efecto por reversión del deterioro asociados a actividades de inversión	52,184,593	13,452,158
	820103600200	Depreciaciones de propiedades, mobiliario y equipo	372,116,159	363,679,903
	820103600300	Amortizaciones de activo intangibles	292,028,186	244,714,278
	820103600400	Provisiones	8,474,884,518	4,020,618,758
	820103600500	Impuestos a la utilidad causados y diferidos	642,993,566	1,736,135,080
	820103600600	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	-1,011,758	-683,460
	820103600700	Operaciones discontinuadas	0	0
	820103609000	Otros	-41,193,706	-400,002,514
		Actividades de operación		
	820103010000	Cambio en cuentas de margen	-1,587,119,375	-964,858,171
	820103020000	Cambio en inversiones en valores	-35,737,229,873	-12,181,719,574
	820103030000	Cambio en deudores por reporto	-25,761,448,937	3,282,957,151
	820103040000	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	820103050000	Cambio en derivados (activo)	-9,436,680,198	10,809,714,155
	820103060000	Cambio de cartera de crédito (neto)	-13,299,275,206	-37,242,418,737
	820103070000	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	820103080000	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	820103090000	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-129,068,962	-17,112,980
	820103100000	Cambio en otros activos operativos (neto)	-822,987,849	-7,996,969,844
	820103110000	Cambio en captación tradicional	42,296,113,172	13,172,589,150
	820103120000	Cambio en préstamos interbancarios y de otros organismos	10,033,250,332	12,295,553,728
	820103130000	Cambio en acreedores por reporto	-2,169,369,349	1,427,192,218
	820103140000	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	13,710	0
	820103150000	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	587,737,307	15,580
	820103160000	Cambio en derivados (pasivo)	10,434,553,993	-10,124,696,344
	820103170000	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	0	0
	820103180000	Cambio en obligaciones subordinadas con características de pasivo	47,850,682	44,755,822
	820103190000	Cambio en otros pasivos operativos	13,686,266,772	5,666,735,562
	820103200000	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	820103230000	Cobros de impuestos a la utilidad (devoluciones)	0	0
	820103240000	Pagos de impuestos a la utilidad	-1,495,083,175	-735,234,153
	820103900000	Otros	0	0
820103000000		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	-13,352,476,956	-22,563,496,437
		Actividades de inversión		
	820104010000	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
	820104020000	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-265,978,066	-254,633,122
	820104030000	Cobros por disposición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	0	0
	820104040000	Pagos por adquisición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	0	0
	820104050000	Cobros por disposición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104060000	Pagos por adquisición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104070000	Cobros de dividendos en efectivo	1,044,492	0
	820104080000	Pagos por adquisición de activos intangibles	-115,663,045	-178,728,397
	820104090000	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	820104100000	Cobros por disposición de otros activos de larga duración	0	0
	820104110000	Pagos por adquisición de otros activos de larga duración	0	0
	820104120000	Cobros asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104130000	Pagos asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104900000	Otros	0	0
820104000000		Flujos netos de efectivo de actividades de inversión	-380,596,619	-433,361,519
		Actividades de financiamiento		
	820105010000	Cobros por emisión de acciones	0	800,036
	820105020000	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	820105030000	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	820105040000	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	820105050000	Cobros por la emisión de obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105060000	Pagos asociados a obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105900000	Otros	0	0
820105000000		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	0	800,036

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

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

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820100000000		Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	-2,004,143,566	-12,987,884,651
820400000000		Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo	0	0
820200000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo	37,943,486,324	45,907,524,390
820000000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	35,939,342,758	32,919,639,739

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

ESTADO DE VARIACIONES EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2020 Y 2019

