

**ANEXO**

**Scotiabank Inverlat**

# Información Financiera

## SCOTIABANK INVERLAT

### Indicadores Financieros

Scotiabank-Indicadores Financieros	T4 2022	T1 2023	T2 2023	T3 2023
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	10.1%	15.9%	13.2%	14.8%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.0%	1.6%	1.3%	1.5%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	2.8%	3.7%	3.4%	3.3%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.4%	2.3%	2.2%	2.1%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.7%	3.8%	4.0%	4.0%
Índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)	90.6%	87.8%	82.2%	79.8%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	19.78%	21.01%	21.94%	22.60% <sup>1)</sup>
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	15.50%	16.12%	16.59%	17.07% <sup>1)</sup>
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	45.5%	44.0%	50.6%	49.0%

<sup>1)</sup>. Sujeto a aprobación de Banco Central

La utilidad neta al cierre del tercer trimestre alcanza \$2,936 millones, un incremento de \$416 millones o 17% respecto al trimestre anterior, debido a una disminución en gastos de administración y una menor tasa de impuestos producto de una mayor inflación, compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias. Respecto al mismo periodo del año anterior la utilidad neta incremento \$65 millones, principalmente por menores requerimientos de reservas crediticias y mayores ingresos no financieros; compensados parcialmente por mayores impuestos a la utilidad debido a los movimientos de inflación en el periodo.

La utilidad neta acumulada al cierre de septiembre 2023 se ubicó en \$8,451 millones; una disminución de \$731 millones u 8% respecto al mismo periodo del año pasado. En el periodo, el PTPP creció 13%, el cual fue contrarrestado por mayores requerimientos de reservas crediticias, producto del beneficio en T1 2022 de la implementación de IFRS 9, así como mayores impuestos a la utilidad debido a los movimientos de inflación.

	3 meses				9 meses		
<b>Scotiabank- Información Financiera</b> <b>(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
Ingresos por intereses	15,146	19,618	19,984	32%	40,320	57,994	44%
Gastos por intereses	(8,471)	(13,118)	(13,250)	56%	(21,500)	(38,101)	77%
<b>Margen Financiero</b>	<b>6,675</b>	<b>6,500</b>	<b>6,734</b>	<b>1%</b>	<b>18,820</b>	<b>19,893</b>	<b>6%</b>
Comisiones	1,170	1,024	1,044	-11%	3,195	3,267	2%
Resultado por Intermediación	372	560	430	16%	1,215	1,553	28%
Otros ingresos/egresos de la operación	89	208	273	> +100%	402	763	90%
<b>Ingresos no Financieros</b>	<b>1,631</b>	<b>1,792</b>	<b>1,747</b>	<b>7%</b>	<b>4,812</b>	<b>5,583</b>	<b>16%</b>
<b>Total Ingresos</b>	<b>8,306</b>	<b>8,292</b>	<b>8,481</b>	<b>2%</b>	<b>23,632</b>	<b>25,476</b>	<b>8%</b>
Gastos de Administración y Promoción	(4,050)	(4,280)	(4,096)	1%	(12,394)	(12,810)	3%
<b>PTPP <sup>1)</sup></b>	<b>4,256</b>	<b>4,012</b>	<b>4,385</b>	<b>3%</b>	<b>11,238</b>	<b>12,666</b>	<b>13%</b>
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(772)	(287)	(574)	-26%	267	(1,006)	> -100%
<b>Resultado de la Operación</b>	<b>3,484</b>	<b>3,725</b>	<b>3,811</b>	<b>9%</b>	<b>11,505</b>	<b>11,660</b>	<b>1%</b>
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	1	89	-	-100%	59	168	> +100%
<b>Resultado antes de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>3,485</b>	<b>3,814</b>	<b>3,811</b>	<b>9%</b>	<b>11,564</b>	<b>11,828</b>	<b>2%</b>
Impuestos a la Utilidad	(614)	(1,294)	(875)	43%	(2,382)	(3,377)	42%
<b>Resultado Neto</b>	<b>2,871</b>	<b>2,520</b>	<b>2,936</b>	<b>2%</b>	<b>9,182</b>	<b>8,451</b>	<b>-8%</b>
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(326)	30	(489)	50%	(483)	(407)	-16%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	52	(165)	831	> +100%	610	624	2%
Remediación de beneficios definidos a los empleados	1	4	20	> +100%	11	25	> +100%
<b>Resultado Integral</b>	<b>2,598</b>	<b>2,389</b>	<b>3,298</b>	<b>27%</b>	<b>9,320</b>	<b>8,693</b>	<b>-7%</b>

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

## Margen Financiero

El margen financiero fue de \$6,734 millones al cierre del tercer trimestre de 2023, un incremento de \$59 millones o 1% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como en inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de clientes.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$234 millones o 4%; debido a mayores volúmenes de cartera hipotecaria y un día más de operación, compensados con mayor gasto de intereses por incremento en depósitos de exigibilidad inmediata.

El margen financiero acumulado al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$19,893 millones, un incremento anual de \$1,073 millones o 6%, respecto al mismo periodo de 2022, El crecimiento fue impulsado por mayores ingresos provenientes de cartera corporativa e hipotecaria; compensados parcialmente por mayores intereses pagados resultantes del cambio en la mezcla en depósitos (mayores volúmenes en depósitos del público en general), y al incremento en la tasa de referencia.

## Ingresos no Financieros

El total de ingresos no financieros fue de \$1,747 millones en el tercer trimestre de 2023, un incremento de \$116 millones o 7% respecto al mismo periodo del año anterior, explicada por mayores ingresos provenientes de cartera comercial y seguros (ambos en otros ingresos / egresos de la operación).

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$45 millones o 3%, debido a menores ingresos por mercados cambiarios e instrumentos financieros (ambos en intermediación), compensados parcialmente por mayores ingresos /egresos de la operación y comisiones.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$5,583 millones, un crecimiento anual de \$771 millones o 16%, La variación se debió principalmente a mayores ingresos provenientes de instrumentos financieros derivados (en intermediación) y menores quebrantos (en otros ingresos / egresos de la operación).

	3 meses				9 meses		
	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
<b>Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>							
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	1	-	-100%	1	2	100%
Actividades Fiduciarias	58	53	53	-9%	176	166	-6%
Apertura de Cuenta	5	5	6	20%	13	17	31%
Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	59	61	34	-42%	166	170	2%
Cheques Certificados	1	-	1	0%	2	2	0%
Cheques de caja	-	1	-	0%	1	1	0%
Compraventa de instrumentos financieros	-	3	(1)	>-100%	1	2	100%
Manejo de Cuenta	97	82	83	-14%	269	248	-8%
Operaciones de Crédito	476	378	403	-15%	1,258	1,181	-6%
Otras Comisiones y Tarifas	399	369	395	-1%	1,090	1,259	16%
Servicios de Banca Electrónica	47	45	45	-4%	136	141	4%
Transferencia de Fondos	27	26	25	-7%	82	78	-5%
<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,170</b>	<b>1,024</b>	<b>1,044</b>	<b>-11%</b>	<b>3,195</b>	<b>3,267</b>	<b>2%</b>

	3 meses				9 meses		
<b>Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	(51)	(23)	9	> -100%	(82)	21	> -100%
Aportaciones al IPAB	(505)	(542)	(551)	9%	(1,499)	(1,626)	8%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	60	9	8	-87%	192	52	-73%
Donativos	(9)	-	-	-100%	(9)	-	-100%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	17	30	18	6%	39	54	38%
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito	-	-	-	0%	1	-	-100%
Ingresos por Arrendamiento	3	19	11	> +100%	14	33	> +100%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	39	51	53	36%	100	150	50%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	603	719	782	30%	2,184	2,263	4%
Quebrantos	(81)	(66)	(73)	-10%	(557)	(211)	-62%
Recuperaciones	2	11	3	50%	8	14	75%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	11	-	13	18%	11	13	18%
<b>Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación</b>	<b>89</b>	<b>208</b>	<b>273</b>	<b>&gt; +100%</b>	<b>402</b>	<b>763</b>	<b>90%</b>

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

	3 meses				9 meses		
<b>Scotiabank- Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
<b>Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios</b>	<b>(772)</b>	<b>(287)</b>	<b>(574)</b>	<b>-26%</b>	<b>267</b>	<b>(1,006)</b>	<b>&gt; -100%</b>

En el tercer trimestre de 2023, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$574 millones, una disminución de \$198 millones o 26% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos en la cartera comercial; compensados parcialmente por menores reservas adicionales y mayores requerimientos en la cartera automotriz.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra un incremento de \$287 millones, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial y tarjeta de crédito.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$1,006 millones, un incremento de \$1,273 millones respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias, producto del beneficio en T1 2022 de la implementación de IFRS 9.

## Gastos de Administración y Promoción

	3 meses				9 meses		
<b>Scotiabank- Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
Gastos de Personal	(1,696)	(2,001)	(1,799)	6%	(5,871)	(6,167)	5%
Gastos de Operación	(2,354)	(2,279)	(2,297)	-2%	(6,523)	(6,643)	2%
<b>Total de Gastos de Administración y Promoción</b>	<b>(4,050)</b>	<b>(4,280)</b>	<b>(4,096)</b>	<b>1%</b>	<b>(12,394)</b>	<b>(12,810)</b>	<b>3%</b>

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,096 millones en el tercer trimestre, un incremento de \$46 millones o 1% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a un incremento de \$103 millones o 6% en gastos de personal por salarios y PTU; compensados parcialmente por una disminución de \$57 millones en gastos de operación por menores amortizaciones y gastos legales.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$184 millones o 4% por una disminución de los gastos de personal de \$202 millones o 10%.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendieron a \$12,810 millones, un incremento anual de \$416 millones o 3%. Los gastos de personal mostraron un incremento de \$296 millones o 5%, debido principalmente a salarios. Por su parte, los gastos de operación mostraron un incremento anual de \$120 millones o 2%, debido a mayores gastos por amortizaciones y depreciaciones; compensados con menores gastos generales.

## Impuestos a la Utilidad

	3 meses				9 meses		
<b>Scotiabank-Impuestos - Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%	30 sep 2022	30 sep 2023	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(813)	(979)	(1,103)	36%	(2,242)	(3,044)	36%
Impuesto a la Utilidad Diferido	199	(315)	228	15%	(140)	(333)	> +100%
<b>Total de Impuestos a la Utilidad</b>	<b>(614)</b>	<b>(1,294)</b>	<b>(875)</b>	<b>43%</b>	<b>(2,382)</b>	<b>(3,377)</b>	<b>42%</b>

En el tercer trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$875 millones, un incremento de \$261 millones o 43% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por la disminución de la inflación.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto disminuyó \$419 millones o 32%, en su mayoría por el incremento de la inflación trimestre contra trimestre.

Los impuestos netos acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendieron a \$3,377 millones, un incremento anual de \$995 millones o 42%, debido a la disminución de la inflación del ejercicio.

## Balance General

<b>Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	219,145	266,608	275,547	26%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	452,361	466,023	479,687	6%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,102	19,262	19,791	9%
Partidas diferidas	0	2,861	2,899	> +100%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,530)	(15,837)	(15,793)	2%
Otros Activos	41,850	37,076	41,081	-2%
<b>Total Activo</b>	<b>715,928</b>	<b>775,993</b>	<b>803,212</b>	<b>12%</b>
Depósitos	446,817	508,629	530,579	19%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	44,084	34,690	30,451	-31%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,099	9,054	9,102	0%
Otros Pasivos	138,439	145,795	151,957	10%
<b>Capital</b>	<b>77,489</b>	<b>77,825</b>	<b>81,123</b>	<b>5%</b>
<b>Total Pasivo y Capital</b>	<b>715,928</b>	<b>775,993</b>	<b>803,212</b>	<b>12%</b>

Al 30 de septiembre de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$803,212 millones, un incremento de \$87,284 millones u 12% respecto al cierre de septiembre de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes de cartera de crédito, en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico), inversiones en instrumentos financieros (gubernamental) y en instrumentos financieros derivados.

Los activos totales incrementaron \$27,219 o 4% millones respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes de cartera de crédito e inversiones en instrumentos financieros (gubernamental).

El total del pasivo registró \$722,089 millones al 30 de septiembre de 2023, un incremento de \$83,650 millones o 13% respecto al año pasado. Este incremento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos.

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total incrementó \$23,921 millones o 3%, principalmente por mayores volúmenes en depósitos.



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

<b>Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	33,608	33,368	34,424	2%
Créditos a la Vivienda	182,640	198,261	205,076	12%
<b>Total Préstamos de Menudeo</b>	<b>216,248</b>	<b>231,629</b>	<b>239,500</b>	<b>11%</b>
Actividad Empresarial o Comercial	207,847	201,226	200,356	-4%
Entidades Financieras	15,446	15,909	24,931	61%
Entidades Gubernamentales	12,820	17,259	14,900	16%
<b>Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales</b>	<b>236,113</b>	<b>234,394</b>	<b>240,187</b>	<b>2%</b>
<b>Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2</b>	<b>452,361</b>	<b>466,023</b>	<b>479,687</b>	<b>6%</b>

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de septiembre de 2023 alcanzó \$239,500 millones, un incremento anual de \$23,252 millones u 11% y \$7,871 o 3% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de septiembre de 2023 se ubicó en \$240,187 millones, un incremento de \$4,074 millones o 2% respecto al año pasado y de \$5,793 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento año contra año fue impulsado por mayores créditos a entidades financieras y gubernamentales; compensados parcialmente por cartera de actividad empresarial o comercial. Así mismo, el incremento trimestral se debe a mayores créditos a entidades financieras; compensados parcialmente por menores créditos gubernamentales.

## Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

	3 meses			
<b>Scotiabank – Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	18,102	19,262	19,791	9%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,530)	(15,837)	(15,793)	2%
<b>Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta</b>	<b>2,572</b>	<b>3,425</b>	<b>3,998</b>	<b>55%</b>
<b>Índice de morosidad</b>	<b>3.85%</b>	<b>3.97%</b>	<b>3.96%</b>	<b>11 pb</b>

Al 30 de septiembre de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$19,791 millones, un incremento anual de \$1,689 millones o 9% y un incremento trimestral de \$529 millones o 3%.



En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,793 millones, un incremento anual de \$263 millones o 2% y una disminución de \$44 millones respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.2% de la cartera total, una disminución de 14pb respecto al año anterior y de 10pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 79.8% al 30 de septiembre de 2023, una disminución de 600pb respecto del año anterior y de 200pb respecto del trimestre anterior.

El índice de morosidad al 30 de septiembre de 2023 fue de 4.0%, un incremento de 11pb respecto del año anterior y una disminución de 1pb respecto al trimestre pasado.

## Depósitos

<b>Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023	A/A Δ%
<b>Total Depósitos Vista y Ahorro</b>	<b>230,036</b>	<b>257,433</b>	<b>269,967</b>	<b>17%</b>
Público en General	191,459	204,187	207,459	8%
Mercado de Dinero	2,306	42,770	41,217	> +100%
<b>Total Depósitos a Plazo</b>	<b>193,765</b>	<b>246,957</b>	<b>248,676</b>	<b>28%</b>
Títulos de Crédito Emitidos	22,033	3,007	10,677	-52%
Cuenta global de captación sin movimientos	983	1,232	1,259	28%
<b>Total de Depósitos</b>	<b>446,817</b>	<b>508,629</b>	<b>530,579</b>	<b>19%</b>

El total de depósitos registró \$530,579 millones al 30 de septiembre de 2023, un incremento anual de \$83,762 millones o 19%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo, así como de vista y ahorro. Respecto al trimestre anterior, el incremento fue de \$21,950 millones o 4%, debido a mayores depósitos a la vista y ahorro, así como en títulos de crédito emitidos.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 30 de septiembre de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,102 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

<b>Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros</b> (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
<b>Instrumentos financieros negociables</b>	<b>73,005</b>	<b>1,803</b>	<b>24</b>	<b>-</b>	<b>74,832</b>
Sin restricción:	-	-	19	-	19
Restringidos:	73,005	1,803	5	-	74,813
En operaciones de reporto	63,655	1,803	-	-	65,458
Préstamos de valores	1,112	-	-	-	1,112
Otros	8,238	-	5	-	8,243
<b>Instrumentos financieros para cobrar o vender</b>	<b>62,217</b>	<b>20,958</b>	<b>-</b>	<b>2,480</b>	<b>85,655</b>
Sin restricción:	60,763	20,958	-	2,480	84,201
Restringidos:	1,454	-	-	-	1,454
En operaciones de reporto	115	-	-	-	115
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	1,339	-	-	-	1,339
<b>Instrumentos financieros para cobrar principal e interés</b>	<b>4,847</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>4,847</b>
Sin restricción	4,847	-	-	-	4,847
<b>Total</b>	<b>140,069</b>	<b>22,761</b>	<b>24</b>	<b>2,480</b>	<b>165,334</b>

<b>Scotiabank</b> <b>Inversiones en Instrumentos Financieros no Gubernamentales</b> (Superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)				
Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
<b>I-BANSAN-23271</b>	<b>14,913,844,521</b>	<b>11.15%</b>	<b>3</b>	<b>14,904</b>

<b>Scotiabank-Instrumentos financieros derivados</b> (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023 valor razonable)														
Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	2,262	2,234	-	-	1,471	1,332	334	287	30,909	30,933	-	-	34,976	34,786
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	13,496	9,071	-	-	13,496	9,071

**Scotiabank-Montos nacionales en operaciones derivadas**  
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de septiembre de 2023)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
<b>Con fines de negociación</b>												
Posición USD	2,556	2,720	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	44	44	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	69	69	458	406	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	3	3	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	30	30	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	144	144	1,084	795	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	2,562	3,256	678	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	27,821	27,213	376,691	375,328	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	718	718	4,742	4,203	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
<b>Con fines de cobertura</b>												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	68,558	3,500	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	557	486	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	155,400	43,527	-	198,927
Créditos a entidades financieras	24,595	336	-	24,931
Créditos a entidades gubernamentales	11,408	3,492	-	14,900
Créditos al consumo	33,650	-	-	33,650
Créditos a la vivienda	201,793	13	46	201,852
<b>Total</b>	<b>426,846</b>	<b>47,368</b>	<b>46</b>	<b>474,260</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	1,429	-	-	1,429
Créditos al consumo	774	-	-	774
Créditos a la vivienda	3,220	1	3	3,224
<b>Total</b>	<b>5,423</b>	<b>1</b>	<b>3</b>	<b>5,427</b>

<b>Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	7,906	1,401	-	9,307
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	844	-	-	844
Créditos a la vivienda	9,550	28	6	9,584
<b>Total</b>	<b>18,356</b>	<b>1,429</b>	<b>6</b>	<b>19,791</b>

<b>Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)</b>	
<b>Saldo al 30 de junio de 2023</b>	<b>19,262</b>
Reestructuras	75
Recuperaciones	-486
Castigos y quitas	-675
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	1,589
Fluctuación Tipo Cambio	26
<b>Saldo al 30 de septiembre de 2023</b>	<b>19,791</b>

<b>Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)</b>		
Saldo al 30 de junio de 2023		15,837
Más: Creación de reservas		32
Calificación		594
Menos: Adjudicaciones y otros		12
Castigos y quitas		686
Comercial	11	
Hipotecario	132	
Consumo	543	
Desliz cambiario		(28)
Saldo al 30 de septiembre de 2023		15,793

<b>Scotiabank-Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>		
No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	21,155	29.85%
2	10,099	14.25%
3	7,791	10.99%
<b>Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos</b>		<b>39,045</b>

<b>Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	60.0%	64.2%	66.0%
Noroeste – Centro	11.0%	10.4%	9.9%
Norte	14.6%	12.9%	12.3%
Bajío	8.6%	7.1%	6.7%
Sur	5.8%	5.4%	5.1%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	44.9%	53.4%	54.3%
Noroeste – Centro	17.0%	15.9%	15.8%
Norte	7.3%	5.8%	5.7%
Bajío	15.1%	12.1%	12.2%
Sur	15.7%	12.8%	12.0%

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

Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	432,670	893	97	478	310	1,778
Riesgo A2	57,006	538	27	205	15	785
Riesgo B1	8,306	75	46	61	16	198
Riesgo B2	6,826	15	51	33	57	156
Riesgo B3	3,585	13	24	35	41	113
Riesgo C1	2,725	6	40	65	52	163
Riesgo C2	3,729	85	32	91	221	429
Riesgo D	8,256	698	56	292	1,411	2,457
Riesgo E	11,696	6,119	602	256	1,888	8,865
<b>Total</b>	<b>534,799</b>	<b>8,442</b>	<b>975</b>	<b>1,516</b>	<b>4,011</b>	<b>14,944</b>
<b>Exceso</b>						<b>849</b>
<b>Reservas Constituidas</b>						<b>15,793</b>

**NOTAS:**

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	3
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		37
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		5
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		804
<b>Total</b>	<b>\$</b>	<b>849</b>

### Terminación anticipada de los programas hipotecarios

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

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

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

Asimismo, los Cetes Especiales que al 30 de septiembre de 2023 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses” son:

<b>Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>			
	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,757	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
<b>Total</b>	<b>11,209,692</b>	<b>1,757</b>	

<b>Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	4,738	1,055
Pagos anticipados	(1,147)	(255)
Comisiones cobradas por anticipado	471	104
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	713	157
Plan de pensiones	1,027	228
Provisiones y otros	908	157
Otros	(655)	(53)
<b>Efecto Neto en Diferido</b>	<b>6,055</b>	<b>1,393</b>

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



<b>Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos</b> (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	10,933	2,769	-	13,702
Largo	-	-	4,500	3,836	-	8,336
<b>Total</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>15,433</b>	<b>6,605</b>	<b>-</b>	<b>22,038</b>
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.89%	10.89%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	7,454	-	25	437	-	7,916
Largo	-	-	-	497	-	497
<b>Total</b>	<b>7,454</b>	<b>-</b>	<b>25</b>	<b>934</b>	<b>-</b>	<b>8,413</b>
Tasa Promedio	5.97%	0.00%	6.66%	5.81%	0.00%	
<b>Total Préstamos Interbancarios</b>	<b>7,454</b>	<b>-</b>	<b>15,458</b>	<b>7,539</b>	<b>-</b>	<b>30,451</b>

Scotiabank no cuenta con créditos o financiamientos específicos que representen más del 10% de los pasivos que se muestran en sus estados financieros al 30 de septiembre de 2023.