CRÉDITO

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Participación controladora	Capital contribuido				Capital Ganado							Participación no controladora	Capital contable	
		Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Obligaciones subordinadas en circulación	Reservas de capital	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	Efecto Acumulado por conversión	Remediones por beneficios definidos a los empleados	Resultado por tenencia de activos no monetarios			Resultado neto
Saldo al inicio del periodo	53,195,720,153	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,263,000,124	31,961,340,428	60,504,632	-103,919,874	0	-810,455,900	0	4,948,486,261	203,566	53,195,923,719
MOVIMIENTOS INHERENTES A LAS DECISIONES DE LOS PROPIETARIOS															
Suscripción de acciones	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Capitalización de utilidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Constitución de reservas	0	0	0	0	0	494,848,626	0	0	0	0	0	0	-494,848,626	0	0
Traspaso del resultado neto a resultado de ejercicios anteriores	0	0	0	0	0	0	4,453,637,635	0	0	0	0	0	-4,453,637,635	0	0
Pago de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total por movimientos inherentes a las decisiones de los propietarios	0	0	0	0	0	494,848,626	4,453,637,635	0	0	0	0	0	-4,948,486,261	0	0
MOVIMIENTOS INHERENTES AL RECONOCIMIENTO DE LA UTILIDAD INTEGRAL															
-Resultado neto	1,936,919,492	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	1,936,919,492	8,959	1,936,928,451
-Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	417,475,852	0	0	0	0	0	0	417,475,852	0	0	0	0	0	0	417,475,852
-Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo.	-917,452,002	0	0	0	0	0	0	0	-917,452,002	0	0	0	0	0	-917,452,002
-Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remediones por beneficios definidos a los empleados	35,327,672	0	0	0	0	0	12,643,315	0	0	0	22,684,357	0	0	0	35,327,672
-Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total de movimientos inherentes al reconocimiento de la utilidad integral	1,472,271,014	0	0	0	0	0	12,643,315	417,475,852	-917,452,002	0	22,684,357	0	1,936,919,492	8,959	1,472,279,973
Saldo al final del periodo	54,667,991,167	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,757,848,750	36,427,621,378	477,980,484	-1,021,371,876	0	-787,771,543	0	1,936,919,492	212,525	54,668,203,692

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 15 de Octubre de 2020, Adrián Otero Rosiles (Director General), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto 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.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: Globalcard (hasta el 30 de septiembre de 2019), 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 2019 y 2018.

Los accionistas y la Comisión Bancaria tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión.

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 de contabilidad 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, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 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 incluyen 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 (ver nota 9);

-Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios: supuestos e insumos utilizados en su determinación (ver nota 10);

-Deterioro de propiedades, mobiliario y equipo: Pruebas de deterioro del valor de activos fijos, incluyendo los supuestos claves para determinación del importe recuperable de dichos activos (ver nota 12);

-Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves (ver nota 16);

-Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos diferidos (ver nota 17).

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.

(3) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran a continuación en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, han sido aplicadas consistentemente por el Banco:

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

Los estados financieros consolidados adjuntos incluyen el reconocimiento de la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 3 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

inflación con base en Unidades de Inversión (UDI) hasta el 31 de diciembre de 2007, de acuerdo con los criterios de contabilidad aplicables.

Los ejercicios terminados el 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 UDI Del año Acumulada

2019 \$6.3990182.77% 15.03%

2018 6.2266314.92% 15.71%

2017 5.9345516.68% 12.60%

(b) Bases de consolidación-

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

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2019 y 2018, se detallan a continuación:

Subsidiaria Participación Ubicación Actividad

Globalcard, S. A. de C. V., SOFOM, E. R. (hasta el 30 de septiembre de 2019) 99.99%

Ciudad de México Otorgar tarjetas de crédito

Inmobiliaria Scotia Inverlat, S. A. de C. V. 99.99% Ciudad de México Administración de activo fijo

Scotia Servicios de Apoyo, S. A. de C. V. 99.99% Ciudad de México Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito

Scotia Inverlat Derivados, S. A. de C. V. y subsidiarias 99.99% Ciudad de México Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(c) Disponibilidades-

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

Las disponibilidades se reconocen a su valor nominal. En el caso de cuentas bancarias denominadas en dólares, el tipo de cambio utilizado para la conversión es el publicado

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 4 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

por el Banco Central. El efecto de valorización y los intereses ganados se registran en resultados, como ingreso o gasto por intereses, según corresponda, conforme se devengan.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(d) Cuentas de margen-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

(e) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

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

Títulos disponibles para la venta-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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".

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

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

Títulos conservados al vencimiento-

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

Deterioro del valor de un título-

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

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

Al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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".

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Reclasificación entre categorías-

Los criterios de contabilidad 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 2019 y 2018, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías, ni ventas de títulos conservados a vencimiento.

(f) 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".

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

(g) 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.

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 afectan los resultados del ejercicio.

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

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

Derivados implícitos y estructurados

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

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que por medio de swaps u opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 14).

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 9/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 colaterales recibidos en efectivo se registran como "Otras cuentas por pagar".

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.

(h) 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.

(i) 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

Créditos e intereses vencidos-

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 ó 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 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 12 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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, o
 - d) Prórroga del plazo del crédito.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- i) Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 estimación preventiva para riesgos crediticios creada con anterioridad para cada crédito. Cualquier recuperación derivada de créditos previamente castigados o eliminados, deberá reconocerse en los resultados del ejercicio.

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

Comisiones

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 15/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 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 muestra 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", 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.

(j) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

Se mantiene una estimación para riesgos crediticios, la cual a juicio de la administración del Banco, es suficiente para cubrir cualquier pérdida que pudiera

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 2019 y 2018 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%
A20.9011.5%
B11.5012.0%
B22.0012.50%
B32.5015.0%
C15.00110.0%
C210.00115.5%
D15.50145.0%
EMayor a 45.0%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

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

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

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2019 y 2018, 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 Bancarias. Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, así como viii) antigüedad del acreditado en el Banco.

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

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2019 y 2018, se

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

(k) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

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

(l) Otras cuentas por cobrar-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 19/ 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

(m) 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"; 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".

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". El Banco constituye provisiones adicionales que 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", 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 20 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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%

(n)Propiedades, mobiliario y equipo-

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

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

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

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

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 21 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

- d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del 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 de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.
- e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.
- f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

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

(p) Inversiones permanentes-

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

(q) Otros activos-

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

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

(r) Impuestos a la utilidad-

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

(s) Arrendamientos capitalizables-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación". 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.

(t) Captación tradicional-

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

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

(u) 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.

(v) 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

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".

(w) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Hasta el 15 de noviembre de 2018 (fecha en la que se llevó a cabo la sustitución patronal del personal activo con SECOSA, ver nota 16), los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocían 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 y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del balance general consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que el personal jubilado han obtenido a cambio de su servicio en los ejercicios anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediciones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

El Banco reconoció hasta el 15 de noviembre de 2018, un pasivo por beneficios por terminación y un costo o gasto cuando el Banco no tenía alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no podía retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumplía con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurriera primero. Si no se esperaba que se liquidaran dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descontaban.

Plan de contribución definida

El Banco reconoció hasta el 15 de noviembre de 2018 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" (ver nota 16).

Plan de beneficios definidos

En adición, el Banco tenía establecido un plan de beneficio definido que cubría las primas de antigüedad y las indemnizaciones legales a las que tenían derecho los empleados activos hasta el 15 de noviembre de 2018, de acuerdo con la Ley Federal del Trabajo. A partir del 16 de noviembre de 2018, 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 y hasta el 15 de noviembre de 2018 de los fondos de los empleados activos, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos, se realiza

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediciones 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 y posteriormente se recicla a los resultados del período, tomando como base la vida laboral remanente promedio del personal jubilado.

De acuerdo a la resolución publicada el 31 de diciembre de 2015 por la Comisión Bancaria, las modificaciones a los planes y remediciones acumuladas hasta el 31 de diciembre de 2015, se reconocen gradualmente durante cinco años, que concluyen en el año 2020, sin embargo, derivado de la sustitución patronal con SECOSA, las modificaciones a los planes y remediciones pendientes de reconocer hasta el 15 de noviembre de 2018 por los empleados activos, se reconocieron en los resultados del ejercicio (ver nota 16).