<b>Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional</b>	30 sep 2022	30 jun 2023	30 sep 2023
<b>Depósitos a la Vista</b>	<b>54.4%</b>	<b>51.2%</b>	<b>52.2%</b>
Metropolitano	24.3%	24.8%	25.6%
Noroeste – Centro	11.2%	9.1%	8.8%
Norte	7.3%	6.9%	7.5%
Bajío	5.9%	4.8%	4.8%
Sur	5.7%	5.6%	5.5%
<b>Depósitos Ventanilla</b>	<b>45.1%</b>	<b>40.3%</b>	<b>39.9%</b>
Metropolitano	18.1%	16.3%	16.5%
Noroeste - Centro	6.1%	4.0%	4.4%
Norte	8.3%	7.3%	6.6%
Bajío	6.6%	6.6%	6.3%
Sur	6.0%	6.1%	6.1%
<b>Total de Captación del Público</b>	<b>99.5%</b>	<b>91.5%</b>	<b>92.1%</b>
<b>Fondeo Profesional</b>	<b>0.5%</b>	<b>8.5%</b>	<b>7.9%</b>

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional Tasa Promedio (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)	Pesos	Dólares
	Depósitos a la vista (incluye ahorro)	5.84%
Depósitos a plazo	10.17%	0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)	30 sep 2023
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(1,160)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(12)
Resultado por valuación de divisas	(1,218)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	3,087
Resultado por compraventa de divisas	858
Costos de transacción	(2)
<b>Total</b>	<b>1,553</b>

## Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de septiembre de 2023, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

Cuarta*	
Clave de Pizarra	SCOTIAB 23
Monto de la Emisión	\$7,125 millones
Fecha de Emisión y Colocación	18 agosto 2023
Plazo de Vigencia de la Emisión	927 días, aprox. 2.5 años
Garantía	Quirografaria
Tasa de interés	TIIIE28+0.04
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) / "mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en o de 2010

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

## Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99_SCOTIAB_4-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99_SCOTIAB_5-21	4,772,100	29-abr-21	26-abr-24	1093	Index (IDBTVER)	477,210,000
99_SCOTIAB_6-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99_SCOTIAB_9-21	3,928,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	392,820,000
99_SCOTIAB_10-21	3,796,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	379,625,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_2-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99_SCOTIAB_4-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_5-22	1,246,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	124,686,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_9-22	490,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,000,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
99_SCOTIAB_2-23	5,849,350	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	584,935,000
99_SCOTIAB_3-23	423,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	42,360,000
<b>Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2023</b>						<b>3,441,205,000</b>

# CAPITALIZACIÓN

<b>Scotiabank</b> <b>Integración del Capital</b> <b>Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios.</b> <b>(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>		
Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	49,837
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	17,819
4	Capital sujeto a eliminación gradual del capital común de nivel 1 (solo aplicable para compañías que no estén vinculadas a acciones)	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital común de nivel 1)	No aplica
6	<b>Capital común de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	81,125
<b>Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,392
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12	Reservas pendientes de constituir	-
13	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	-
14	Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia sobre los pasivos valuados a valor razonable	No aplica
15	Plan de pensiones por beneficios definidos	-
16 conservador	Inversiones en acciones propias	-
17 conservador	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	-
18 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
19 conservador	Inversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	-
20 conservador	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	-
21	Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales (monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo)	-

22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	9,129
A	del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	8,580
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	548
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	<b>Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1</b>	10,521
29	<b>Capital común de nivel 1 (CET1)</b>	70,603
<b>Capital adicional de nivel 1: instrumentos</b>		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,483
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,483
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el región 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	<b>Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios</b>	3,483
<b>Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios</b>		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica

38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	<b>Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1</b>	-
44	<b>Capital adicional de nivel 1 (AT1)</b>	3,483
45	<b>Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)</b>	74,087
<b>Capital de nivel 2: instrumentos y reservas</b>		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,904
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	804
51	<b>Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios</b>	4,709
<b>Capital de nivel 2: ajustes regulatorios</b>		
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	<b>Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2</b>	-
58	<b>Capital de nivel 2 (T2)</b>	4,709
59	<b>Capital total (TC = T1 + T2)</b>	78,796
60	<b>Activos ponderados por riesgo totales</b>	461,662
<b>Razones de capital y suplementos</b>		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	15.29%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.05%

63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.07%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	18.39%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)	0.60%
68	Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	8.29%
<b>Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)</b>		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
<b>Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)</b>		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica
75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
<b>Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2</b>		
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	804
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,101
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-
<b>Instrumentos de capital sujetos a eliminación gradual (aplicable únicamente entre el 1 de enero de 2018 y el 1 de enero de 2022)</b>		
80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-



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

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

16*	<p>El monto de la inversión en cualquier acción propia que:</p> <p>la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.</p>
17*	<p>Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.</p>
18*	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
19*	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
20*	<p>Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.</p>
21	<p>El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.</p>
22	<p>No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.</p>

23	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	<b>Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.</b>
	A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.
	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.	
O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.	
P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.	
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	<b>Ajustes nacionales considerados:</b> Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.
46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

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

83	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
84	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
85	Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

<b>Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>		
Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
<b>Activo</b>		
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	62,254
BG2	Cuentas de Margen	1,538
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	165,334
BG4	Deudores por reporto	2,690
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	48,472
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(1,252)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	486,584
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	19,884
BG11	Bienes adjudicados (neto)	508
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,455
BG13	Inversiones permanentes	3,946
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	14
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	6,026
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	2,366
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,737
	Activos Intangibles (neto)	4,531
<b>Pasivo</b>		
BG17	Captación tradicional	530,684
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	30,451
	Valores Asignados por liquidar	8,614
BG19	Acreedores por reporto	65,590
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	1,030
BG22	Instrumentos financieros derivados	43,857
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	26,681
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	663
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,067
	Pasivos por arrendamiento	1,857

	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,102
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	6,369
<b>Capital contable</b>		
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	67,654
<b>Cuentas de orden</b>		
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	257,626
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	450,991
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	75,900
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	10,214
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,030
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,647
BG41	Otras cuentas de registro	1,929,029

<b>Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General</b>				
<b>Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto</b>				
<b>(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>				
Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
<b>ACTIVO</b>				
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,392	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,392
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	
8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	



9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18		
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19		
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	-	
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	804	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$804
14	Inversiones en deuda subordinada	26-B	-	
15	Inversiones en organismos multilaterales	26-D	-	
16	Inversiones en empresas relacionadas	26-E	-	
17	Inversiones en capital de riesgo	26-F	-	
18	Inversiones en sociedades de inversión	26-G	-	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	8,580	BG 16 Activos Intangibles \$4,531 más Gastos de Instalación \$4,049
21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	548	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 548
<b>PASIVO</b>				
24	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil	8	-	
25	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles	9	-	
26	Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
27	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos	15		
28	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores	21	-	
29	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R	31	3,483	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,483
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	3,904	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,904
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	

<b>CAPITAL CONTABLE</b>				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	49,837	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$49,837
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	1,476	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$1476
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	16,343	BG 30 Reservas de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$763) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$457) más Resultado Neto \$8,451
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
<b>CUENTAS DE ORDEN</b>				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
<b>CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL</b>				
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

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

<b>Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)</b>		
Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	57,954	4,636
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,045	84
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA 's	3,195	256
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA 's o con rendimiento referido al INPC	42	3
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	3,869	310
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,865	149
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	92	7
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	1	0
Requerimiento de capital por impacto Vega	24	2
<b>Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo</b>		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	51	4
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
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%)	849	68
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,341	347
Grupo III (ponderados al 25%)	-	-
Grupo III (ponderados al 50%)	455	36
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	262	21

Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	2,770	222
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	157	13
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	26	2
Grupo VI (ponderados al 20%)	3,548	284
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,493	199
Grupo VI (ponderados al 30%)	9,491	759
Grupo VI (ponderados al 40%)	10,043	803
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,822	2,946
Grupo VI (ponderados al 70%)	35	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	23,788	1,903
Grupo VI (ponderados al 85%)	5,726	458
Grupo VI (ponderados al 100%)	50,696	4,056
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	134	11
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	18,378	1,470
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	10,090	807
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	120,609	9,649
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	85	7
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,641	131
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	496	40
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-

Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	8,081	646
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,701	296
Grupo IX (ponderados al 100%)	31,585	2,527
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	33	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,173	174
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	20	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	14	1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	44,982	3,599

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

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

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



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

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

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

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

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)					
Referencia	RUBRO	Sep-23 <sup>1)</sup> T	Jun-23 <sup>1)</sup> T-1	Mar-23 T-2	Dic-22 T-3
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	7,799	7,585	7,638	7,719
1a	No aplica				
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	461,662	456,829	459,745	475,011
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	1.63%	1.63%	1.63%	1.63%
3a	No aplica				
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	831,882	809,032	814,737	807,899
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	0.94%	0.94%	0.94%	0.94%
5a	No aplica				
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%

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

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

## Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

## Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

## **Riesgo de mercado**

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de septiembre de 2023 fue de \$16.5 millones y su promedio durante el tercer trimestre de 2023 fue de \$26.39 millones mismo que corresponde a un 0.034% del capital neto (\$77,963 millones a agosto 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,117,451	1,099,476
Mercado de Dinero	65,147	58,935
Tipo de cambio		
Cash	2,356	2,968
Derivados	117,340	111,360
Capitales		
Derivados	8,442	7,992

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	16.72	22.98
Tipo de cambio	8.17	10.22
Capitales	0.00	0.00
<b>VaR Global</b>	<b>16.50</b>	<b>26.39</b>

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

Debido a que la medida del VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, diariamente se realizan pruebas bajo condiciones extremas con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando fluctuaciones anormales en los precios de mercado (cambios en la volatilidad y correlaciones entre factores de riesgo). La prueba bajo condiciones extremas al cierre del tercer trimestre de 2023 muestra una pérdida máxima de \$248.76 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado “Error de diciembre” y México 1997 por el efecto de la “crisis del rublo” y la crisis financiera asiática.

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

## Riesgo de liquidez y tasas de interés

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



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

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

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

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

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

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>2</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US)	72,513	83,087
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,949	116,211

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.

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

<sup>2</sup> Cifras previas al cierre del tercer trimestre 2023.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el tercer trimestre de 2023 de 154% y 109% respectivamente.

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

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

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

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(1,181)	(1,092)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(424)	(419)

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender <sup>1)</sup>	85,655	81,198
Derivados de Cobertura	85,966	86,173

<sup>1)</sup>. Incluye operaciones de venta en directo y en reporto.

## Baja de Calificación

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de septiembre 2023 y el promedio del tercer trimestre del 2023 fueron \$3,033 millones y \$2,867 millones, respectivamente.

## Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Al cierre del tercer trimestre de 2023, el Banco mantiene \$447 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

## Información metodológica

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

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

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

<b>Métricas Riesgo de Crédito<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras al 30 de septiembre 2023)</b>	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.30%	3.05%
Consumo	3.83%	13.51%
Cartera Comercial	0.57%	3.94%
<b>Total</b>	<b>0.68%</b>	<b>4.23%</b>

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

<b>Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup></b> <b>(Cifras a millones al 30 de septiembre 2023)</b>	EI <sup>2)</sup>	PI	SP
Hipotecas	205,076	1.59%	17.09%
Consumo	52,371	4.73%	72.16%
Cartera Comercial	282,519	1.48%	44.13%

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

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

## Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

## Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de septiembre 2023 y en promedio durante el tercer trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.67% y 0.79% respectivamente.

## Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

## **Riesgo Operacional**

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

## **Metodología general**

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

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

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

## **Evaluación de riesgo operacional**

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

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

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

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

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

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

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



## Riesgo Legal

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

Además de estar sujeto a la metodología general de riesgos operacionales, el Banco cuenta con una metodología de estimación de pérdidas de riesgo legal, a través de la cual se estiman las probables pérdidas como consecuencia de un resultado adverso de sus juicios en proceso. Dicha metodología está basada en la experiencia de pérdidas de ejercicios anteriores, con las que, mediante un análisis estadístico de severidad y ocurrencia, se determina la probabilidad de pérdida de los asuntos legales en curso.

## Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

## Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de julio - septiembre 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$77.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$40.3 millones, donde \$2.4 millones corresponden a riesgo operacional y \$37.9 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

## Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

**Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)**  
**Periodo Reportado: julio 2023 – septiembre 2023 (T3 2023)**  
**Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez<sup>3</sup>**

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T3 2023		Calculo Consolidado T3 2023	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	114,362.12	No aplica	114,362.12
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>					
2	Financiamiento minorista no garantizado	164,728.92	13,269.21	164,728.92	13,269.21
3	Financiamiento estable	96,216.55	6,419.07	96,216.55	6,419.07
4	Financiamiento menos estable	68,512.37	6,850.15	68,512.37	6,850.15
5	Financiamiento mayorista no garantizado	245,689.41	87,175.83	245,689.41	87,175.83
6	Depósitos operacionales	126,569.67	30,891.22	126,569.67	30,891.22
7	Depósitos no operacionales	116,662.31	53,850.21	116,662.31	53,850.21
8	Deuda no garantizada	2457.441322	2434.392516	2457.441322	2434.392516
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	123.6273736	No aplica	123.6273736
10	Requerimientos adicionales:	239,825.35	17,282.14	239,825.35	17,282.14
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,383.04	5,181.83	7,383.04	5,181.83
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	232,442.30	12,100.31	232,442.30	12,100.31
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	30.36706667	30.07428571	30.36706667	30.07428571
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,856.87	2,856.82	2,856.87	2,856.82
16	<b>TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	120,737.71	No aplica	120,737.71
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	4,363.29	183.2957363	4,363.29	183.2957363
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	43,136.88	29,804.45	43,136.88	29,804.45
19	Otras entradas de efectivo	16,692.59	16,700.33	16,692.59	16,700.33
20	<b>TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO</b>	64,192.76	46,688.08	64,192.76	46,688.08
Importe ajustado					
21	<b>TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES</b>	No aplica	114,362.12	No aplica	114,362.12
22	<b>TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO</b>	No aplica	74,049.63	No aplica	74,049.63
<b>23</b>	<b>COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ<sup>(1)</sup></b>	<b>No aplica</b>	<b>153.52</b>	<b>No aplica</b>	<b>153.52</b>

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

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

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

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

#### Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$65,841 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$34,815 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$3,033 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$11,798 millones.

#### Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$15,093 millones y por operaciones de call money de \$10,638 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$14,904 millones.

#### Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$122,356 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$72,655 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$40,475 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$6,831 millones y \$2,395 millones en títulos de nivel 2.

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

**Promedio del segundo trimestre 2023: 140% – promedio del tercer trimestre 2023: 154%** El coeficiente de cobertura de liquidez creció 1400 pb respecto del segundo trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$4,518 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$2,006 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$12,306 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$4,632 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$2,351, millones.

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

<sup>4</sup> Salidas y entradas ponderadas para los próximos 30 días considerando los factores definidos en las Disposiciones de Carácter General sobre los requerimientos de Liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple.

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

<b>Evolución de Activos Líquidos T3-2023</b>	Julio	Agosto	Septiembre
Efectivo	6%	6%	6%
Reservas en el Banco Central	33%	41%	33%
Nivel 1	59%	51%	59%
Nivel 2 <sup>a</sup>	2%	2%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
<b>Total de Activos Líquidos Ponderados</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

<b>Concentración de fuentes de Financiamiento</b>	Julio	Agosto	Septiembre
<b>CAPTACION TRADICIONAL</b>			
Depósitos de exigibilidad inmediata	49%	47%	48%
Depósitos a plazo			
Del público en general	37%	37%	37%
Mercado de dinero	8%	8%	7%
Títulos de crédito emitidos	1%	2%	2%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	3%	4%	4%
De largo plazo	2%	2%	2%
<b>Total</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>	<b>100%</b>

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

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

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

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

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

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

<b>Exposición Potencial Futura (septiembre 2023)</b> <b>(Cifras en millones de pesos)</b>	
Con contrato de compensación	3,198
Sin contrato de compensación	8,479
Posibles llamadas de margen (septiembre 2023)	
Colateral en Tránsito	21
Downgrade (septiembre 2023)	
Baja calificación 3 niveles	3,033

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

<b>Scotiabank-Exposición en Derivados</b> <b>(cifras en millones de pesos)</b>	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,117,451
Tipo de cambio	117,340
Capitales	8,442
<b>Total</b>	<b>1,243,233</b>

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el tercer trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5% al cierre de septiembre del 2023 y en promedio durante tercer trimestre del 2023 fue de -6%.

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

## I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Descripción <sup>7</sup>	Promedio T3 2023	Septiembre 2023
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	31,329	41,418
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	165,083	175,211
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	42	43
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	40	41
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	42	43
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	40	41

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

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

Los resultados al cierre de septiembre 2023 y el promedio del tercer trimestre de 2023 son:

Scotiabank <sup>8</sup>	Posición (Cierre) <sup>9</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	72,513	83,087
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,949	116,211

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

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

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

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



## II. Información cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el tercer trimestre de 2023, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del tercer trimestre 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

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

(Cifras en millones de pesos)	Cifras Individuales					Cifras Consolidadas					
	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	
	Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE											
1	Capital:	83,549.45	0.00	0.00	0.00	83,549.45	83,549.45	0.00	0.00	0.00	83,549.45
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	83,549.45	0.00	0.00	0.00	83,549.45	83,549.45	0.00	0.00	0.00	83,549.45
3	Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	Depósitos minoristas:	0.00	202,398.35	1,205.84	46.80	187,777.85	0.00	202,398.35	1,205.84	46.80	187,777.85
5	Depósitos estables.	0.00	89,083.37	662.09	11.51	85,269.70	0.00	89,083.37	662.09	11.51	85,269.70
6	Depósitos menos estables.	0.00	113,314.98	543.75	35.29	102,508.15	0.00	113,314.98	543.75	35.29	102,508.15
7	Financiamiento mayorista:	0.00	362,906.98	31,693.45	17,029.57	161,680.05	0.00	362,906.98	31,693.45	17,029.57	161,680.05
8	Depósitos operacionales.	0.00	22,290.78	0.00	0.00	11,145.39	0.00	22,290.78	0.00	0.00	11,145.39
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	340,616.21	31,693.45	17,029.57	150,534.66	0.00	340,616.21	31,693.45	17,029.57	150,534.66
10	Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11	Otros pasivos:	0.00	29,342.33	0.00	3,867.01	3,867.01	0.00	29,342.33	0.00	3,867.01	3,867.01
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	29,342.33	0.00	3,867.01	3,867.01	0.00	29,342.33	0.00	3,867.01	3,867.01
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	83,549.45	594,647.67	32,899.29	20,943.38	436,874.36	83,549.45	594,647.67	32,899.29	20,943.38	436,874.36
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,412.90	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	7,412.90
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	121,648.01	37,178.43	310,115.18	340,786.18	0.00	121,648.01	37,178.43	310,115.18	340,786.18
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	5,670.46	0.00	0.00	567.05	0.00	5,670.46	0.00	0.00	567.05
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	12,467.31	5,400.79	4,336.64	8,907.13	0.00	12,467.31	5,400.79	4,336.64	8,907.13
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	84,836.95	28,613.64	129,380.15	160,526.55	0.00	84,836.95	28,613.64	129,380.15	160,526.55
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	3,440.96	3,652.59	201,551.22	161,320.94	0.00	3,440.96	3,652.59	201,551.22	161,320.94

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

23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	460.17	488.58	27,056.66	18,061.21	0.00	460.17	488.58	27,056.66	18,061.21
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	15,692.49	0.00	1,903.84	9,464.51	0.00	15,692.49	0.00	1,903.84	9,464.51
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	48,911.24	902.84	5,134.53	40,797.46	0.00	48,911.24	902.84	5,134.53	40,797.46
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	2,090.87	0.00	0.00	1,777.24	No Aplica	2,090.87	0.00	0.00	1,777.24
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,996.69	No Aplica	0.00	0.00	0.00	3,996.69
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,963.71	No Aplica	0.00	0.00	0.00	2,963.71
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		46,820.37	902.84	5,134.53	32,059.83	0.00	46,820.37	902.84	5,134.53	32,059.83
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	233,632.98	0.00	0.00	11,681.65	No Aplica	233,632.98	0.00	0.00	11,681.65
33	Total de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	400,678.18	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	400,678.18
34	<b>Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>109.03</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>No Aplica</b>	<b>109.03</b>

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

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

- **Fondeo Estable Disponible:**  
Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$179,416 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$135,127 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$88,512 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$15,232 millones y \$15,543 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$6,330 millones.
- **Fondeo Estable Requerido:**  
Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$342,813 millones y por operaciones mercado de dinero de \$16,564 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$14,435 millones, deducciones de capital por \$10,521 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$7,508 millones.

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

**Promedio del segundo trimestre del 2023: 107.67% – Promedio del tercer trimestre del 2023: 109.03%** El coeficiente de financiamiento neto incrementó 136pb respecto al primer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 6,776 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 1,703 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyeron \$5,835 millones.

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

<b>Monto Computable (MXN MM)</b>	Julio	Agosto	Septiembre
Financiamiento Estable Disponible	433,228	437,236	440,159
Financiamiento Estable Requerido	398,873	400,665	402,496
<b>Coficiente de Fondo Estable Neto</b>	<b>108.61%</b>	<b>109.13%</b>	<b>109.36%</b>

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

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

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

## Posiciones en Acciones

Al cierre de septiembre de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$24 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.57) millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	213,000	0.77	0.80	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	18,000	1.65	1.67	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	190,000	2.01	2.08	(0.07)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	400,000	5.98	6.62	(0.64)
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	493,936	1.65	1.70	(0.05)
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	479	0.06	0.07	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,500	6.73	6.56	0.17
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	24,000	2.20	2.12	0.08
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	3,500	1.64	1.65	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	2,010	1.52	1.51	0.01
<b>Total</b>			<b>1,348,425.00</b>	<b>24.21</b>	<b>24.78</b>	<b>(0.57)</b>

Al cierre del tercer trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.52 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	163,547	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	7,952	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	10,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	15,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	566,844	0.01	(0.09)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	61,678	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	11,864	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	66,132	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	241,695	-	(0.38)	(0.38)
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	2,726	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	89	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	5,800	0.25	-	0.25
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	5,200	0.10	(0.02)	0.08
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	1,864	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	37	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	4,112	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	13,614	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	120,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1A-C-*	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	779	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,965	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	528	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	150,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	209,426	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	38,188	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	28,519	0.01	(0.08)	(0.07)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	159,236	-	(0.18)	(0.18)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	193,072	-	(0.24)	(0.24)
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	20,000	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	449,423	-	(0.13)	(0.13)
Scotiabank	Pública	1-AMX-B	260,000	0.05	-	0.05

Scotiabank	Pública	1A-C-*	9,209	0.11	(0.04)	0.07
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	805	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	1,900	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	13,100	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	1,700	0.08	-	0.08
<b>Total</b>			<b>2,838,004</b>	<b>0.83</b>	<b>(1.35)</b>	<b>(0.52)</b>

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

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

Al 30 de septiembre de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$7.39 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 5.43 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.96 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coefficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	24.44	-	24.44	22.23%	5.43
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	24.29	-	24.29	8.00%	1.94
Índices accionarios	0.15	-	0.15	4.00%	0.01
Requerimiento por riesgos específico	0.15	-	0.15	4.00%	0.01
<b>Total Requerimiento de capital</b>					<b>7.39</b>



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

Referencia	Rubro	jun-23	sep-23
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	736,726	755,925
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,527)	(10,521)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	726,200	745,404
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)	7,944	9,981
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	4,364	4,913
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)	(3,112)	(2,479)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)		
9	Importe notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos		
10	(Compensaciones realizadas al notional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)		
11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	9,195	12,415
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	130	2,690
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(130)	(2,690)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	3	4
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)	3	4
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	255,252	257,626
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(181,618)	(183,567)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	73,634	74,059
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	70,881	74,087
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	809,032	831,882
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.76%	8.91%

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

Referencia	DESCRIPCION	jun-23	sep-23
1	Activos totales	778,445	807,087
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	(643)	(548)
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	(32,394)	(36,056)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(127)	(2,686)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	73,634	74,059
7	Otros ajustes	(9,884)	(9,973)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	809,032	831,882

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

Referencia	DESCRIPCION	jun-23	sep-23
1	Activos totales	778,445	807,087
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(41,589)	(48,472)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(130)	(2,690)
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	736,726	755,925

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

CONCEPTO/PERIODO	jun-23	sep-23	Variación
Capital Básico <sup>1)</sup>	70,881	74,087	3,206
Activos Ajustados <sup>2)</sup>	809,032	831,882	22,850
Razón de Apalancamiento <sup>3)</sup>	8.76%	8.91%	15 pb

1). Reportado en la fila 20

2). Reportado en la fila 21 y

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

Cifras previas a la réplica de Banxico

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

El indicador se ubicó en 8.91%, 15pb superior respecto al trimestre anterior, por la mejora del capital nivel 1 de \$3,206 millones (+39 pbs) debido principalmente al resultado neto del periodo; compensada por el incremento en los activos ajustados (-24pb), principalmente por las partidas dentro del balance (netas) por \$19,204 millones (-22pb).

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

Referencia	Explicación
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico
	(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	<p>Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.</li> <li><b>b)</b> La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.</li> <li><b>c)</b> El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.</li> <li><b>d)</b> El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.</li> <li><b>e)</b> El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.</li> </ul> <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.
	En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
10	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.
11	Suma de las líneas 4 a 10
12	Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)
13	<p>Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li><b>a)</b> Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.</li> <li><b>b)</b> Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.</li> <li><b>c)</b> Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.</li> <li><b>d)</b> Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.</li> </ul> <p>El monto se debe registrar con signo negativo.</p>

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

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

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

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

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

### Agencias Calificadoras

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

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

### Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$91,319 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$62,254 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 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



# Instrumentos Financieros Derivados

# I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics 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 2023 y en promedio para el tercer trimestre de 2023 es de:

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>11</sup>	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	72,513	83,087
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,949	116,211

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

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

## Inventario de modelos de derivados

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

### Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
Cross Currency Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
				FX Rate	VALMER
Interest Rate Swap	(All Interest Rate)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY,GBP	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
Interest Rate Cap/Floor	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
OTC Binary Interest rate Option	(All Interest Rate)	MXN,USD	Cap/Floor Black's	Interest Rate Curve	VALMER
				Surface	Bloomberg/Reuters
IRS Futures	TIIE Fondeo	MXN	Price	Price	VALMER
Listed Interest Rate Swap (CME)	TIIE Fondeo	MXN	Swap	Interest Rate Curve	VALMER
OTC European Index Call Spread Option	OTC European Index Call Spread Option	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Call Spread Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC European Basket Option	Equity Index, Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC European Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index whith Target Volatility (Vol Under 15%)	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					
OTC Index Binary Equity Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Equity Option	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
Dividend					



Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
OTC Single Stock Autocallable Option	Common Stock, Equity Index, ETF	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	EqOpt Autocallable Note	Curve	VALMER
				Price	K2
				Surface	Trader's mark
				Correlation	
				Dividend	
Bond Futures	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Index Future	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Equity Future	Equity Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
Interest Rate Future	(All Interest Rate)	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Equity Index Future Option	Equity Index	MXN	Price	OPICS	VALMER
Listed Single Stock Option	Common Stock	MXN	Price	OPICS	VALMER
FX Futures	FX Spot	USD,BRL,CLP,COP, MXN,PEN,AUD,EUR, JPY,GBP,CHF,CAD	Price	OPICS	VALMER
OTC Foreign Exchange (FX) American Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Cox, Ross and Rubinstein	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Merton, Reiner and Rubinstein	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC Foreign Exchange (FX) European Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Garman and Kohlhagen	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
OTC FX Binary Option	FX Spot	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Black-Scholes	Curve	VALMER
				FX Rate	
				Surface	
Precious Metals European Option	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Black 76	Curve	VALMER
				Price	
				Surface	
Precious Metals Forward	Gold/Silver Bullion	Gold/Silver	Forward OTC Model	Curve	VALMER
				Price	
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery Forward	FX Spot	MXN,USD,CAD,EUR, BRL,CLP,COP,PEN, AUD,JPY,GBP,CHF	Forex	Curve	VALMER
				FX Rate	

## Instrumentos valuados a costo

Product Name	Underlying	Product Currency	Valuation Model	Valuation Input	Daily Pricing Source
Listed Structured Notes	Common Stock	MXN,CAD,USD, EUR,JPY	Price	Price	VALMER

## Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

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

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

### Sujetos de Crédito

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

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

### Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

- La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al “Potential Future Exposure”.
- La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
- Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

- La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

## **Idoneidad del Cliente**

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

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

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

## **Políticas de VaR**

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

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

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

### **Métodos y técnicas de Valuación:**

#### **Cálculo de Sensibilidades**

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

#### **Portafolio de Renta Fija (Bonos)**

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

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

## **Bonos de Tasa Flotante**

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

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

## **Bonos Cupón Cero**

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

## **Riesgo de Crédito**

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

## **Sensibilidad del Pasivo**

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

## **Derivados de Tasas de Interés**

### **Swaps de Tasa de Interés**

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

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

### **Futuros de TIIE**

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

### **Futuros de Bono M**

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

## Futuros de CETE

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

### Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

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

Durante el tercer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

### Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

## Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

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

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

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

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

<b>Scotiabank (millones de pesos)</b>	Posición (Cierre) <sup>12</sup>	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	122,949	116,211

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:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

Parámetro	Descripción
<i>SD</i>	Salida de efectivo por derivados.
<i>T<sub>ii</sub></i>	Umbral con la Contraparte i en el estado i
<i>T<sub>ij</sub></i>	Umbral con la Contraparte i en el estado j
<i>MTM</i>	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	72,513	69,455	69,407	69,358
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(3,058)	(3,106)	(3,155)

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

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

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

#### Delta

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

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



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

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

## **Gamma**

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

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

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

## **Vega**

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

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

## **Rho**

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

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

## **Theta**

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

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

## Dividend Risk

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

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

## II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

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

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

<b>Scotiabank</b>	0-3 Meses	3 - 12 Meses	1 - 3 Años	3 - 5 Años	5 - 10 Años	10 - 30 Años	Total
Swaps	(113,268.00)	(50,839.00)	97,760.00	359,483.00	20,265.00	(18,899.00)	294,502.00
CCS	5.00	(17.00)	(46.00)	94.00	214.00	(12.00)	238.00
Caps&Floors	(300.00)	3,713.00	2,513.00	(352.00)	2.00	0.00	5,576.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
<b>Total DERIVADOS</b>	<b>(113,563.00)</b>	<b>(47,143.00)</b>	<b>100,227.00</b>	<b>359,225.00</b>	<b>20,481.00</b>	<b>(18,911.00)</b>	<b>300,316.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

### Análisis de sensibilidad

#### Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

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

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.30	28.27	50.00	(15.02)	100.00	(30.03)	200.00	(60.06)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.03)	(0.97)	0.10	-	0.40	(0.01)	1.00	(0.03)
a FX %	Forwards	87.26	1,568.56	0.10	(156.86)	0.20	(313.71)	0.50	(784.28)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
<b>Total</b>					<b>(171.88)</b>		<b>(343.75)</b>		<b>(844.37)</b>

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

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 30 de septiembre de 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo esta cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPUI5.INDX	152,351.00	5,548.00	38,930.00
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options IDBTV1.INDX	92,417.00	2,306.00	24,343.00
Options META.OQ	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SOXX.OQ	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options VLO.N	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>244,768.00</b>	<b>7,854.00</b>	<b>63,273.00</b>

1). Cifras expresadas en pesos

## Análisis de Stress

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

<b>Escenarios a la baja</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPIU5.INDX	(15,235.10)	(45,705.30)	(76,175.50)
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	(9,241.70)	(27,725.10)	(46,208.50)
Options MXSXAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>(24,476.80)</b>	<b>(73,430.40)</b>	<b>(122,384.00)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

<b>Escenarios al alza</b>	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPIU5.INDX	7,617.55	22,852.65	30,470.20
Options EEM.P	-	-	-
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options FXI.P	-	-	-
Options GLD.P	-	-	-
Options GOOG.OQ	-	-	-
Options ICLN.OQ	-	-	-
Options MEXIBX.INDX	4,620.85	13,862.55	18,483.4
Options MXSXAE.INDX	-	-	-
Options HSCE.INDX	-	-	-
Options MEXXLK.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
Options SBUX.USM	-	-	-
Options IBM.USM	-	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>12,238.40</b>	<b>36,715.20</b>	<b>48,953.60</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

<b>Scotiabank</b>	<b>Monto</b>
Probable	(24,476.80)
Poco Probable	(73,430.40)
Muy poco Probable	(122,384.00)

1). Cifras expresadas en pesos

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

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

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	366,000,000	(175,000,000)
CLIENTE 2	MXN	216,300,000	(54,000,000)
CLIENTE 3	MXN	21,600,000	(11,200,000)
CLIENTE 4	MXN	317,795,280	(224,100,000)
CLIENTE 5	USD	75,060,000	(41,200,000)
CLIENTE 6	USD	45,990,000	(17,250,000)
CLIENTE 7	USD	213,500,000	(335,900,000)
CLIENTE 8	USD	-	(830,000)
CLIENTE 9	USD	3,590,000	(6,830,000)
CLIENTE 10	USD	43,500,000	(27,640,000)
CLIENTE 11	MXN	41,100,000	(68,200,000)
CLIENTE 12	MXN	414,300,000	(217,800,000)
CLIENTE 13	MXN	454,800,000	(198,000,000)
CLIENTE 14	MXN	322,500,000	(277,776,432)
CLIENTE 15	MXN	2,000,000	-
CLIENTE 16	USD	8,300,000	-
CLIENTE 17	USD	120,000	(840,000)
CLIENTE 18	MXN	-	(33,200,000)
CLIENTE 19	USD	21,520,000	(13,230,000)
CLIENTE 20	USD	-	(1,300,000)
<b>TOTAL</b>		<b>2,567,975,280</b>	<b>(1,704,296,432)</b>