(x) 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".

(y) 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, las comisiones por originación del crédito y la anualidad por tarjetas de 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 en el plazo del crédito (12 meses para el caso

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

de tarjeta de 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 ingresos por comisiones cobradas por las operaciones celebradas en el mercado de derivados se registran en el estado consolidado de resultados conforme se presta el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Los ingresos por arrendamiento se reconocen en resultados conforme se devengan.

(z) 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 para solventar obligaciones denominadas en moneda extranjera pagaderas en la República Mexicana, determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio FIX publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

(aa) Aportaciones al 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".

(ab) 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".

(ac) Contingencias-

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Mejoras a las NIF 2019-

En diciembre de 2018 el CINIF emitió el documento llamado "Mejoras a las NIF 2019", que contiene modificaciones puntuales a las siguientes NIF ya existentes.

- NIF B-17 "Determinación del valor razonable"
- NIF C-3 "Cuentas por cobrar"
- NIF C-9 "Provisiones, contingencias y compromisos"
- NIF C-16 "Deterioro de los instrumentos financieros por cobrar"
- NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar"
- NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés"
- NIF D-1 "Ingresos por contratos por clientes"
- NIF D-2 "Costos por contratos con clientes"
- NIF D-5 "Arrendamientos"

La Comisión Bancaria estableció la fecha de aplicación de las NIF anteriores el 1 de enero de 2021.

Aplicación progresiva de la adopción de la nueva NIF D-3 "Beneficios a los empleados" emitido por la Comisión Bancaria

El 31 de diciembre de 2015, se publicó en el Diario Oficial de la Federación (DOF) la Resolución que modifica las Disposiciones en la cual a través del artículo tercero transitorio, la Comisión Bancaria establece los términos para reconocer los cambios derivados de la adopción de la nueva NIF D-3 que entró en vigor el 1 de enero de 2016, y define el plazo con que cuentan las instituciones de crédito para reconocer en su capital el monto total de los saldos pendientes de amortizar por concepto de ganancias o pérdidas del plan de beneficios definidos, así como por modificaciones a dicho plan, no reconocidos hasta el 31 de diciembre de 2015.

La Resolución establece que las instituciones a que se refiere el Artículo 2º, fracción

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

I de la Ley de Instituciones de Crédito, que opten por la aplicación progresiva a que se refiere el artículo transitorio, deberán iniciar el reconocimiento de los saldos señalados en los incisos a) y b) del párrafo 81.2 de la NIF D-3, en el ejercicio 2016 reconociendo el 20% de los saldos en dicho año y un 20% adicional en cada uno de los años subsecuentes, hasta llegar al 100% en un periodo máximo de cinco años". Las instituciones de crédito podrán aplicar reconocimientos anticipados, siempre que en el año que corresponda se reconozca al menos el 20%, o el monto total remanente en términos de lo previsto por el artículo transitorio antes mencionado; sin embargo, derivado de la sustitución patronal entre el Banco y SECOSA, se reconocieron en resultados del ejercicio, los saldos pendientes de aplicar correspondientes a los empleados activos mencionados anteriormente.

Los saldos pendientes de amortizar por concepto de modificaciones al plan de beneficios definidos, así como por las ganancias y pérdidas actuariales de dicho plan, reconocido en los rubros de "Resultado de ejercicios anteriores" y "Remediciones por beneficios definidos a los empleados", respectivamente, se muestran a continuación:

Modificaciones al plan de beneficios definidos	Pérdidas actuariales
Saldo al 31 de diciembre de 2018 pendiente de amortizar y aplicar gradualmente durante los siguientes dos años \$ (57)	329
Reconocimiento gradual del ejercicio	40(315)
Amortización de servicio pasado-	(1)
Saldo al 31 de diciembre de 2019 pendiente de amortizar y aplicar gradualmente durante el siguiente año \$ (17)	13