1). Cifras expresadas en pesos

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

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SDW689	03/07/2023	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SFD151	03/07/2023	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	
SIK106	03/07/2023	Active	118,981,330	usd	118,981,330	118,981,330	
SIK107	03/07/2023	Active	118,981,330	usd	118,981,330	118,981,330	
SDT456	04/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX061	04/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDX080	04/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHU214	04/07/2023	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SHU218	04/07/2023	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
P16883	05/07/2023	Active		mxn			14,411,121
SDT461	05/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT536	05/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU014	05/07/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGY062	05/07/2023	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	
P18164	06/07/2023	Active		usd			45,000,000
P18165	06/07/2023	Active		usd			45,000,000
SDT614	06/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU028	06/07/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SEC505	06/07/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SEC522	06/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDT846	07/07/2023	Active	46,596,764	mxn	46,596,764	46,596,764	
SEC746	07/07/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SGY371	07/07/2023	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	
SGY373	07/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHU532	07/07/2023	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SHU535	07/07/2023	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	
SIE055	07/07/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SIE073	07/07/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SDT226	10/07/2023	Active	2,400,000	mxn	2,400,000	2,400,000	
SDT247	10/07/2023	Active	2,400,000	mxn	2,400,000	2,400,000	
SDT510	10/07/2023	Active	4,927,000	mxn	4,927,000	4,927,000	
SDT514	10/07/2023	Active	4,927,000	mxn	4,927,000	4,927,000	
SDT598	10/07/2023	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDT606	10/07/2023	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDU404	10/07/2023	Active	7,426,637	mxn	7,426,637	7,426,637	
SDU420	10/07/2023	Active	7,426,637	mxn	7,426,637	7,426,637	
SEE942	10/07/2023	Active	2,225,154	mxn	2,225,154	2,225,154	
SEE954	10/07/2023	Active	2,225,154	mxn	2,225,154	2,225,154	
SIJ766	11/07/2023	Active	40,900,000	mxn	40,900,000	40,900,000	
SIJ807	11/07/2023	Active	40,900,000	mxn	40,900,000	40,900,000	
SDT660	12/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU156	12/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV048	13/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX005	13/07/2023	Active	65,000,000	mxn	65,000,000	65,000,000	
SDX076	13/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SED218	13/07/2023	Active	7,622,656	mxn	7,622,656	7,622,656	
SED315	13/07/2023	Active	7,622,656	mxn	7,622,656	7,622,656	
SGY906	13/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SGY907	13/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHS426	13/07/2023	Active	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000	
SHS429	13/07/2023	Active	1,500,000	usd	1,500,000	1,500,000	
SDT746	14/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT813	14/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SED704	14/07/2023	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SGY957	14/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGY999	14/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGZ106	14/07/2023	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SHN346	14/07/2023	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHV504	14/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SHV505	14/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIF309	14/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
SIF445	14/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
SIK972	14/07/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIK973	14/07/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SDT922	17/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHV922	17/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SHV935	17/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDT992	18/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SEE090	18/07/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHX450	18/07/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SIM227	18/07/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SDT784	19/07/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDU052	19/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU117	19/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU509	19/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU561	19/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHW269	19/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SHW288	19/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDU212	20/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SGZ753	20/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHO119	20/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDU654	21/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU764	21/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU831	21/07/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU891	21/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV575	21/07/2023	Active	69,318,927	mxn	69,318,927	69,318,927	
SHW615	21/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SHW640	21/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIG736	21/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
SIG755	21/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
SDU088	24/07/2023	Active	21,280,000	mxn	21,280,000	21,280,000	
SDU115	24/07/2023	Active	21,280,000	mxn	21,280,000	21,280,000	
SDU963	24/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV040	24/07/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDV468	24/07/2023	Active	71,642,911	mxn	71,642,911	71,642,911	
SHA212	24/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHA215	24/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHU533	24/07/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SHU536	24/07/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SIH921	24/07/2023	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	
SIH928	24/07/2023	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	
SDU235	25/07/2023	Active	1,870,439,257	mxn	1,870,439,257	1,870,439,257	
SDV516	25/07/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHO569	25/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHX001	25/07/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SHX034	25/07/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
P17082	26/07/2023	Active		mxn			250,798,009
P17083	26/07/2023	Active		mxn			250,798,009
SDS552	26/07/2023	Active	37,000,000	mxn	37,000,000	37,000,000	
SDS569	26/07/2023	Active	37,000,000	mxn	37,000,000	37,000,000	
SDT164	26/07/2023	Active	11,407,993	mxn	11,407,993	11,407,993	
SDT166	26/07/2023	Active	11,407,993	mxn	11,407,993	11,407,993	
SDT173	26/07/2023	Active	15,782,800	mxn	15,782,800	15,782,800	
SDT178	26/07/2023	Active	15,782,800	mxn	15,782,800	15,782,800	
SDX025	26/07/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHA432	26/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHA433	26/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHA434	26/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SHA435	26/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHY656	26/07/2023	Active	720,000,000	mxn	720,000,000	720,000,000	
SHZ178	26/07/2023	Active	1,680,000,000	mxn	1,680,000,000	1,680,000,000	
MK7277	27/07/2023	Active		mxn		500,000,000	
MUG992	27/07/2023	Active		mxn		196,500,000	
SDT450	27/07/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDV222	27/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SGS044	27/07/2023	Active	196,500,000	mxn	196,500,000	196,500,000	
SGS045	27/07/2023	Active	196,500,000	mxn	196,500,000	196,500,000	
SGS058	27/07/2023	Active	196,500,000	mxn	196,500,000	196,500,000	
SHP118	27/07/2023	Active	865,000,000	mxn	865,000,000	865,000,000	
SHX407	27/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SHX411	27/07/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
C88292	28/07/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,213,750,000	
C88293	28/07/2023	Active		mxn/usd	4,213,750,000	250,000,000	
SHA885	28/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHA886	28/07/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIH856	28/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
SIH874	28/07/2023	Active	1,900,000	mxn	1,900,000	1,900,000	
C83154	31/07/2023	Active		mxn/usd	834,594,550	42,087,471	
C83156	31/07/2023	Active		usd/mxn	42,087,471	834,594,550	
C83735	31/07/2023	Active		mxn/usd	374,800,480	19,419,714	
C83737	31/07/2023	Active		usd/mxn	19,419,714	374,800,480	
C88482	31/07/2023	Active		usd/mxn	200,000,000	3,368,000,000	
C88484	31/07/2023	Active		mxn/usd	3,368,000,000	200,000,000	
P17887	31/07/2023	Active		mxn			20,517,248
P17888	31/07/2023	Active		mxn			20,517,248
P17889	31/07/2023	Active		mxn			53,520,000
P17890	31/07/2023	Active		mxn			53,520,000
SDV560	31/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV588	31/07/2023	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDW714	31/07/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDW743	31/07/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW833	31/07/2023	Active	2,968,300	mxn	2,968,300	2,968,300	
SDW835	31/07/2023	Active	2,968,300	mxn	2,968,300	2,968,300	
SDW844	31/07/2023	Active	9,600,000	mxn	9,600,000	9,600,000	
SDW855	31/07/2023	Active	9,600,000	mxn	9,600,000	9,600,000	
SEJ462	31/07/2023	Active	467,448	mxn	467,448	467,448	
SEJ486	31/07/2023	Active	467,448	mxn	467,448	467,448	
SHX823	31/07/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SHX840	31/07/2023	Active	4,500,000	mxn	4,500,000	4,500,000	
SDU871	01/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHB074	01/08/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SHB153	01/08/2023	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	
SDV655	02/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHB361	02/08/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHB363	02/08/2023	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SHY171	02/08/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SHY199	02/08/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SIO253	02/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIO305	02/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIO499	02/08/2023	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	
P18220	03/08/2023	Active		mxn			12,500,000
P18221	03/08/2023	Active		mxn			12,500,000
SEG488	03/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU930	04/08/2023	Active	219,850	usd	219,850	219,850	
SDU942	04/08/2023	Active	8,328,296	mxn	8,328,296	8,328,296	
SDU956	04/08/2023	Active	520,760	mxn	520,760	520,760	
SDU962	04/08/2023	Active	8,328,296	mxn	8,328,296	8,328,296	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SDU972	04/08/2023	Active	219,850	usd	219,850	219,850	
SDU987	04/08/2023	Active	520,760	mxn	520,760	520,760	
SDU993	04/08/2023	Active	47,640	usd	47,640	47,640	
SDU995	04/08/2023	Active	47,640	usd	47,640	47,640	
SDV724	04/08/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SEG673	04/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHB805	04/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDV777	07/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHC077	07/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHC172	07/08/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHZ242	07/08/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SHZ246	07/08/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
E81347	08/08/2023	Active	80,930,000	mxn			80,930,000
E85335	08/08/2023	Active	80,290,000	mxn			80,290,000
E85336	08/08/2023	Active	80,290,000	mxn			80,290,000
E85337	08/08/2023	Active	80,290,000	mxn			80,290,000
SDT400	09/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SIA957	09/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIA986	09/08/2023	Active	610,000,000	mxn	610,000,000	610,000,000	
P17435	10/08/2023	Active		mxn			500,000,000
P17436	10/08/2023	Active		mxn			500,000,000
SDS221	10/08/2023	Active	7,103,988	mxn	7,103,988	7,103,988	
SDS223	10/08/2023	Active	761,764	usd	761,764	761,764	
SDS242	10/08/2023	Active	7,103,988	mxn	7,103,988	7,103,988	
SDS247	10/08/2023	Active	761,764	usd	761,764	761,764	
SDU249	10/08/2023	Active	2,242,200	mxn	2,242,200	2,242,200	
SDU261	10/08/2023	Active	2,242,200	mxn	2,242,200	2,242,200	
SDX306	10/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SEW264	10/08/2023	Active	5,936,640	mxn	5,936,640	5,936,640	
SEW282	10/08/2023	Active	5,936,640	mxn	5,936,640	5,936,640	
SHQ594	10/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIH399	10/08/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SIH413	10/08/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SIP673	10/08/2023	Active	4,225,000,000	mxn	4,225,000,000	4,225,000,000	
MJ7847	11/08/2023	Active		mxn		450,000,000	
SIK011	11/08/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000	
SIK039	11/08/2023	Active	2,700,000	mxn	2,700,000	2,700,000	
MNF309	14/08/2023	Active		usd		17,190,476	
SDT069	14/08/2023	Active	17,190,476	usd	17,190,476	17,190,476	
SDT121	14/08/2023	Active	17,190,476	usd	17,190,476	17,190,476	
SDT126	14/08/2023	Active	17,190,476	usd	17,190,476	17,190,476	
SDT419	14/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU271	14/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU585	14/08/2023	Active	68,421,458	mxn	68,421,458	68,421,458	
SDV997	14/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW022	14/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW066	14/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW091	14/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SIB660	14/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SDW117	15/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW162	15/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHD072	15/08/2023	Active	415,000,000	mxn	415,000,000	415,000,000	
C88571	16/08/2023	Active		mxn/usd	4,167,500,000	250,000,000	
C88573	16/08/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,167,500,000	
C88577	16/08/2023	Active		usd/mxn	200,000,000	3,340,000,000	
C88578	16/08/2023	Active		mxn/usd	3,340,000,000	200,000,000	
SDW196	16/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW265	16/08/2023	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SEJ982	16/08/2023	Active	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SEJ983	16/08/2023	Active	520,000,000	mxn	520,000,000	520,000,000	
SHO821	16/08/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SHO822	16/08/2023	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	
SDT457	17/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW294	17/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW339	17/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW443	18/08/2023	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	
SDW471	18/08/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SEK268	18/08/2023	Active	4,186,428	mxn	4,186,428	4,186,428	
SEK299	18/08/2023	Active	4,186,428	mxn	4,186,428	4,186,428	
SHD626	18/08/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
P18200	20/08/2023	Active		mxn			2,068,262,831
P18201	20/08/2023	Active		mxn			2,068,262,831
SDW491	21/08/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SEK352	21/08/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SIC874	21/08/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIC892	21/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIC895	21/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
P16981	22/08/2023	Active		mxn			18,200,000
P16983	22/08/2023	Active		mxn			18,200,000
P18113	22/08/2023	Active		mxn			18,200,000
P18123	22/08/2023	Active		mxn			18,200,000
SHD933	22/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHD934	22/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJB418	22/08/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJB431	22/08/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SDS003	23/08/2023	Active	32,000	usd	32,000	32,000	
SDS006	23/08/2023	Active	32,000	usd	32,000	32,000	
SDT039	23/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SEP043	23/08/2023	Active	9,342,857	mxn	9,342,857	9,342,857	
SEP547	23/08/2023	Active	9,342,857	mxn	9,342,857	9,342,857	
SIB482	23/08/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SIB510	23/08/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SID307	23/08/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJL951	23/08/2023	Active	6,950,000	mxn	6,950,000	6,950,000	
SJL959	23/08/2023	Active	6,950,000	mxn	6,950,000	6,950,000	
SHE406	24/08/2023	Active	415,000,000	mxn	415,000,000	415,000,000	
SDW908	25/08/2023	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDW913	25/08/2023	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	
SDX013	25/08/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHE538	25/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHE540	25/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHE560	25/08/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SIM736	25/08/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SIM824	25/08/2023	Active	2,100,000	mxn	2,100,000	2,100,000	
SDW926	28/08/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDW927	28/08/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SHE674	28/08/2023	Active	1,150,000,000	mxn	1,150,000,000	1,150,000,000	
SHE741	28/08/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHS560	28/08/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SEP776	29/08/2023	Active	55,000,000	mxn	55,000,000	55,000,000	
SIE262	29/08/2023	Active	1,660,000,000	mxn	1,660,000,000	1,660,000,000	
SIE266	29/08/2023	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	
SIE267	29/08/2023	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	
MNF411	30/08/2023	Active		mxn		76,984,060	
MOY227	30/08/2023	Active		mxn		450,000,000	
SDS039	30/08/2023	Active	69,950	usd	69,950	69,950	
SDS063	30/08/2023	Active	76,984,060	mxn	76,984,060	76,984,060	
SDS084	30/08/2023	Active	69,950	usd	69,950	69,950	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SDS736	30/08/2023	Active	76,984,060	mxn	76,984,060	76,984,060	
SDS755	30/08/2023	Active	76,984,060	mxn	76,984,060	76,984,060	
SEP054	30/08/2023	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SEP058	30/08/2023	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SEP115	30/08/2023	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SHF018	30/08/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
C88308	31/08/2023	Active		mxn/usd	1,349,280,000	80,000,000	
C88309	31/08/2023	Active		usd/mxn	80,000,000	1,349,280,000	
C88867	31/08/2023	Active		mxn/usd	4,262,500,000	250,000,000	
C88869	31/08/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,262,500,000	
SDU753	31/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW943	31/08/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000	
SDW945	31/08/2023	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000	
SEQ035	31/08/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SES728	31/08/2023	Active	5,250,536	mxn	5,250,536	5,250,536	
SES731	31/08/2023	Active	5,250,536	mxn	5,250,536	5,250,536	
SIE908	31/08/2023	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SIE909	31/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIE977	31/08/2023	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SIF012	31/08/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIF022	31/08/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIF043	31/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIF044	31/08/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SIF045	31/08/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIF050	31/08/2023	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
E81353	01/09/2023	Active	36,975,000	mxn			36,975,000
E81407	01/09/2023	Active	36,975,000	mxn			36,975,000
SDU713	01/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW601	01/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW636	01/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SHT068	01/09/2023	Active	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	
SHT140	01/09/2023	Active	1,030,000,000	mxn	1,030,000,000	1,030,000,000	
SIC939	01/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIC963	01/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SII566	01/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SII573	01/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SHF724	04/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHF751	04/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHF755	04/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SID383	04/09/2023	Active	5,900,000	mxn	5,900,000	5,900,000	
SID400	04/09/2023	Active	5,900,000	mxn	5,900,000	5,900,000	
SDV174	05/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW673	05/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SIF549	05/09/2023	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SDS658	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SDS662	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SDS674	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SDS679	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SDS684	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SDS690	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SID367	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SID381	06/09/2023	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	
SID829	06/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SID864	06/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIG139	06/09/2023	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SEQ673	07/09/2023	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SIJ138	07/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIJ141	07/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJE401	07/09/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SJH879	07/09/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
SJI066	07/09/2023	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	
P18333	08/09/2023	Active		mxn			220,000,000
P18334	08/09/2023	Active		mxn			220,000,000
P18335	08/09/2023	Active		mxn			220,000,000
P18336	08/09/2023	Active		mxn			220,000,000
SEQ794	08/09/2023	Active	52,000,000	mxn	52,000,000	52,000,000	
SEQ796	08/09/2023	Active	52,000,000	mxn	52,000,000	52,000,000	
SIE592	08/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIE624	08/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SDS031	11/09/2023	Active	1,343,234	mxn	1,343,234	1,343,234	
SDS033	11/09/2023	Active	1,343,234	mxn	1,343,234	1,343,234	
SDS106	11/09/2023	Active	932,666	usd	932,666	932,666	
SDS119	11/09/2023	Active	932,666	usd	932,666	932,666	
SDS128	11/09/2023	Active	6,295,338	mxn	6,295,338	6,295,338	
SDS148	11/09/2023	Active	6,295,338	mxn	6,295,338	6,295,338	
SDV320	11/09/2023	Active	569,104	usd	569,104	569,104	
SDV341	11/09/2023	Active	57,690,613	mxn	57,690,613	57,690,613	
SDV345	11/09/2023	Active	569,104	usd	569,104	569,104	
SDV350	11/09/2023	Active	57,690,613	mxn	57,690,613	57,690,613	
SDW700	11/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW734	11/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW956	11/09/2023	Active	640,000	mxn	640,000	640,000	
SDW958	11/09/2023	Active	960,000	mxn	960,000	960,000	
SDW965	11/09/2023	Active	960,000	mxn	960,000	960,000	
SDW967	11/09/2023	Active	640,000	mxn	640,000	640,000	
SDX031	11/09/2023	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SFC307	11/09/2023	Active	977,976	usd	977,976	977,976	
SFC438	11/09/2023	Active	977,976	usd	977,976	977,976	
SIK013	11/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIK062	11/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
C83305	12/09/2023	Active		usd/mxn	100,000,000	1,948,800,000	
C83308	12/09/2023	Active		mxn/usd	1,948,800,000	100,000,000	
C89201	12/09/2023	Active		mxn/usd	4,225,000,000	250,000,000	
C89203	12/09/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,225,000,000	
SDW764	12/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW791	12/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW817	12/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SIF301	12/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIF441	12/09/2023	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SIH163	12/09/2023	Active	2,030,000,000	mxn	2,030,000,000	2,030,000,000	
SDW887	13/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW915	13/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW959	13/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHG812	13/09/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHG815	13/09/2023	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHT798	13/09/2023	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SDW978	14/09/2023	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
P18228	15/09/2023	Active		usd			10,408,104
P18230	15/09/2023	Active		usd			10,408,104
P18330	15/09/2023	Active		usd			18,576,795
P18331	15/09/2023	Active		usd			18,576,795
SDX054	15/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDX081	15/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDQ940	17/09/2023	Active	4,000,000	usd	4,000,000	4,000,000	
SDX112	18/09/2023	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SI1194	18/09/2023	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	
SI1752	18/09/2023	Active	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	
SI1754	18/09/2023	Active	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
C89373	19/09/2023	Active		mxn/usd	4,325,000,000	250,000,000	
C89377	19/09/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,325,000,000	
C89393	19/09/2023	Active		usd/mxn	450,000,000	7,803,000,000	
C89394	19/09/2023	Active		mxn/usd	7,803,000,000	450,000,000	
SDX106	19/09/2023	Active	3,537,993	mxn	3,537,993	3,537,993	
SDX107	19/09/2023	Active	3,537,993	mxn	3,537,993	3,537,993	
SHU526	19/09/2023	Active	1,235,000,000	mxn	1,235,000,000	1,235,000,000	
SDT564	20/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT643	20/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHU691	20/09/2023	Active	1,010,000,000	mxn	1,010,000,000	1,010,000,000	
SI1655	20/09/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SI1657	20/09/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
P17228	21/09/2023	Active		mxn			1,671,730,600
P17229	21/09/2023	Active		mxn			1,671,730,600
SDW996	21/09/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDW999	21/09/2023	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	
SDX128	21/09/2023	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SHH913	21/09/2023	Active	420,000,000	mxn	420,000,000	420,000,000	
P17037	22/09/2023	Active		mxn			36,766,133
P18090	22/09/2023	Active		mxn			36,766,133
SDQ891	22/09/2023	Active	32,900,000	usd	32,900,000	32,900,000	
SDS284	22/09/2023	Active	218,638	usd	218,638	218,638	
SDS610	22/09/2023	Active	236,712	usd	236,712	236,712	
SDS621	22/09/2023	Active	236,712	usd	236,712	236,712	
SDS791	22/09/2023	Active	66,716	usd	66,716	66,716	
SDS802	22/09/2023	Active	66,716	usd	66,716	66,716	
SDS976	22/09/2023	Active	171,885	usd	171,885	171,885	
SDS994	22/09/2023	Active	171,885	usd	171,885	171,885	
SDT027	22/09/2023	Active	211,207	usd	211,207	211,207	
SDT046	22/09/2023	Active	211,207	usd	211,207	211,207	
SDT611	22/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT652	22/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT697	22/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT777	22/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT897	22/09/2023	Active	43,203	usd	43,203	43,203	
SDT924	22/09/2023	Active	43,203	usd	43,203	43,203	
SDT987	22/09/2023	Active	205,565	usd	205,565	205,565	
SDU007	22/09/2023	Active	205,565	usd	205,565	205,565	
SDU659	22/09/2023	Active	172,537	usd	172,537	172,537	
SDU670	22/09/2023	Active	172,537	usd	172,537	172,537	
SDU893	22/09/2023	Active	212,800	usd	212,800	212,800	
SDU903	22/09/2023	Active	212,800	usd	212,800	212,800	
SHV074	22/09/2023	Active	8,000,000,000	mxn	8,000,000,000	8,000,000,000	
SHV104	22/09/2023	Active	3,500,000,000	mxn	3,500,000,000	3,500,000,000	
SHV122	22/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHV123	22/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHV130	22/09/2023	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SHV131	22/09/2023	Active	1,400,000,000	mxn	1,400,000,000	1,400,000,000	
SHV132	22/09/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJP408	22/09/2023	Active	218,638	usd	218,638	218,638	
P17088	25/09/2023	Active		mxn			61,445,344
P17089	25/09/2023	Active		mxn			61,445,344
SDS156	25/09/2023	Active	3,738,803	mxn	3,738,803	3,738,803	
SDS159	25/09/2023	Active	5,111,533	mxn	5,111,533	5,111,533	
SDS161	25/09/2023	Active	3,738,803	mxn	3,738,803	3,738,803	
SDS162	25/09/2023	Active	5,111,533	mxn	5,111,533	5,111,533	
SDS427	25/09/2023	Active	11,840,000	mxn	11,840,000	11,840,000	
SDS432	25/09/2023	Active	11,840,000	mxn	11,840,000	11,840,000	
SDS761	25/09/2023	Active	3,249,443	mxn	3,249,443	3,249,443	



Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option
SDS763	25/09/2023	Active	3,249,443	mxn	3,249,443	3,249,443	
SDS934	25/09/2023	Active	8,894,478	mxn	8,894,478	8,894,478	
SDS940	25/09/2023	Active	8,894,478	mxn	8,894,478	8,894,478	
SDT213	25/09/2023	Active	6,918,145	mxn	6,918,145	6,918,145	
SDT227	25/09/2023	Active	12,779,938	mxn	12,779,938	12,779,938	
SDT234	25/09/2023	Active	6,918,145	mxn	6,918,145	6,918,145	
SDT236	25/09/2023	Active	12,779,938	mxn	12,779,938	12,779,938	
SDT362	25/09/2023	Active	3,125,768	mxn	3,125,768	3,125,768	
SDT423	25/09/2023	Active	3,125,768	mxn	3,125,768	3,125,768	
SDT826	25/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT906	25/09/2023	Active	2,121,487	mxn	2,121,487	2,121,487	
SDT908	25/09/2023	Active	2,121,487	mxn	2,121,487	2,121,487	
SDV234	25/09/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDV236	25/09/2023	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	
SDX007	25/09/2023	Active	22,219,253	mxn	22,219,253	22,219,253	
SDX015	25/09/2023	Active	22,219,253	mxn	22,219,253	22,219,253	
SDX021	25/09/2023	Active	7,226,000	mxn	7,226,000	7,226,000	
SDX026	25/09/2023	Active	7,226,000	mxn	7,226,000	7,226,000	
SIN007	25/09/2023	Active	3,500,000	mxn	3,500,000	3,500,000	
SIN011	25/09/2023	Active	3,500,000	mxn	3,500,000	3,500,000	
SDS891	26/09/2023	Active	1,114,716	mxn	1,114,716	1,114,716	
SDS927	26/09/2023	Active	1,114,716	mxn	1,114,716	1,114,716	
SET129	26/09/2023	Active	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SET313	27/09/2023	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SI1168	27/09/2023	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
SI1191	27/09/2023	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	3,000,000	
SIJ384	27/09/2023	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SIJ436	27/09/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIJ491	27/09/2023	Active	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	
SIJ503	27/09/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SIJ504	27/09/2023	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
C89649	28/09/2023	Active		usd/mxn	250,000,000	4,270,000,000	
C89650	28/09/2023	Active		mxn/usd	4,270,000,000	250,000,000	
SDS395	28/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDS399	28/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDT913	28/09/2023	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDT949	28/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU019	28/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU071	28/09/2023	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU112	28/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU178	28/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHR705	28/09/2023	Active	2,000,000	usd	2,000,000	2,000,000	
SHR706	28/09/2023	Active	2,000,000	usd	2,000,000	2,000,000	
SHV977	28/09/2023	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SIB169	28/09/2023	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
SIB183	28/09/2023	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	
MNF462	29/09/2023	Active		mxn		100,151,463	
SDR902	29/09/2023	Active	1,031,700	mxn	1,031,700	1,031,700	
SDR903	29/09/2023	Active	1,031,700	mxn	1,031,700	1,031,700	
SDS158	29/09/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDS169	29/09/2023	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	
SDS720	29/09/2023	Active	100,151,463	mxn	100,151,463	100,151,463	
SDS742	29/09/2023	Active	8,076,019	mxn	8,076,019	8,076,019	
SDS750	29/09/2023	Active	8,076,019	mxn	8,076,019	8,076,019	
SDT347	29/09/2023	Active	100,151,463	mxn	100,151,463	100,151,463	
SDT414	29/09/2023	Active	100,151,463	mxn	100,151,463	100,151,463	
SDT979	29/09/2023	Active	2,905,058	mxn	2,905,058	2,905,058	
SDT988	29/09/2023	Active	2,905,058	mxn	2,905,058	2,905,058	
SDU225	29/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU268	29/09/2023	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU489	29/09/2023	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SET353	29/09/2023	Active	76,050,078	mxn	76,050,078	76,050,078	
SET366	29/09/2023	Active	76,050,078	mxn	76,050,078	76,050,078	

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072403060	BO	CADMXN	08/28/2023	1,000,000	12.90	(12,901,099)
2023072403061	SO	CADMXN	08/28/2023	(1,000,000)	12.90	12,896,580
2023063003410	BO	CHFMXN	07/03/2023	2,000,000	19.14	(38,271,248)
2023062903357	B	EURUSD	07/03/2023	1,000,000	1.09	(1,087,000)
2023062903307	S	EURUSD	07/03/2023	(1,000,000)	1.09	1,087,770
2023060603383	B	EURMXN	07/10/2023	30,000	18.76	(562,863)
2023070603066	B	EURUSD	07/10/2023	1,000,000	1.08	(1,083,900)
2023070603175	B	EURUSD	07/10/2023	2,000,000	1.09	(2,172,000)
2023070603269	B	EURUSD	07/10/2023	1,000,000	1.09	(1,087,300)
2023070603067	S	EURUSD	07/10/2023	(1,000,000)	1.08	1,083,890
2023070603118	S	EURUSD	07/10/2023	(1,000,000)	1.09	1,086,880
2023070603119	S	EURUSD	07/10/2023	(1,000,000)	1.09	1,086,760
2023070603253	S	EURUSD	07/10/2023	(1,000,000)	1.09	1,088,370
2023070703301	B	EURUSD	07/11/2023	1,000,000	1.10	(1,096,860)
2023070703170	S	EURUSD	07/11/2023	(1,000,000)	1.09	1,094,850
2023071003229	BO	EURUSD	07/11/2023	2,000,000	1.10	(2,196,900)
2023062703381	BO	EURMXN	07/13/2023	107,383	18.83	(2,021,616)
2023071303013	BO	EURUSD	07/13/2023	2,000,000	1.12	(2,238,412)
2022070603182	BO	EURUSD	07/20/2023	174,000	1.05	(182,092)
2023070503164	BO	EURMXN	07/21/2023	700,000	18.55	(12,983,082)
2023072403059	BO	EURMXN	07/25/2023	1,000,000	18.70	(18,698,642)
2023072403083	B	EURUSD	07/26/2023	1,000,000	1.11	(1,107,510)
2023072403101	B	EURUSD	07/26/2023	1,000,000	1.11	(1,107,260)
2023072403323	S	EURUSD	07/26/2023	(2,000,000)	1.11	2,216,800
2023072403371	S	EURMXN	07/26/2023	(2,030)	18.63	37,823
2023072703216	S	EURMXN	07/31/2023	(1,288,183)	18.41	23,718,798
2023073103069	B	EURUSD	08/02/2023	1,000,000	1.10	(1,103,270)
2023073103158	B	EURUSD	08/02/2023	1,000,000	1.10	(1,101,520)
2023073103239	B	EURUSD	08/02/2023	1,000,000	1.10	(1,101,790)
2023073103263	B	EURUSD	08/02/2023	1,000,000	1.10	(1,101,340)
2023073103128	S	EURUSD	08/02/2023	(1,000,000)	1.10	1,103,000
2023073103181	S	EURUSD	08/02/2023	(1,000,000)	1.10	1,102,500
2023073103482	S	EURUSD	08/02/2023	(1,000,000)	1.10	1,100,410
2023073103495	S	EURUSD	08/02/2023	(1,000,000)	1.10	1,100,410
2023080203041	BO	EURUSD	08/02/2023	300	1.09	(328)
2023080203044	BO	EURUSD	08/02/2023	3,000,000	1.09	(3,280,746)
2023080103035	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,097,320)
2023080103113	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,096,500)
2023080103145	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,097,150)
2023080103163	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,096,680)
2023080103274	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,097,090)
2023080103396	B	EURUSD	08/03/2023	1,000,000	1.10	(1,096,500)
2023080103105	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,000
2023080103118	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,500
2023080103132	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,920
2023080103226	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,000
2023080103248	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,640
2023080103449	S	EURUSD	08/03/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,000
2023080203280	B	EURUSD	08/04/2023	1,000,000	1.10	(1,095,180)
2023080203177	S	EURUSD	08/04/2023	(1,000,000)	1.09	1,093,860
2023080303088	B	EURUSD	08/07/2023	1,000,000	1.09	(1,093,140)
2023080303055	S	EURUSD	08/07/2023	(1,000,000)	1.09	1,094,120
2023080803052	S	EURUSD	08/10/2023	(1,000,000)	1.09	1,093,830
2023080903130	B	EURUSD	08/11/2023	1,000,000	1.10	(1,097,950)
2023080903331	B	EURUSD	08/11/2023	1,000,000	1.10	(1,097,790)
2023080903225	S	EURUSD	08/11/2023	(1,000,000)	1.10	1,098,000
2023080903412	S	EURUSD	08/11/2023	(1,000,000)	1.10	1,097,720
2022070603183	BO	EURUSD	08/16/2023	192,000	1.05	(201,252)
2023081503161	B	EURUSD	08/17/2023	1,000,000	1.09	(1,092,570)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023081503276	S	EURUSD	08/17/2023	(1,000,000)	1.09	1,091,500
2023081603248	B	EURUSD	08/18/2023	1,000,000	1.09	(1,089,890)
2023081603249	B	EURUSD	08/18/2023	1,000,000	1.09	(1,089,870)
2023081603255	S	EURUSD	08/18/2023	(1,000,000)	1.09	1,089,300
2023081603277	S	EURUSD	08/18/2023	(1,000,000)	1.09	1,089,070
2023081703122	B	EURUSD	08/21/2023	1,000,000	1.09	(1,088,650)
2023081703177	B	EURUSD	08/21/2023	1,000,000	1.09	(1,087,410)
2023081703293	B	EURUSD	08/21/2023	1,000,000	1.09	(1,087,950)
2023081703131	S	EURUSD	08/21/2023	(1,000,000)	1.09	1,088,790
2023081703256	S	EURUSD	08/21/2023	(1,000,000)	1.09	1,088,000
2023081703318	S	EURUSD	08/21/2023	(1,000,000)	1.09	1,087,520
2023082403295	B	EURUSD	08/28/2023	1,000,000	1.08	(1,082,390)
2023082403342	S	EURUSD	08/28/2023	(1,000,000)	1.08	1,082,450
2023082503120	B	EURUSD	08/29/2023	1,000,000	1.08	(1,076,730)
2023082503189	S	EURUSD	08/29/2023	(1,000,000)	1.08	1,078,250
2023083103114	B	EURUSD	09/05/2023	1,000,000	1.08	(1,084,570)
2023083103122	S	EURUSD	09/05/2023	(1,000,000)	1.09	1,085,500
2023090103407	B	EURUSD	09/05/2023	1,000,000	1.08	(1,078,390)
2023090103470	S	EURUSD	09/05/2023	(1,000,000)	1.08	1,077,790
2023051503448	B	EURMXN	09/06/2023	25,000,000	19.62	(490,557,868)
2023090503471	S	EURMXN	09/06/2023	(25,000,000)	18.65	466,177,448
2023090503310	B	EURUSD	09/07/2023	140,000	1.07	(150,235)
2023090703118	B	EURUSD	09/11/2023	1,000,000	1.07	(1,069,780)
2023090703271	B	EURUSD	09/11/2023	1,000,000	1.07	(1,070,390)
2023090703372	B	EURUSD	09/11/2023	1,000,000	1.07	(1,070,550)
2023090703398	B	EURUSD	09/11/2023	1,000,000	1.07	(1,070,300)
2023090703168	S	EURUSD	09/11/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,380
2023090703199	S	EURUSD	09/11/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,800
2023090703283	S	EURUSD	09/11/2023	(1,000,000)	1.07	1,070,860
2023090703430	S	EURUSD	09/11/2023	(1,000,000)	1.07	1,069,800
2023091103161	B	EURUSD	09/13/2023	1,000,000	1.07	(1,074,630)
2023091103250	B	EURUSD	09/13/2023	1,000,000	1.07	(1,074,250)
2023091103482	B	EURUSD	09/13/2023	1,000,000	1.07	(1,074,730)
2023091103226	S	EURUSD	09/13/2023	(1,000,000)	1.07	1,074,500
2023091103302	S	EURUSD	09/13/2023	(1,000,000)	1.08	1,075,640
2023091103553	S	EURUSD	09/13/2023	(1,000,000)	1.07	1,074,630
2023091303195	B	EURUSD	09/15/2023	1,000,000	1.07	(1,073,450)
2023091303175	S	EURUSD	09/15/2023	(1,000,000)	1.07	1,074,360
2023091503116	B	EURUSD	09/19/2023	1,000,000	1.07	(1,066,450)
2023091503133	S	EURUSD	09/19/2023	(1,000,000)	1.07	1,067,110
2023091803073	B	EURUSD	09/20/2023	1,000,000	1.07	(1,068,160)
2023091803131	B	EURUSD	09/20/2023	1,000,000	1.07	(1,068,670)
2023091803058	S	EURUSD	09/20/2023	(1,000,000)	1.07	1,067,620
2023091803175	S	EURUSD	09/20/2023	(1,000,000)	1.07	1,069,590
2022070603184	BO	EURUSD	09/22/2023	50,000	1.05	(52,524)
2023092603609	BO	EURMXN	09/27/2023	10,000,000	18.51	(185,119,240)
2023092603727	BO	EURMXN	09/27/2023	3,000,000	18.55	(55,654,869)
2023092603333	B	EURUSD	09/28/2023	1,000,000	1.06	(1,057,220)
2023092603419	S	EURUSD	09/28/2023	(1,000,000)	1.06	1,057,460
2023070503107	BO	GBPUSD	07/05/2023	1,200,000	21.61	(25,927,514)
2022092903030	BO	GBPUSD	09/29/2023	500,000	1.09	(545,137)
2022100303025	SO	GBPUSD	09/29/2023	(500,000)	1.12	559,362
2023022003430	BO	USDUSD	07/03/2023	20,000	18.87	(377,353)
2023022803033	BO	USDUSD	07/03/2023	20,000	18.75	(375,036)
2023030903538	BO	USDUSD	07/03/2023	50,000	18.46	(922,845)
2023041703378	BO	USDUSD	07/03/2023	40,000	18.26	(730,383)
2023050303264	BO	USDUSD	07/03/2023	100,000	18.14	(1,814,083)
2023060103247	B	USDUSD	07/03/2023	570,000	17.66	(10,065,333)
2023060203161	BO	USDUSD	07/03/2023	570,000	17.58	(10,019,669)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060503397	BO	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.56	(10,008,179)
2023060703224	B	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.42	(9,927,918)
2023060703426	B	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.44	(9,939,717)
2023060803429	BO	USDMXN	07/03/2023	453,000	17.46	(7,911,162)
2023060803430	BO	USDMXN	07/03/2023	117,000	17.48	(2,044,612)
2023060903188	BO	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.37	(9,901,596)
2023061203406	BO	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.35	(9,889,093)
2023061203451	BO	USDMXN	07/03/2023	136,000	17.35	(2,359,580)
2023061203398	SO	USDMXN	07/03/2023	(136,000)	17.35	2,359,390
2023061203541	SO	USDMXN	07/03/2023	(136,000)	17.34	2,357,606
2023061303204	B	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.26	(9,838,761)
2023061303471	B	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.27	(9,844,537)
2023061303450	SO	USDMXN	07/03/2023	(144,000)	17.27	2,487,432
2023061403301	BO	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.18	(9,793,113)
2023061403502	SO	USDMXN	07/03/2023	(60,000)	17.17	1,030,357
2023061503358	BO	USDMXN	07/03/2023	570,000	17.19	(9,799,922)
2023061503671	SO	USDMXN	07/03/2023	(100,000)	17.16	1,716,241
2023061903447	BO	USDMXN	07/03/2023	100,000	17.14	(1,713,793)
2023062103333	BO	USDMXN	07/03/2023	86,000	17.16	(1,476,000)
2023062903043	B	USDMXN	07/03/2023	1,000,000	17.12	(17,122,000)
2023062903046	B	USDMXN	07/03/2023	50,000,000	17.14	(857,235,000)
2023062903051	B	USDMXN	07/03/2023	58,306,658	17.15	(1,000,000,000)
2023062903206	B	USDMXN	07/03/2023	50,000,000	17.13	(856,490,000)
2023062903261	B	USDMXN	07/03/2023	1,000,000	17.10	(17,100,000)
2023062903358	B	USDMXN	07/03/2023	1,000,000	17.12	(17,120,000)
2023062903213	S	USDMXN	07/03/2023	(425,000)	17.12	7,274,683
2023062903377	S	USDMXN	07/03/2023	(600,000)	17.13	10,275,180
2023062903379	S	USDMXN	07/03/2023	(600,000)	17.13	10,275,060
2023062903381	S	USDMXN	07/03/2023	(600,000)	17.13	10,275,060
2023062903387	S	USDMXN	07/03/2023	(167,775)	17.12	2,872,482
2023062903424	S	USDMXN	07/03/2023	(100,000,000)	17.11	1,711,020,000
2023062903426	S	USDMXN	07/03/2023	(100,000,000)	17.11	1,711,020,000
2023062903509	S	USDMXN	07/03/2023	(1,000,000)	17.10	17,104,080
2023062903529	S	USDMXN	07/03/2023	(1,000,000)	17.10	17,104,600
2023063003357	B	USDMXN	07/03/2023	100,000,000	17.13	(1,713,000,000)
2023063003359	B	USDMXN	07/03/2023	100,000,000	17.13	(1,713,000,000)
2023063003112	S	USDMXN	07/03/2023	(50,000,000)	17.11	855,250,000
2023063003353	S	USDMXN	07/03/2023	(100,000,000)	17.14	1,714,200,000
2022082303305	S	USDMXN	07/05/2023	(286,749)	21.26	6,096,941
2022082303310	S	USDMXN	07/05/2023	(286,749)	21.26	6,096,941
2022083003222	SO	USDMXN	07/05/2023	(285,000)	21.34	6,080,849
2022090603283	SO	USDMXN	07/05/2023	(286,000)	21.30	6,091,111
2022090603325	SO	USDMXN	07/05/2023	(1,193)	21.31	25,420
2022091303256	SO	USDMXN	07/05/2023	(288,000)	21.12	6,082,507
2022091303523	SO	USDMXN	07/05/2023	(839)	21.11	17,721
2023032803594	BO	USDMXN	07/05/2023	13,600	18.58	(252,678)
2023040503415	BO	USDMXN	07/05/2023	150,000	18.42	(2,762,699)
2023041003213	B	USDMXN	07/05/2023	153,846	18.47	(2,842,259)
2023041303596	BO	USDMXN	07/05/2023	100,000	18.30	(1,830,343)
2023050203375	B	USDMXN	07/05/2023	81,818	18.25	(1,492,824)
2023050503417	BO	USDMXN	07/05/2023	95,238	17.97	(1,711,500)
2023050503730	B	USDMXN	07/05/2023	61,500	17.99	(1,106,403)
2023051103561	BO	USDMXN	07/05/2023	117,180	17.78	(2,083,304)
2023051203495	BO	USDMXN	07/05/2023	57,600	17.77	(1,023,532)
2023053003030	B	USDMXN	07/05/2023	45,600	17.71	(807,785)
2023053103375	BO	USDMXN	07/05/2023	21,600	17.85	(385,605)
2023053103571	BO	USDMXN	07/05/2023	183,850	17.81	(3,273,817)
2023060203322	BO	USDMXN	07/05/2023	121,600	17.62	(2,142,729)
2023060203648	BO	USDMXN	07/05/2023	61,200	17.66	(1,080,807)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060503421	BO	USDMXN	07/05/2023	49,344	17.58	(867,568)
2023060503422	BO	USDMXN	07/05/2023	256	17.57	(4,497)
2023060703576	BO	USDMXN	07/05/2023	159,200	17.46	(2,779,599)
2023061403671	BO	USDMXN	07/05/2023	260,000	17.19	(4,470,489)
2023061503638	BO	USDMXN	07/05/2023	130,000	17.16	(2,230,891)
2023061603198	BO	USDMXN	07/05/2023	15,000	17.14	(257,122)
2023061603600	SO	USDMXN	07/05/2023	(279,000)	17.23	4,805,831
2023062103475	BO	USDMXN	07/05/2023	33,476	17.16	(574,329)
2023062203433	BO	USDMXN	07/05/2023	70,000	17.21	(1,205,038)
2023062303329	B	USDMXN	07/05/2023	38,444	17.20	(661,357)
2023062303730	BO	USDMXN	07/05/2023	151,792	17.20	(2,610,915)
2023062703686	BO	USDMXN	07/05/2023	148,800	17.10	(2,545,141)
2023063003017	B	USDMXN	07/05/2023	2,000,000	17.06	(34,120,000)
2023063003113	B	USDMXN	07/05/2023	50,000,000	17.11	(855,592,500)
2023063003133	B	USDMXN	07/05/2023	1,000,000	17.14	(17,143,630)
2023063003285	B	USDMXN	07/05/2023	20,000,000	17.15	(342,940,000)
2023063003354	B	USDMXN	07/05/2023	100,000,000	17.15	(1,714,900,000)
2023063003442	B	USDMXN	07/05/2023	500,000	17.13	(8,567,150)
2023063003128	S	USDMXN	07/05/2023	(1,000,000)	17.14	17,143,950
2023063003358	S	USDMXN	07/05/2023	(100,000,000)	17.14	1,713,720,000
2023063003360	S	USDMXN	07/05/2023	(100,000,000)	17.14	1,713,720,000
2023063003457	S	USDMXN	07/05/2023	(250,000)	17.14	4,283,975
2023063003712	S	USDMXN	07/05/2023	(250,000)	17.14	4,285,133
2023070303067	B	USDMXN	07/05/2023	100,000,000	17.06	(1,706,000,000)
2023070303069	B	USDMXN	07/05/2023	100,000,000	17.05	(1,705,000,000)
2023070303140	B	USDMXN	07/05/2023	100,000,000	17.06	(1,706,000,000)
2023070303407	B	USDMXN	07/05/2023	200,000	17.06	(3,411,850)
2023070303065	S	USDMXN	07/05/2023	(190,000,000)	17.05	3,239,500,000
2022110803504	BO	USDMXN	07/06/2023	2,200,000	20.42	(44,933,889)
2022111503361	B	USDMXN	07/06/2023	3,300,000	20.21	(66,696,795)
2022112903090	B	USDMXN	07/06/2023	1,750,000	19.92	(34,857,601)
2022120103203	B	USDMXN	07/06/2023	1,718,521	19.90	(34,197,562)
2023011203107	B	USDMXN	07/06/2023	2,787,232	19.52	(54,394,313)
2023020203321	BO	USDMXN	07/06/2023	100,000	19.12	(1,911,753)
2023032703600	BO	USDMXN	07/06/2023	30,071	18.72	(562,907)
2023032903538	BO	USDMXN	07/06/2023	25,000	18.44	(461,094)
2023041203241	BO	USDMXN	07/06/2023	60,000	18.38	(1,102,841)
2023041703377	BO	USDMXN	07/06/2023	60,000	18.27	(1,096,236)
2023042003413	B	USDMXN	07/06/2023	60,000	18.29	(1,097,441)
2023042403657	BO	USDMXN	07/06/2023	60,000	18.24	(1,094,261)
2023042803412	BO	USDMXN	07/06/2023	10,000	18.25	(182,547)
2023051503817	BO	USDMXN	07/06/2023	30,071	17.63	(530,260)
2023051903262	BO	USDMXN	07/06/2023	3,298	17.88	(58,963)
2023052403303	BO	USDMXN	07/06/2023	67,846	17.99	(1,220,337)
2023052503565	BO	USDMXN	07/06/2023	5,952	17.99	(107,069)
2023060603683	B	USDMXN	07/06/2023	500,000	17.48	(8,742,491)
2023060603718	B	USDMXN	07/06/2023	500,000	17.48	(8,742,491)
2023060803452	BO	USDMXN	07/06/2023	50,000	17.49	(874,443)
2023061203229	BO	USDMXN	07/06/2023	796,565	17.39	(13,852,978)
2023061603601	SO	USDMXN	07/06/2023	(135,000)	17.23	2,325,888
2023062203434	BO	USDMXN	07/06/2023	19,350	17.22	(333,172)
2023062203620	BO	USDMXN	07/06/2023	5,952	17.22	(102,512)
2023062703331	BO	USDMXN	07/06/2023	116,000	17.14	(1,988,117)
2023062703355	BO	USDMXN	07/06/2023	11,441	17.13	(195,941)
2023070303066	B	USDMXN	07/06/2023	190,000,000	17.05	(3,240,111,800)
2023070303337	B	USDMXN	07/06/2023	200,000,000	17.07	(3,414,000,000)
2023070303068	S	USDMXN	07/06/2023	(100,000,000)	17.06	1,706,330,000
2023070303070	S	USDMXN	07/06/2023	(100,000,000)	17.05	1,705,330,000
2023070303141	S	USDMXN	07/06/2023	(100,000,000)	17.06	1,706,330,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023070303330	S	USDMXN	07/06/2023	(200,000,000)	17.05	3,410,000,000
2023070303473	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303475	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,824
2023070303477	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303480	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303482	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303484	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303486	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,824
2023070303488	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,843
2023070303490	S	USDMXN	07/06/2023	(192,800)	17.06	3,289,824
2023070403307	S	USDMXN	07/06/2023	(628,500)	17.05	10,713,725
2023070503159	B	USDMXN	07/06/2023	100,000,000	17.00	(1,700,000,000)
2023070503161	B	USDMXN	07/06/2023	100,000,000	17.00	(1,700,000,000)
2023070503042	S	USDMXN	07/06/2023	(80,000,000)	16.99	1,359,440,000
2023070503044	S	USDMXN	07/06/2023	(120,000,000)	16.99	2,039,160,000
2022040803476	BO	USDMXN	07/07/2023	500	21.79	(10,896)
2022040803241	SO	USDMXN	07/07/2023	(159,000)	21.82	3,468,682
2022040803471	SO	USDMXN	07/07/2023	(250)	21.76	5,439
2022070503475	S	USDMXN	07/07/2023	(10,000,000)	22.07	220,740,000
2022072903145	B	USDMXN	07/07/2023	10,000,000	21.64	(216,387,940)
2022111803401	BO	USDMXN	07/07/2023	300,000	20.31	(6,094,031)
2022122803072	BO	USDMXN	07/07/2023	1,590,000	20.09	(31,948,415)
2023011803546	BO	USDMXN	07/07/2023	25,000	19.44	(485,922)
2023030203458	BO	USDMXN	07/07/2023	50,000	18.55	(927,367)
2023030303603	B	USDMXN	07/07/2023	250,000	18.39	(4,597,678)
2023032803103	B	USDMXN	07/07/2023	333,333	18.62	(6,206,637)
2023042803413	BO	USDMXN	07/07/2023	60,000	18.26	(1,095,497)
2023050303255	BO	USDMXN	07/07/2023	60,000	18.15	(1,088,819)
2023050503494	BO	USDMXN	07/07/2023	100,000	18.01	(1,800,835)
2023051003555	BO	USDMXN	07/07/2023	44,768	17.77	(795,604)
2023051003567	BO	USDMXN	07/07/2023	10,432	17.76	(185,258)
2023053003724	BO	USDMXN	07/07/2023	250,000	17.79	(4,447,428)
2023060803412	BO	USDMXN	07/07/2023	50,000	17.49	(874,380)
2023061603201	BO	USDMXN	07/07/2023	68,008	17.15	(1,166,247)
2023061603715	SO	USDMXN	07/07/2023	(281,000)	17.14	4,817,222
2023070503043	B	USDMXN	07/07/2023	80,000,000	17.00	(1,359,684,000)
2023070503045	B	USDMXN	07/07/2023	120,000,000	17.00	(2,039,526,000)
2023070503414	B	USDMXN	07/07/2023	5,000,000	17.01	(85,052,000)
2023070503483	B	USDMXN	07/07/2023	1,000,000	17.03	(17,034,670)
2023070503160	S	USDMXN	07/07/2023	(100,000,000)	17.00	1,700,330,000
2023070503162	S	USDMXN	07/07/2023	(100,000,000)	17.00	1,700,330,000
2023070503375	S	USDMXN	07/07/2023	(1,250,000)	17.00	21,246,238
2023070503417	S	USDMXN	07/07/2023	(6,494,569)	17.01	110,447,739
2023070503433	S	USDMXN	07/07/2023	(305,432)	17.01	5,196,311
2023070603203	B	USDMXN	07/07/2023	100,000,000	17.15	(1,715,000,000)
2023070603205	B	USDMXN	07/07/2023	100,000,000	17.15	(1,715,000,000)
2023070603014	S	USDMXN	07/07/2023	(180,000,000)	17.11	3,079,260,000
2023050303256	BO	USDMXN	07/10/2023	40,000	18.16	(726,313)
2023061903380	SO	USDMXN	07/10/2023	(136,000)	17.15	2,332,404
2023062103334	BO	USDMXN	07/10/2023	46,000	17.19	(790,637)
2023062203302	SO	USDMXN	07/10/2023	(383,000)	17.21	6,591,726
2023063003771	BO	USDMXN	07/10/2023	58,270	17.15	(999,487)
2023070603015	B	USDMXN	07/10/2023	180,000,000	17.12	(3,080,790,000)
2023070603199	B	USDMXN	07/10/2023	1,000,000	17.21	(17,205,010)
2023070603626	B	USDMXN	07/10/2023	200,000	17.25	(3,450,312)
2023070603655	B	USDMXN	07/10/2023	2,500,000	17.24	(43,106,000)
2023070603657	B	USDMXN	07/10/2023	2,500,000	17.24	(43,106,250)
2023070603154	S	USDMXN	07/10/2023	(1,000,000)	17.22	17,220,850
2023070603204	S	USDMXN	07/10/2023	(100,000,000)	17.16	1,715,990,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023070603206	S	USDMXN	07/10/2023	(100,000,000)	17.16	1,715,990,000
2023070603396	S	USDMXN	07/10/2023	(1,000,000)	17.28	17,278,300
2023070603402	S	USDMXN	07/10/2023	(1,000,000)	17.26	17,261,310
2023070603551	S	USDMXN	07/10/2023	(2,700)	17.26	46,596
2023070603575	S	USDMXN	07/10/2023	(1,000,000)	17.26	17,260,000
2023070703441	B	USDMXN	07/10/2023	100,000,000	17.10	(1,710,000,000)
2023070703444	B	USDMXN	07/10/2023	100,000,000	17.10	(1,710,000,000)
2023070703220	S	USDMXN	07/10/2023	(50,000,000)	17.11	855,500,000
2023070703294	S	USDMXN	07/10/2023	(58,000,000)	17.11	992,438,000
2023070703297	S	USDMXN	07/10/2023	(67,000,000)	17.11	1,146,437,000
2023022803034	BO	USDMXN	07/11/2023	25,000	18.78	(469,509)
2023030903541	BO	USDMXN	07/11/2023	50,000	18.48	(924,180)
2023040503432	BO	USDMXN	07/11/2023	150,000	18.44	(2,766,127)
2023041003215	B	USDMXN	07/11/2023	153,846	18.50	(2,845,508)
2023041303595	BO	USDMXN	07/11/2023	100,000	18.33	(1,832,562)
2023050203377	B	USDMXN	07/11/2023	81,818	18.27	(1,494,580)
2023050503418	BO	USDMXN	07/11/2023	95,238	17.99	(1,713,536)
2023051003125	BO	USDMXN	07/11/2023	100,000	17.84	(1,783,674)
2023062203584	SO	USDMXN	07/11/2023	(281,000)	17.24	4,845,156
2023062703329	BO	USDMXN	07/11/2023	11,437	17.16	(196,218)
2023062703330	BO	USDMXN	07/11/2023	203,000	17.16	(3,482,661)
2023062703357	SO	USDMXN	07/11/2023	(10,904)	17.14	186,882
2023070703017	B	USDMXN	07/11/2023	1,000,000	17.14	(17,144,670)
2023070703018	B	USDMXN	07/11/2023	1,000,000	17.14	(17,141,550)
2023070703019	B	USDMXN	07/11/2023	1,000,000	17.14	(17,136,620)
2023070703221	B	USDMXN	07/11/2023	50,000,000	17.11	(855,635,000)
2023070703295	B	USDMXN	07/11/2023	58,000,000	17.11	(992,600,400)
2023070703298	B	USDMXN	07/11/2023	67,000,000	17.11	(1,146,624,600)
2023070703402	B	USDMXN	07/11/2023	25,000	17.09	(427,168)
2023070703436	B	USDMXN	07/11/2023	25,000	17.09	(427,130)
2023070703038	S	USDMXN	07/11/2023	(1,000,000)	17.11	17,109,140
2023070703039	S	USDMXN	07/11/2023	(1,000,000)	17.10	17,096,010
2023070703041	S	USDMXN	07/11/2023	(1,000,000)	17.10	17,098,330
2023070703442	S	USDMXN	07/11/2023	(100,000,000)	17.10	1,710,320,000
2023070703445	S	USDMXN	07/11/2023	(100,000,000)	17.10	1,710,320,000
2023070703584	S	USDMXN	07/11/2023	(22,990)	17.12	393,603
2023071003156	B	USDMXN	07/11/2023	50,000,000	17.08	(854,000,000)
2023011703068	B	USDMXN	07/12/2023	500,000	19.42	(9,709,698)
2023021703439	B	USDMXN	07/12/2023	500,000	18.88	(9,439,906)
2023041803632	B	USDMXN	07/12/2023	39,600	18.36	(727,051)
2023050503732	B	USDMXN	07/12/2023	61,500	18.02	(1,107,954)
2023050803625	B	USDMXN	07/12/2023	500,000	18.01	(9,006,940)
2023052603487	BO	USDMXN	07/12/2023	60,000	17.81	(1,068,512)
2023053103653	BO	USDMXN	07/12/2023	56,000	17.85	(999,390)
2023060203625	BO	USDMXN	07/12/2023	86,200	17.69	(1,524,607)
2023060603539	BO	USDMXN	07/12/2023	34,550	17.52	(605,422)
2023060703577	BO	USDMXN	07/12/2023	160,800	17.49	(2,811,741)
2023060803454	BO	USDMXN	07/12/2023	50,000	17.51	(875,494)
2023060803488	BO	USDMXN	07/12/2023	106,450	17.50	(1,862,533)
2023060803558	B	USDMXN	07/12/2023	37,600	17.49	(657,578)
2023060903671	BO	USDMXN	07/12/2023	18,850	17.38	(327,626)
2023061603202	BO	USDMXN	07/12/2023	15,000	17.17	(257,511)
2023062703328	BO	USDMXN	07/12/2023	34,484	17.16	(591,718)
2023070303493	BO	USDMXN	07/12/2023	42,190	17.08	(720,804)
2023070503655	BO	USDMXN	07/12/2023	83,576	17.03	(1,423,156)
2023070603515	SO	USDMXN	07/12/2023	(200,000)	17.30	3,460,499
2023070703382	SO	USDMXN	07/12/2023	(200,000)	17.31	3,461,674
2023071003483	B	USDMXN	07/12/2023	7,000,000	17.05	(119,315,000)
2023071003157	S	USDMXN	07/12/2023	(50,000,000)	17.08	854,160,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023071003485	S	USDMXN	07/12/2023	(7,399,639)	17.04	126,112,043
2023071003487	S	USDMXN	07/12/2023	(7,590,133)	17.04	129,349,298
2023071003490	S	USDMXN	07/12/2023	(7,590,133)	17.04	129,350,285
2023071003497	S	USDMXN	07/12/2023	(628,500)	17.04	10,711,023
2023071003504	S	USDMXN	07/12/2023	(1,497,659)	17.04	25,523,848
2022071903020	BO	USDMXN	07/13/2023	250,000	21.81	(5,452,125)
2022090803464	SO	USDMXN	07/13/2023	(261,342)	21.08	5,509,978
2022120103201	B	USDMXN	07/13/2023	1,718,521	19.92	(34,236,573)
2023020203323	BO	USDMXN	07/13/2023	100,000	19.14	(1,914,222)
2023032703601	BO	USDMXN	07/13/2023	30,071	18.75	(563,689)
2023040403488	B	USDMXN	07/13/2023	386,378	18.46	(7,132,822)
2023041103436	B	USDMXN	07/13/2023	9,052,369	18.51	(167,593,641)
2023042003415	B	USDMXN	07/13/2023	60,000	18.32	(1,098,959)
2023042403658	BO	USDMXN	07/13/2023	60,000	18.26	(1,095,769)
2023050303599	BO	USDMXN	07/13/2023	50,000	18.12	(905,774)
2023050503613	BO	USDMXN	07/13/2023	25,000	18.02	(450,616)
2023050903482	B	USDMXN	07/13/2023	2,117,866	17.98	(38,088,253)
2023051103644	SO	USDMXN	07/13/2023	(1,111,939)	17.80	19,789,429
2023051503818	BO	USDMXN	07/13/2023	30,071	17.66	(531,051)
2023051603619	B	USDMXN	07/13/2023	2,381,080	17.66	(42,052,517)
2023051803536	SO	USDMXN	07/13/2023	(2,690,000)	17.88	48,108,651
2023051903263	BO	USDMXN	07/13/2023	10,077	17.90	(180,419)
2023051903129	SO	USDMXN	07/13/2023	(1,785)	17.91	31,974
2023060203250	BO	USDMXN	07/13/2023	100,000	17.64	(1,764,046)
2023060603497	B	USDMXN	07/13/2023	1,018,880	17.52	(17,853,399)
2023061203227	BO	USDMXN	07/13/2023	796,565	17.42	(13,872,826)
2023061303511	B	USDMXN	07/13/2023	286,810	17.30	(4,962,886)
2023062303312	BO	USDMXN	07/13/2023	32,032	17.24	(552,085)
2023062603465	S	USDMXN	07/13/2023	(250,000)	17.18	4,294,322
2023062703410	S	USDMXN	07/13/2023	(3,296,544)	17.15	56,546,217
2023062703412	S	USDMXN	07/13/2023	(3,540,411)	17.15	60,735,295
2023062703432	S	USDMXN	07/13/2023	(3,163,044)	17.15	54,253,266
2023070303409	BO	USDMXN	07/13/2023	15,435	17.09	(263,717)
2023070403287	SO	USDMXN	07/13/2023	(5,000,000)	17.07	85,330,200
2023070403290	SO	USDMXN	07/13/2023	(3,013,085)	17.07	51,421,809
2023070603519	SO	USDMXN	07/13/2023	(249,000)	17.21	4,285,472
2023071103369	S	USDMXN	07/13/2023	(65,600)	17.06	1,119,208
2023071103371	S	USDMXN	07/13/2023	(59,200)	17.06	1,009,999
2023071103418	S	USDMXN	07/13/2023	(218,096)	17.05	3,718,079
2023071103420	S	USDMXN	07/13/2023	(17,200)	17.05	293,219
2023071103422	S	USDMXN	07/13/2023	(114,000)	17.05	1,943,404
2023071103424	S	USDMXN	07/13/2023	(17,200)	17.05	293,217
2023071103426	S	USDMXN	07/13/2023	(97,600)	17.05	1,663,836
2023071103428	S	USDMXN	07/13/2023	(97,600)	17.05	1,663,836
2023071103430	S	USDMXN	07/13/2023	(97,600)	17.05	1,663,777
2023071103432	S	USDMXN	07/13/2023	(97,600)	17.05	1,663,758
2023071103468	S	USDMXN	07/13/2023	(4,963,790)	17.05	84,632,278
2022013103145	B	USDMXN	07/14/2023	658,499	22.81	(15,017,784)
2022032403654	B	USDMXN	07/14/2023	551,868	22.01	(12,145,786)
2022041303531	S	USDMXN	07/14/2023	(158,750)	21.48	3,410,572
2022072803426	B	USDMXN	07/14/2023	10,000,000	21.67	(216,667,970)
2023012003457	BO	USDMXN	07/14/2023	174,777	19.48	(3,404,010)
2023021403281	BO	USDMXN	07/14/2023	500,000	19.08	(9,539,902)
2023030103058	BO	USDMXN	07/14/2023	300,000	18.70	(5,609,755)
2023030203459	BO	USDMXN	07/14/2023	50,000	18.57	(928,599)
2023030303595	BO	USDMXN	07/14/2023	250,000	18.42	(4,605,548)
2023031003606	SO	USDMXN	07/14/2023	(175,000)	18.94	3,314,218
2023031403114	SO	USDMXN	07/14/2023	(175,000)	19.54	3,420,029
2023041203337	BO	USDMXN	07/14/2023	450,000	18.39	(8,275,875)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050503500	BO	USDMXN	07/14/2023	70,000	17.99	(1,259,278)
2023060103542	BO	USDMXN	07/14/2023	156,000	17.71	(2,762,262)
2023060103610	BO	USDMXN	07/14/2023	535	17.70	(9,474)
2023060703218	BO	USDMXN	07/14/2023	400,000	17.46	(6,984,110)
2023061403056	BO	USDMXN	07/14/2023	130,000	17.26	(2,244,423)
2023061603175	BO	USDMXN	07/14/2023	70,000	17.19	(1,203,254)
2023062803637	S	USDMXN	07/14/2023	(2,000,000)	17.14	34,286,160
2023063003458	B	USDMXN	07/14/2023	250,000	17.17	(4,291,541)
2023063003772	BO	USDMXN	07/14/2023	58,210	17.17	(999,219)
2023070603518	SO	USDMXN	07/14/2023	(282,000)	17.21	4,854,318
2023071203191	B	USDMXN	07/14/2023	1,000,000	16.86	(16,863,650)
2023071203423	S	USDMXN	07/14/2023	(5,897,965)	16.88	99,573,577
2023071403064	S	USDMXN	07/14/2023	(11,110,015)	16.84	187,092,653
2023071403300	S	USDMXN	07/14/2023	(30,000,000)	16.85	505,470,000
2022102503161	BO	USDMXN	07/17/2023	288,540	20.91	(6,033,725)
2022110403589	BO	USDMXN	07/17/2023	288,540	20.50	(5,915,315)
2023011103426	BO	USDMXN	07/17/2023	416,433	19.62	(8,169,141)
2023021303128	BO	USDMXN	07/17/2023	416,000	19.22	(7,997,363)
2023021303196	BO	USDMXN	07/17/2023	433	19.21	(8,316)
2023050503501	BO	USDMXN	07/17/2023	30,000	18.00	(540,017)
2023051503635	BO	USDMXN	07/17/2023	100,000	17.71	(1,771,344)
2023062103335	BO	USDMXN	07/17/2023	40,000	17.21	(688,508)
2023062803635	SO	USDMXN	07/17/2023	(281,000)	17.14	4,817,131
2023062903402	BO	USDMXN	07/17/2023	2,000	17.16	(34,313)
2023062903496	SO	USDMXN	07/17/2023	(135,000)	17.20	2,321,470
2023071303107	S	USDMXN	07/17/2023	(367,881)	16.94	6,230,469
2023071303120	S	USDMXN	07/17/2023	(393,034)	16.93	6,653,948
2023071303122	S	USDMXN	07/17/2023	(409,230)	16.93	6,928,837
2023071303531	S	USDMXN	07/17/2023	(13,500,000)	16.83	227,260,350
2023071303533	S	USDMXN	07/17/2023	(13,500,000)	16.83	227,238,750
2023071403065	B	USDMXN	07/17/2023	11,110,015	16.85	(187,184,866)
2023071403301	B	USDMXN	07/17/2023	30,000,000	16.86	(505,728,000)
2023030903540	BO	USDMXN	07/18/2023	50,000	18.51	(925,378)
2023032903319	BO	USDMXN	07/18/2023	1,000,000	18.47	(18,473,251)
2023033103692	B	USDMXN	07/18/2023	4,000,000	18.39	(73,567,634)
2023040503435	BO	USDMXN	07/18/2023	150,000	18.47	(2,769,943)
2023041003217	B	USDMXN	07/18/2023	153,846	18.52	(2,849,937)
2023041303597	BO	USDMXN	07/18/2023	100,000	18.35	(1,835,146)
2023050203379	B	USDMXN	07/18/2023	81,818	18.29	(1,496,612)
2023050503419	BO	USDMXN	07/18/2023	95,238	18.02	(1,715,945)
2023051603583	B	USDMXN	07/18/2023	55,000,000	17.68	(972,345,000)
2023051603818	B	USDMXN	07/18/2023	55,000,000	17.68	(972,345,000)
2023060103535	BO	USDMXN	07/18/2023	1,600,000	17.72	(28,353,409)
2023060103611	BO	USDMXN	07/18/2023	7,024	17.71	(124,412)
2023060203152	B	USDMXN	07/18/2023	5,441,206	17.64	(95,973,359)
2023061403583	S	USDMXN	07/18/2023	(35,000)	17.24	603,236
2023061603516	S	USDMXN	07/18/2023	(255,000)	17.14	4,370,717
2023062303604	B	USDMXN	07/18/2023	9,347,150	17.23	(161,061,489)
2023062903633	SO	USDMXN	07/18/2023	(168,000)	17.16	2,882,970
2023070303408	S	USDMXN	07/18/2023	(200,000)	17.10	3,420,067
2023070603627	S	USDMXN	07/18/2023	(200,000)	17.28	3,455,189
2023071403668	B	USDMXN	07/18/2023	250,000	16.73	(4,183,208)
2023071403672	B	USDMXN	07/18/2023	1,190,804	16.74	(19,928,343)
2023071703413	S	USDMXN	07/18/2023	(40,000,000)	16.76	670,280,000
2023071703419	S	USDMXN	07/18/2023	(40,000,000)	16.76	670,280,000
2023071803190	S	USDMXN	07/18/2023	(50,000,000)	16.73	836,500,000
2022072903226	BO	USDMXN	07/19/2023	250,000	21.56	(5,390,774)
2022082303296	S	USDMXN	07/19/2023	(286,103)	21.32	6,099,193
2022083003221	SO	USDMXN	07/19/2023	(285,000)	21.39	6,096,614