En el período de enero a septiembre de 2020, fueron reconocidos en el Capital Contable del Banco, los siguientes importes:

Concepto	Ene - Sep 2020
Capital Contable	
Resultado de ejercicios anteriores \$	(13)
Remediciones por beneficios a los empleados	10
Reciclaje de remediciones	39
Impuestos diferidos	(7)
\$	29

(4) Cambios contables

Mejoras a las NIF 2019-

En diciembre de 2018 el CINIF emitió el documento llamado "Mejoras a las NIF 2019", que contiene modificaciones puntuales a las siguientes NIF ya existentes.

- NIF B-17 "Determinación del valor razonable"
- NIF C-3 "Cuentas por cobrar"
- NIF C-9 "Provisiones, contingencias y compromisos"
- NIF C-16 "Deterioro de los instrumentos financieros por cobrar"
- NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar"
- NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés"
- NIF D-1 "Ingresos por contratos por clientes"
- NIF D-2 "Costos por contratos con clientes"

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

•NIF D-5 "Arrendamientos"

La Comisión Bancaria estableció la fecha de aplicación de las NIF anteriores el 1 de enero de 2021.

Pronunciamientos emitidos por el CINIF

Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

Con fecha 4 de noviembre de 2019, la SHCP dió a conocer a través del DOF diversas resoluciones modificatorias de las resoluciones que modifican las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, casas de bolsa, sociedades de inversión y sociedades financieras de objeto múltiple reguladas, publicadas en el DOF el 27 de diciembre de 2017; dichas modificaciones consideran la entrada en vigor el 1 de enero de 2021, de las Normas de Información Financiera (NIF), emitidas por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) y referidas en el párrafo 3 del Criterio A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33 que se modifica mediante el presente instrumento.

El 8 de abril de 2020 la CNBV emitió comunicado de prensa sobre la entrada en vigor de la Resolución publicada en el Diario Oficial de la Federación el 13 de marzo de 2020, referente a las NIF emitidas por el CINIF, referidas en el párrafo 3 del Criterio A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33, entrarán en vigor el 1 de enero de 2022.

El CINIF emitió las siguientes NIF's que se mencionan a continuación:

NIF B-17 "Determinación del valor razonable"- . Establece las normas de valuación y revelación en la determinación del valor razonable, en su reconocimiento inicial y posterior, si el valor razonable es requerido o permitido por otras NIF particulares.

NIF C-3 "Cuentas por cobrar"- Entre los principales cambios que presenta se encuentran los siguientes:

- Especifica que las cuentas por cobrar que se basan en un contrato representan un instrumento financiero, en tanto que algunas de las otras cuentas por cobrar, generadas por una disposición legal o fiscal, pueden tener ciertas características de un instrumento financiero, tal como generar intereses, pero no son en sí instrumentos financieros.

- Establece que la estimación para incobrabilidad por cuentas por cobrar debe reconocerse desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas presentando la estimación en un rubro de gastos, por separado cuando sea significativa en el estado de resultado integral.

- Establece que, desde el reconocimiento inicial, debe considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, debe ajustarse considerando dicho valor presente.

- Requiere una conciliación entre el saldo inicial y el final de la estimación para incobrabilidad por cada período presentado.

NIF C-9 "Provisiones, Contingencias y Compromisos"- Entre los principales aspectos que cubre esta NIF se encuentran los siguientes:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 29 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

•Se disminuye su alcance al reubicar el tema relativo al tratamiento contable de pasivos financieros en la NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar".

•Se modifica la definición de "pasivo" eliminando el calificativo de "virtualmente ineludible" e incluyendo el término "probable".

NIF C-16 "Deterioro de los instrumentos financieros por cobrar"- Establece las normas para el reconocimiento contable de las pérdidas por deterioro de todos los instrumentos financieros por cobrar (IFC); señala cuándo y cómo debe reconocerse una pérdida esperada por deterioro y establece la metodología para su determinación.

Los principales cambios que incluye esta NIF consisten en determinar cuándo y cómo deben reconocerse las pérdidas esperadas por deterioro de IFC, entre ellos:

•Establece que las pérdidas por deterioro de un IFC deben reconocerse cuando al haberse incrementado el riesgo de crédito se concluye que una parte de los flujos de efectivo futuros del IFC no se recuperará.

•Propone que se reconozca la pérdida esperada con base en la experiencia histórica que tenga la entidad de pérdidas crediticias, las condiciones actuales y los pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el importe de los flujos de efectivo futuros de los IFC.

•En el caso de los IFC que devengan intereses, establece determinar cuánto y cuándo se estima recuperar del monto del IFC, pues el monto recuperable debe estar a su valor presente.

NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar"- Entre las principales características que tiene se encuentran las siguientes:

•Se establece la posibilidad de valuar, subsecuentemente a su reconocimiento inicial, ciertos pasivos financieros a su valor razonable, cuando se cumplen ciertas condiciones.

•Valuar los pasivos a largo plazo a su valor presente en su reconocimiento inicial.

•Al reestructurar un pasivo, sin que se modifiquen sustancialmente los flujos de efectivo futuros para liquidar el mismo, los costos y comisiones erogados en este proceso afectarán el monto del pasivo y se amortizarán sobre una tasa de interés efectiva modificada, en lugar de afectar directamente la utilidad o pérdida neta.

•Incorpora lo establecido en la IFRIC 19 "Extinción de Pasivos Financieros con Instrumentos de Capital", tema que no estaba incluido en la normativa existente.

•El efecto de extinguir un pasivo financiero debe presentarse como un resultado financiero en el estado de resultado integral.

•Introduce los conceptos de costo amortizado para valuar los pasivos financieros y el de método de interés efectivo, basado en la tasa de interés efectiva.

NIF C-20 "Instrumentos financieros para cobrar principal e interés"- Entre los principales aspectos que cubre se encuentran los siguientes:

•La clasificación de los instrumentos financieros en el activo. Se descarta el concepto de intención de adquisición y tenencia de éstos para determinar su clasificación. En su lugar, se adopta el concepto de modelo de negocios de la administración, ya sea para

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 30 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

obtener un rendimiento contractual, generar un rendimiento contractual y vender para cumplir ciertos objetivos estratégicos o para generar ganancias por su compra y venta, para clasificarlos de acuerdo con el modelo correspondiente.

- El efecto de valuación de las inversiones en instrumentos financieros se enfoca también al modelo de negocios.
- No se permite la reclasificación de los instrumentos financieros entre las clases de instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), la de instrumentos financieros para cobrar y vender (IFCV) y la de instrumentos financieros negociables, a menos de que cambie el modelo de negocios de la entidad.
- No se separa el instrumento derivado implícito que modifique los flujos de principal e interés del instrumento financiero por cobrar anfitrión, sino que todo el IFCPI se valorará a su valor razonable, como si fuera un instrumento financiero negociable.

NIF D-1 "Ingresos por contratos con clientes"- Entre los principales cambios se encuentran los siguientes:

- Establece la transferencia del control como base para la oportunidad del reconocimiento de los ingresos.
- Requiere la identificación de las obligaciones a cumplir en un contrato.
- Indica que la asignación del monto de la transacción entre las obligaciones a cumplir, debe realizarse con base en los precios de venta independientes.
- Introduce el concepto de "cuenta por cobrar condicionada".
- Requiere el reconocimiento de derechos de cobro.
- Establece requerimientos y orientación sobre cómo valorar la contraprestación variable y otros aspectos, al realizar la valuación del ingreso.