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2022092703130	SO	USDMXN	07/19/2023	(140)	21.46	3,004
2022111503642	B	USDMXN	07/19/2023	385,434	20.24	(7,800,468)
2022111703241	BO	USDMXN	07/19/2023	942,833	20.32	(19,154,890)
2022111703760	B	USDMXN	07/19/2023	1,569,242	20.30	(31,853,380)
2022111803556	B	USDMXN	07/19/2023	304,665	20.33	(6,193,156)
2022112903725	B	USDMXN	07/19/2023	100,414	20.07	(2,015,360)
2023010403590	BO	USDMXN	07/19/2023	554,185	20.09	(11,132,534)
2023011903682	BO	USDMXN	07/19/2023	39,745	19.69	(782,442)
2023012603545	B	USDMXN	07/19/2023	434,270	19.41	(8,431,071)
2023020103654	B	USDMXN	07/19/2023	53,226	19.20	(1,022,077)
2023021003699	BO	USDMXN	07/19/2023	1,021,855	19.24	(19,658,492)
2023022103717	BO	USDMXN	07/19/2023	133,561	18.99	(2,535,781)
2023032903471	BO	USDMXN	07/19/2023	66,240	18.49	(1,224,692)
2023041303252	B	USDMXN	07/19/2023	249,363	18.36	(4,579,024)
2023042003525	B	USDMXN	07/19/2023	165,436	18.36	(3,037,060)
2023050503734	B	USDMXN	07/19/2023	61,500	18.04	(1,109,499)
2023050803354	B	USDMXN	07/19/2023	25,000,000	18.05	(451,139,200)
2023051203485	BO	USDMXN	07/19/2023	347,000	17.81	(6,181,573)
2023051203496	SO	USDMXN	07/19/2023	(7,000)	17.81	124,696
2023051603790	SO	USDMXN	07/19/2023	(110,452)	17.72	1,956,828
2023051703576	BO	USDMXN	07/19/2023	79,480	17.78	(1,413,018)
2023060703390	BO	USDMXN	07/19/2023	105,472	17.51	(1,846,297)
2023060803453	BO	USDMXN	07/19/2023	50,000	17.53	(876,688)
2023061203549	BO	USDMXN	07/19/2023	22,850	17.41	(397,831)
2023061403136	BO	USDMXN	07/19/2023	44,328	17.24	(764,216)
2023061403553	BO	USDMXN	07/19/2023	75,000	17.21	(1,290,932)
2023062103578	BO	USDMXN	07/19/2023	96,900	17.23	(1,669,170)
2023062603467	S	USDMXN	07/19/2023	(250,000)	17.20	4,300,348
2023062703358	BO	USDMXN	07/19/2023	111,600	17.17	(1,916,297)
2023062703537	BO	USDMXN	07/19/2023	82,000	17.16	(1,407,091)
2023062703687	BO	USDMXN	07/19/2023	61,200	17.15	(1,049,671)
2023070303424	BO	USDMXN	07/19/2023	39,004	17.11	(667,334)
2023070503656	BO	USDMXN	07/19/2023	77,600	17.05	(1,323,174)
2023070603521	BO	USDMXN	07/19/2023	80,000	17.33	(1,386,685)
2023071103419	B	USDMXN	07/19/2023	218,096	17.07	(3,722,332)
2023071103537	BO	USDMXN	07/19/2023	174,080	17.08	(2,973,161)
2023071403514	S	USDMXN	07/19/2023	(25,000,000)	16.76	419,001,748
2023071703414	B	USDMXN	07/19/2023	40,000,000	16.76	(670,396,000)
2023071703420	B	USDMXN	07/19/2023	40,000,000	16.76	(670,396,000)
2023071703430	S	USDMXN	07/19/2023	(628,500)	16.76	10,534,226
2022070603464	SO	USDMXN	07/20/2023	(817)	22.20	18,136
2022081003400	B	USDMXN	07/20/2023	3,900,000	21.26	(82,906,064)
2022120103199	B	USDMXN	07/20/2023	1,718,521	19.95	(34,280,637)
2023020203324	BO	USDMXN	07/20/2023	100,000	19.17	(1,916,701)
2023032703603	BO	USDMXN	07/20/2023	30,071	18.77	(564,471)
2023032903539	BO	USDMXN	07/20/2023	25,000	18.50	(462,385)
2023042403659	BO	USDMXN	07/20/2023	60,000	18.29	(1,097,278)
2023050203708	BO	USDMXN	07/20/2023	235,000	18.25	(4,289,551)
2023050503491	BO	USDMXN	07/20/2023	50,000	18.08	(903,896)
2023051503819	BO	USDMXN	07/20/2023	30,071	17.69	(531,820)
2023051903258	BO	USDMXN	07/20/2023	3,298	17.92	(59,112)
2023061203228	BO	USDMXN	07/20/2023	796,565	17.44	(13,892,071)
2023061603457	BO	USDMXN	07/20/2023	60,000	17.20	(1,031,798)
2023062103350	B	USDMXN	07/20/2023	3,999,942	17.21	(68,835,477)
2023062303313	BO	USDMXN	07/20/2023	16,380	17.26	(282,721)
2023062303638	BO	USDMXN	07/20/2023	22,072	17.25	(380,671)
2023063003746	SO	USDMXN	07/20/2023	(100,000)	17.19	1,719,337
2023070303410	BO	USDMXN	07/20/2023	15,435	17.11	(264,072)
2023070703582	BO	USDMXN	07/20/2023	11,812	17.15	(202,559)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023071003645	BO	USDMXN	07/20/2023	20,000	17.09	(341,764)
2023071303566	BO	USDMXN	07/20/2023	13,486	16.85	(227,291)
2023071803191	B	USDMXN	07/20/2023	50,000,000	16.74	(836,810,000)
2023071803201	S	USDMXN	07/20/2023	(3,476,855)	16.73	58,173,349
2023071803204	S	USDMXN	07/20/2023	(656,148)	16.74	10,981,693
2023071803206	S	USDMXN	07/20/2023	(2,807,252)	16.74	46,984,977
2023071803208	S	USDMXN	07/20/2023	(4,902,680)	16.74	82,058,612
2023071803210	S	USDMXN	07/20/2023	(1,577,017)	16.74	26,393,894
2023071803213	S	USDMXN	07/20/2023	(415,990)	16.74	6,962,050
2023071803215	S	USDMXN	07/20/2023	(1,052,737)	16.74	17,619,129
2023071803218	S	USDMXN	07/20/2023	(619,363)	16.74	10,366,030
2023071803408	S	USDMXN	07/20/2023	(628,500)	16.75	10,529,638
2023071803504	S	USDMXN	07/20/2023	(628,500)	16.75	10,525,050
2023072003169	B	USDMXN	07/20/2023	30,000,000	16.81	(504,300,000)
2023072003486	S	USDMXN	07/20/2023	(20,000,000)	16.88	337,600,000
2022042103294	SO	USDMXN	07/21/2023	(158,750)	21.89	3,475,536
2022092603535	B	USDMXN	07/21/2023	200,000	21.54	(4,307,712)
2022092603539	S	USDMXN	07/21/2023	(400,000)	21.52	8,607,912
2023011803547	BO	USDMXN	07/21/2023	25,000	19.49	(487,227)
2023012603305	BO	USDMXN	07/21/2023	1,500,000	19.46	(29,182,719)
2023021703449	B	USDMXN	07/21/2023	250,000	18.91	(4,727,690)
2023022003234	BO	USDMXN	07/21/2023	250,000	18.92	(4,730,089)
2023030203460	BO	USDMXN	07/21/2023	50,000	18.60	(929,832)
2023030803175	BO	USDMXN	07/21/2023	250,000	18.40	(4,599,390)
2023040303587	BO	USDMXN	07/21/2023	200,000	18.49	(3,698,282)
2023052903435	B	USDMXN	07/21/2023	300,000	17.77	(5,331,987)
2023061603177	BO	USDMXN	07/21/2023	70,000	17.21	(1,204,955)
2023063003773	BO	USDMXN	07/21/2023	58,140	17.19	(999,316)
2023063003743	SO	USDMXN	07/21/2023	(411,000)	17.20	7,067,366
2023070503564	SO	USDMXN	07/21/2023	(150,000)	17.06	2,559,594
2023070703434	BO	USDMXN	07/21/2023	400,000	17.12	(6,849,476)
2023071903349	S	USDMXN	07/21/2023	(628,500)	16.75	10,530,455
2023071903358	S	USDMXN	07/21/2023	(94,976)	16.75	1,591,304
2023071903360	S	USDMXN	07/21/2023	(60,000)	16.75	1,005,288
2023071903362	S	USDMXN	07/21/2023	(40,000)	16.75	670,196
2023071903364	S	USDMXN	07/21/2023	(118,200)	16.75	1,980,406
2023071903367	S	USDMXN	07/21/2023	(99,000)	16.75	1,658,686
2023071903521	S	USDMXN	07/21/2023	(628,500)	16.73	10,514,239
2023072003487	B	USDMXN	07/21/2023	20,000,000	16.88	(337,660,000)
2023072103494	S	USDMXN	07/21/2023	(25,000,000)	16.85	421,125,000
2022122803073	BO	USDMXN	07/24/2023	1,590,000	20.16	(32,051,330)
2023012003417	BO	USDMXN	07/24/2023	933,740	19.57	(18,276,015)
2023022203378	BO	USDMXN	07/24/2023	93,374	18.88	(1,762,708)
2023062303606	B	USDMXN	07/24/2023	2,318,203	17.25	(39,995,659)
2023070603520	BO	USDMXN	07/24/2023	45,000	17.33	(779,925)
2023071203340	BO	USDMXN	07/24/2023	500,000	16.87	(8,433,447)
2023071203566	BO	USDMXN	07/24/2023	38,700	16.92	(654,833)
2023071403803	BO	USDMXN	07/24/2023	9,000	16.77	(150,963)
2023072003391	B	USDMXN	07/24/2023	200,000	16.86	(3,372,240)
2023072003393	B	USDMXN	07/24/2023	200,000	16.86	(3,372,058)
2023072003170	S	USDMXN	07/24/2023	(30,000,000)	16.82	504,636,000
2023072103495	B	USDMXN	07/24/2023	25,000,000	16.85	(421,352,500)
2023072103544	B	USDMXN	07/24/2023	500,000	16.96	(8,481,010)
2023030303588	BO	USDMXN	07/25/2023	100,000	18.49	(1,848,709)
2023030903542	BO	USDMXN	07/25/2023	50,000	18.53	(926,586)
2023040503433	BO	USDMXN	07/25/2023	150,000	18.49	(2,773,763)
2023041003220	B	USDMXN	07/25/2023	153,846	18.55	(2,854,027)
2023042603465	BO	USDMXN	07/25/2023	4,670,360	18.41	(85,982,281)
2023050203381	B	USDMXN	07/25/2023	81,818	18.32	(1,498,660)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050503420	BO	USDMXN	07/25/2023	95,238	18.04	(1,718,354)
2023050503543	BO	USDMXN	07/25/2023	50,000	18.03	(901,462)
2023050503557	BO	USDMXN	07/25/2023	50,000	18.07	(903,509)
2023052603405	BO	USDMXN	07/25/2023	500,000	17.97	(8,986,374)
2023052603406	BO	USDMXN	07/25/2023	500,000	17.96	(8,981,256)
2023060903591	B	USDMXN	07/25/2023	300,000	17.41	(5,224,425)
2023070703563	SO	USDMXN	07/25/2023	(289,000)	17.37	5,018,757
2023071203639	BO	USDMXN	07/25/2023	30,000	16.93	(507,810)
2023072103343	B	USDMXN	07/25/2023	925,550	16.95	(15,688,450)
2023072103345	B	USDMXN	07/25/2023	925,631	16.95	(15,690,554)
2023072103539	B	USDMXN	07/25/2023	200,000	16.97	(3,393,020)
2023072103541	B	USDMXN	07/25/2023	200,000	16.96	(3,392,940)
2023072103550	B	USDMXN	07/25/2023	200,000	16.97	(3,393,860)
2023072103304	S	USDMXN	07/25/2023	(800,000)	16.95	13,563,280
2023072103308	S	USDMXN	07/25/2023	(1,300,000)	16.95	22,040,590
2023072103313	S	USDMXN	07/25/2023	(1,000,000)	16.95	16,954,100
2023072103524	S	USDMXN	07/25/2023	(628,500)	16.95	10,655,023
2023072103552	S	USDMXN	07/25/2023	(100,000)	16.97	1,696,720
2023072503276	B	USDMXN	07/25/2023	100,000,000	16.90	(1,690,000,000)
2023072503278	B	USDMXN	07/25/2023	100,000,000	16.90	(1,690,000,000)
2023072503265	S	USDMXN	07/25/2023	(11,285,015)	16.90	190,716,754
2023072503285	S	USDMXN	07/25/2023	(180,000,000)	16.92	3,045,240,000
2022072903227	BO	USDMXN	07/26/2023	250,000	21.59	(5,397,084)
2023021503482	BO	USDMXN	07/26/2023	500,000	19.20	(9,600,423)
2023050503736	B	USDMXN	07/26/2023	61,500	18.07	(1,111,044)
2023051203774	BO	USDMXN	07/26/2023	29,295	17.84	(522,581)
2023052603817	BO	USDMXN	07/26/2023	36,400	17.88	(650,795)
2023060703389	BO	USDMXN	07/26/2023	105,600	17.53	(1,851,065)
2023060803455	BO	USDMXN	07/26/2023	50,000	17.56	(877,880)
2023061603465	BO	USDMXN	07/26/2023	48,000	17.19	(824,938)
2023062103332	BO	USDMXN	07/26/2023	47,200	17.28	(815,546)
2023062103581	BO	USDMXN	07/26/2023	28,000	17.25	(482,970)
2023062303332	B	USDMXN	07/26/2023	40,000	17.27	(690,959)
2023062303750	BO	USDMXN	07/26/2023	26,800	17.30	(463,638)
2023062603472	S	USDMXN	07/26/2023	(250,000)	17.22	4,305,962
2023070503657	BO	USDMXN	07/26/2023	228,800	17.07	(3,906,684)
2023071103421	B	USDMXN	07/26/2023	17,200	17.09	(293,944)
2023071403457	BO	USDMXN	07/26/2023	48,614	16.81	(816,996)
2023071403632	BO	USDMXN	07/26/2023	267,132	16.77	(4,479,232)
2023071703433	BO	USDMXN	07/26/2023	91,184	16.78	(1,530,301)
2023071803036	BO	USDMXN	07/26/2023	281,952	16.76	(4,724,684)
2023071903359	B	USDMXN	07/26/2023	94,976	16.77	(1,592,796)
2023072403068	B	USDMXN	07/26/2023	1,000,000	16.88	(16,882,610)
2023072403074	B	USDMXN	07/26/2023	1,000,000	16.86	(16,855,440)
2023072403097	B	USDMXN	07/26/2023	1,000,000	16.84	(16,836,700)
2023072403099	B	USDMXN	07/26/2023	1,000,000	16.84	(16,838,040)
2023072403294	B	USDMXN	07/26/2023	1,900,000	16.82	(31,958,000)
2023072403305	B	USDMXN	07/26/2023	200,000	16.82	(3,363,540)
2023072403607	B	USDMXN	07/26/2023	628,500	16.83	(10,577,655)
2023072403115	S	USDMXN	07/26/2023	(5,000,000)	16.82	84,088,500
2023072403296	S	USDMXN	07/26/2023	(600,000)	16.82	10,091,400
2023072403299	S	USDMXN	07/26/2023	(500,000)	16.82	8,409,750
2023072403301	S	USDMXN	07/26/2023	(500,000)	16.82	8,409,700
2023072403303	S	USDMXN	07/26/2023	(500,000)	16.82	8,409,400
2023072403535	S	USDMXN	07/26/2023	(2,030)	16.83	34,159
2023072403564	S	USDMXN	07/26/2023	(628,500)	16.85	10,587,460
2023072503266	B	USDMXN	07/26/2023	11,285,015	16.90	(190,747,223)
2023072503286	B	USDMXN	07/26/2023	180,000,000	16.92	(3,045,780,000)
2023072503277	S	USDMXN	07/26/2023	(100,000,000)	16.90	1,690,320,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072503279	S	USDMXN	07/26/2023	(100,000,000)	16.90	1,690,320,000
2023072503299	S	USDMXN	07/26/2023	(13,500,000)	16.91	228,322,530
2023072603080	B	USDMXN	07/26/2023	100,000,000	16.88	(1,687,500,000)
2023072603082	B	USDMXN	07/26/2023	100,000,000	16.88	(1,687,500,000)
2023072603058	S	USDMXN	07/26/2023	(100,000,000)	16.88	1,687,500,000
2023072603060	S	USDMXN	07/26/2023	(100,000,000)	16.88	1,687,500,000
2023072603062	S	USDMXN	07/26/2023	(100,000,000)	16.88	1,687,500,000
2022082403487	SO	USDMXN	07/27/2023	(250,000)	21.26	5,315,604
2022082403489	SO	USDMXN	07/27/2023	(9,966)	21.25	211,767
2022090803465	SO	MXNUSD	07/27/2023	(260,763)	21.16	12,324
2022090803467	SO	USDMXN	07/27/2023	(273,087)	21.13	5,771,119
2022120103196	B	USDMXN	07/27/2023	1,718,521	19.97	(34,320,866)
2023020203325	BO	USDMXN	07/27/2023	100,000	19.19	(1,919,180)
2023032303497	S	USDMXN	07/27/2023	(423,120)	19.07	8,069,723
2023032703604	BO	USDMXN	07/27/2023	30,071	18.80	(565,253)
2023041803541	B	USDMXN	07/27/2023	967,800	18.41	(17,815,890)
2023042503478	BON	USDMXN	07/27/2023	200,000,000	18.43	(3,685,600,000)
2023042503474	SON	USDMXN	07/27/2023	(200,000,000)	18.43	3,686,600,000
2023042703692	SO	USDMXN	07/27/2023	(129,900)	18.35	2,383,990
2023050203625	B	USDMXN	07/27/2023	5,749,719	18.28	(105,103,570)
2023050403567	B	USDMXN	07/27/2023	387,209	18.19	(7,045,204)
2023050903489	B	USDMXN	07/27/2023	734,919	18.03	(13,253,341)
2023051503820	BO	USDMXN	07/27/2023	30,071	17.71	(532,581)
2023051903260	BO	USDMXN	07/27/2023	3,298	17.95	(59,196)
2023052503529	S	USDMXN	07/27/2023	(286,294)	18.07	5,172,583
2023052503533	S	USDMXN	07/27/2023	(101,687)	18.07	1,837,419
2023052503535	S	USDMXN	07/27/2023	(272,000)	18.07	4,914,722
2023060103573	S	USDMXN	07/27/2023	(1,207,039)	17.75	21,421,795
2023060803569	BO	USDMXN	07/27/2023	3,000,000	17.55	(52,635,062)
2023061203230	BO	USDMXN	07/27/2023	796,563	17.46	(13,911,111)
2023061203474	SO	USDMXN	07/27/2023	(806,848)	17.43	14,061,170
2023061303197	BO	USDMXN	07/27/2023	45,141	17.36	(783,824)
2023061503632	B	USDMXN	07/27/2023	78,923	17.23	(1,360,080)
2023061503634	BO	USDMXN	07/27/2023	41,869	17.23	(721,521)
2023061603460	BO	USDMXN	07/27/2023	60,000	17.22	(1,033,232)
2023062303326	BO	USDMXN	07/27/2023	32,032	17.29	(553,742)
2023062303527	B	USDMXN	07/27/2023	116,745	17.26	(2,015,513)
2023062303529	BO	USDMXN	07/27/2023	57,847	17.27	(998,752)
2023062703411	B	USDMXN	07/27/2023	3,296,544	17.20	(56,701,903)
2023062703507	B	USDMXN	07/27/2023	60,000	17.19	(1,031,245)
2023070703507	SO	USDMXN	07/27/2023	(140,000)	17.15	2,401,682
2023071003619	BO	USDMXN	07/27/2023	20,000	17.11	(342,222)
2023071203640	BO	USDMXN	07/27/2023	29,900	16.93	(506,309)
2023071303567	BO	USDMXN	07/27/2023	6,743	16.88	(113,793)
2023071403630	B	USDMXN	07/27/2023	1,467,150	16.77	(24,603,215)
2023071903523	BO	USDMXN	07/27/2023	10,774	16.75	(180,466)
2023072003396	BO	USDMXN	07/27/2023	26,865	16.87	(453,253)
2023072503267	BON	USDMXN	07/27/2023	200,000,000	18.43	(3,686,600,000)
2023072503270	BO	USDMXN	07/27/2023	0	16.93	(299,300,000)
2023072503300	B	USDMXN	07/27/2023	13,500,000	16.92	(228,364,650)
2023072503319	B	USDMXN	07/27/2023	2,000,000	16.90	(33,800,000)
2023072503502	B	USDMXN	07/27/2023	3,514,303	16.91	(59,442,010)
2023072503512	B	USDMXN	07/27/2023	84,225	16.92	(1,425,112)
2023072503600	B	USDMXN	07/27/2023	5,000,000	16.93	(84,625,000)
2023072503612	B	USDMXN	07/27/2023	2,850,000	16.92	(48,222,000)
2023072503671	B	USDMXN	07/27/2023	30,515	16.93	(516,683)
2023072503707	B	USDMXN	07/27/2023	209,800	16.93	(3,551,883)
2023072503158	S	USDMXN	07/27/2023	(200,000)	16.93	3,386,000
2023072503159	S	USDMXN	07/27/2023	(1,088,646)	16.92	18,419,883