NIF D-2 "Costos por contratos con clientes"- Establece las normas para el reconocimiento contable de los costos de ventas de bienes o de prestación de servicios

Su principal cambio es la separación de la normativa relativa al reconocimiento de ingresos por contratos con clientes, de la correspondiente al reconocimiento de los costos por contratos con clientes. Adicionalmente, amplía el alcance que tenía el Boletín D-7, referenciado exclusivamente a costos relacionados con contratos de construcción y de fabricación de ciertos bienes de capital, para incluir costos relacionados con todo tipo de contratos con clientes.

NIF D-5 "Arrendamientos"- Los cambios más relevantes son los siguientes:

La norma contable introduce un único modelo de reconocimiento de los arrendamientos por el arrendatario y requiere que éste reconozca los activos y pasivos de todos los arrendamientos con una duración superior a 12 meses, a menos que el activo subyacente sea de bajo valor. Se requiere que reconozca un activo por derecho de uso que representa su derecho a usar el activo subyacente arrendado y un pasivo por arrendamiento que representa su obligación para hacer pagos por arrendamiento.

Se considera que los siguientes aspectos del nuevo modelo son los cambios más significativos e importantes para los arrendatarios:

- modificación de la definición de arrendamiento;
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2020

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 31 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- eliminación de clasificación de arrendamientos operativos o financieros para un arrendatario, y éste reconoce un pasivo por arrendamiento al valor presente de los pagos por arrendamiento un activo por derecho de uso por ese mismo monto;
 - aumento en los activos en arrendamiento y en los pasivos financieros de un arrendatario, lo que implica cambios en los indicadores financieros relacionados con los activos y pasivos de la entidad;
 - cambia para los arrendatarios la naturaleza de los gastos relacionados con dichos arrendamientos: gasto por arrendamiento ahora dividido en un gasto por depreciación/amortización y gasto por interés;
 - modificación en la presentación de los flujos de efectivo relacionados con arrendamientos operativos;
 - modifica el reconocimiento de la ganancia o pérdida en arrendamientos de activos en vía de regreso.

Cabe mencionar que estos cambios entrarán en vigor el 1 de enero de 2021. El Grupo está en proceso de evaluación del impacto de las mismas.

NIF aplicables en 2020:

NIF B-11 "Disposición de activos de larga duración y operaciones discontinuadas"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2020, no permitiendo su aplicación anticipada, dado que es necesario aplicarla junto con la NIF C-15 que se reemitirá durante 2019 y también será aplicable a partir del 2020. La aplicación por primera vez de esta NIF no genera cambios contables en los estados financieros. Entre los principales aspectos que cubre esta NIF se encuentran los siguientes:

- Aclara que los activos de larga duración no se reclasifican como activos circulantes hasta que cumplan los criterios para ser clasificados como mantenidos para la venta. Además, ciertos activos de una clase que una entidad normalmente considera como no circulantes, pero que exclusivamente se adquieren con la finalidad de revenderlos, no se reclasificarán como circulantes a menos que cumplan los criterios para ser clasificados como mantenidos para la venta de acuerdo con esta NIF.
- En relación con los activos presentados en el estado de situación financiera con un criterio basado en la liquidez, considera como no circulantes aquellos activos que se espera recuperar en un plazo superior a los doce meses posteriores a la fecha del estado de situación financiera o al de su ciclo de operaciones en caso de que sea mayor a doce meses.
- Establece los requerimientos de información a revelar para los activos de larga duración o grupos para disposición que se clasifican como mantenidos para la venta, así como para operaciones discontinuadas.

El Banco no tuvo efectos materiales por la adopción de esta norma en su información financiera.

Venta de créditos de cartera hipotecaria

El 31 de enero de 2020, el Banco vendió un portafolio de préstamos hipotecarios totalmente castigados a una compañía no relacionada con valor nominal de \$181, el ingreso recibido y utilidad en libros de dicho portafolio fue de \$38. El resultado por esta operación fue registrado como recuperaciones en el estado de resultados dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios".

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2020**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 32

CONSOLIDADO

Impresión Final

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF