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072503160	S	USDMXN	07/27/2023	(711,354)	16.92	12,036,117
2023072503230	S	USDMXN	07/27/2023	(2,000,000)	16.92	33,838,000
2023072503269	SO	USDMXN	07/27/2023	0	16.93	300,300,000
2023072503268	SON	USDMXN	07/27/2023	(200,000,000)	18.43	3,685,600,000
2023072503320	S	USDMXN	07/27/2023	(48,000,000)	16.90	810,974,400
2023072503541	S	USDMXN	07/27/2023	(628,500)	16.92	10,632,397
2023072503566	S	USDMXN	07/27/2023	(1,000,000)	16.93	16,925,000
2023072503592	S	USDMXN	07/27/2023	(11,037,261)	16.92	186,762,603
2023072503603	S	USDMXN	07/27/2023	(2,813,283)	16.92	47,614,255
2023072503709	S	USDMXN	07/27/2023	(155,350)	16.92	2,628,988
2023072503711	S	USDMXN	07/27/2023	(54,450)	16.92	921,457
2023072603059	B	USDMXN	07/27/2023	100,000,000	16.88	(1,687,786,000)
2023072603061	B	USDMXN	07/27/2023	100,000,000	16.88	(1,687,786,000)
2023072603063	B	USDMXN	07/27/2023	100,000,000	16.88	(1,687,786,000)
2023072603081	S	USDMXN	07/27/2023	(100,000,000)	16.88	1,687,820,000
2023072603083	S	USDMXN	07/27/2023	(100,000,000)	16.88	1,687,820,000
2023072703192	B	USDMXN	07/27/2023	100,000,000	16.75	(1,675,000,000)
2023072703194	B	USDMXN	07/27/2023	100,000,000	16.75	(1,675,000,000)
2023072703038	S	USDMXN	07/27/2023	(50,000,000)	16.77	838,250,000
2023072703040	S	USDMXN	07/27/2023	(75,000,000)	16.73	1,254,750,000
2023072703136	S	USDMXN	07/27/2023	(75,000,000)	16.73	1,254,750,000
2023072703184	S	USDMXN	07/27/2023	(35,000,000)	16.77	586,775,000
2023072703187	S	USDMXN	07/27/2023	(15,000,000)	16.77	251,475,000
2023072703323	S	USDMXN	07/27/2023	(75,000,000)	16.74	1,255,125,000
2022042703309	SO	USDMXN	07/28/2023	(158,750)	22.36	3,549,032
2023030203461	BO	USDMXN	07/28/2023	50,000	18.62	(931,062)
2023030803176	BO	USDMXN	07/28/2023	250,000	18.42	(4,605,308)
2023031003607	SO	USDMXN	07/28/2023	(125,000)	18.99	2,373,516
2023031403370	BO	USDMXN	07/28/2023	766,955	19.11	(14,657,147)
2023031403111	SO	USDMXN	07/28/2023	(125,000)	19.60	2,449,473
2023032903309	BO	USDMXN	07/28/2023	3,000,000	18.51	(55,539,690)
2023042703693	BO	USDMXN	07/28/2023	96,168	18.39	(1,768,098)
2023042703689	S	USDMXN	07/28/2023	(96,168)	18.37	1,766,216
2023051503361	BO	USDMXN	07/28/2023	100,000	17.81	(1,781,045)
2023061603176	BO	USDMXN	07/28/2023	70,000	17.24	(1,206,619)
2023061603541	BO	USDMXN	07/28/2023	108,000	17.18	(1,855,256)
2023062903678	BO	USDMXN	07/28/2023	1,664,000	17.19	(28,603,591)
2023062903696	BO	USDMXN	07/28/2023	417	17.19	(7,173)
2023070703508	SO	USDMXN	07/28/2023	(297,000)	17.16	5,095,946
2023071203669	BO	USDMXN	07/28/2023	300,000	16.94	(5,081,733)
2023072003392	S	USDMXN	07/28/2023	(200,000)	16.87	3,374,590
2023072103553	B	USDMXN	07/28/2023	100,000	16.98	(1,697,647)
2023072103548	S	USDMXN	07/28/2023	(200,000)	16.98	3,395,027
2023072103551	S	USDMXN	07/28/2023	(200,000)	16.98	3,395,625
2023072503205	BON	USDMXN	07/28/2023	200,000,000	16.89	(3,377,600,000)
2023072503229	BON	USDMXN	07/28/2023	200,000,000	16.89	(3,377,600,000)
2023072503214	SON	USDMXN	07/28/2023	(200,000,000)	16.89	3,377,600,000
2023072503235	SON	USDMXN	07/28/2023	(200,000,000)	16.89	3,377,600,000
2023072503239	SON	USDMXN	07/28/2023	(200,000,000)	16.89	3,377,600,000
2023072603105	B	USDMXN	07/28/2023	2,000,000	16.82	(33,644,200)
2023072603393	B	USDMXN	07/28/2023	1,000,000	16.89	(16,893,420)
2023072603420	B	USDMXN	07/28/2023	1,000,000	16.90	(16,900,000)
2023072603577	BO	USDMXN	07/28/2023	0	16.82	(12,650,000)
2023072603576	BON	USDMXN	07/28/2023	200,000,000	16.89	(3,377,600,000)
2023072603113	S	USDMXN	07/28/2023	(2,000,000)	16.85	33,700,000
2023072603301	S	USDMXN	07/28/2023	(145,912)	16.88	2,462,688
2023072603303	S	USDMXN	07/28/2023	(36,000)	16.88	607,615
2023072603306	S	USDMXN	07/28/2023	(111,000)	16.88	1,874,080
2023072603308	S	USDMXN	07/28/2023	(40,000)	16.88	675,348



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072603328	S	USDMXN	07/28/2023	(628,500)	16.88	10,611,783
2023072603371	S	USDMXN	07/28/2023	(2,000,000)	16.88	33,767,200
2023072603373	S	USDMXN	07/28/2023	(2,000,000)	16.88	33,767,600
2023072603575	SON	USDMXN	07/28/2023	(200,000,000)	16.89	3,377,600,000
2023072603578	SO	USDMXN	07/28/2023	0	16.82	12,650,000
2023072703039	B	USDMXN	07/28/2023	50,000,000	16.77	(838,385,000)
2023072703041	B	USDMXN	07/28/2023	75,000,000	16.73	(1,254,960,000)
2023072703137	B	USDMXN	07/28/2023	75,000,000	16.73	(1,254,960,000)
2023072703185	B	USDMXN	07/28/2023	35,000,000	16.77	(586,869,500)
2023072703188	B	USDMXN	07/28/2023	15,000,000	16.77	(251,515,500)
2023072703324	B	USDMXN	07/28/2023	75,000,000	16.74	(1,255,327,500)
2023072703193	S	USDMXN	07/28/2023	(100,000,000)	16.75	1,675,300,000
2023072703195	S	USDMXN	07/28/2023	(100,000,000)	16.75	1,675,300,000
2022100503289	B	USDMXN	07/31/2023	640,000	21.25	(13,597,649)
2022110103570	B	USDMXN	07/31/2023	3,590,000	20.74	(74,449,158)
2023032803106	B	USDMXN	07/31/2023	333,333	18.71	(6,236,037)
2023041303564	B	USDMXN	07/31/2023	2,000,000	18.40	(36,802,362)
2023042603125	BON	USDMXN	07/31/2023	200,000,000	18.48	(3,695,800,000)
2023042603093	SON	USDMXN	07/31/2023	(200,000,000)	18.47	3,694,840,000
2023061603267	B	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.21	(9,810,453)
2023062003314	B	USDMXN	07/31/2023	2,500,000	17.35	(43,370,437)
2023062003497	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.34	(9,886,168)
2023062103308	B	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.25	(9,833,777)
2023062103391	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.26	(9,835,990)
2023062203185	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.29	(9,853,434)
2023062303123	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.27	(9,845,460)
2023062303438	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.27	(9,843,535)
2023062603411	B	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.24	(9,825,289)
2023062703475	B	USDMXN	07/31/2023	20,000,000	17.21	(344,197,500)
2023062703492	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.21	(9,807,990)
2023062803274	B	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.17	(9,786,598)
2023062903215	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.21	(9,810,509)
2023063003339	BO	USDMXN	07/31/2023	570,000	17.22	(9,816,019)
2023063003286	S	USDMXN	07/31/2023	(20,000,000)	17.23	344,655,720
2023070303332	BON	USDMXN	07/31/2023	200,000,000	17.13	(3,426,500,000)
2023070303344	SON	USDMXN	07/31/2023	(200,000,000)	17.16	3,431,500,000
2023071103183	SO	USDMXN	07/31/2023	(142,000)	17.14	2,434,447
2023071203334	BO	USDMXN	07/31/2023	30,000	16.87	(506,204)
2023071203567	SO	USDMXN	07/31/2023	(152,000)	16.93	2,574,066
2023071403633	BO	USDMXN	07/31/2023	250,000	16.78	(4,195,635)
2023072003394	S	USDMXN	07/31/2023	(200,000)	16.88	3,376,258
2023072603567	SO	USDMXN	07/31/2023	(5,000,000)	16.83	84,166,500
2023072703197	BON	USDMXN	07/31/2023	200,000,000	18.47	(3,694,840,000)
2023072703200	BO	USDMXN	07/31/2023	0	16.76	(343,100,000)
2023072703203	BO	USDMXN	07/31/2023	0	16.76	(73,800,000)
2023072703202	BON	USDMXN	07/31/2023	200,000,000	17.16	(3,431,500,000)
2023072703619	B	USDMXN	07/31/2023	1,000,000	16.84	(16,844,070)
2023072703201	SO	USDMXN	07/31/2023	0	16.76	342,140,000
2023072703198	SON	USDMXN	07/31/2023	(200,000,000)	18.48	3,695,800,000
2023072703199	SON	USDMXN	07/31/2023	(200,000,000)	17.13	3,426,500,000
2023072703204	SO	USDMXN	07/31/2023	0	16.76	78,800,000
2023072703399	S	USDMXN	07/31/2023	(1,000,000)	16.74	16,740,000
2023072703432	S	USDMXN	07/31/2023	(1,000,000)	16.77	16,767,450
2023072803189	S	USDMXN	07/31/2023	(4,000,000)	16.66	66,642,900
2022111503357	B	USDMXN	08/01/2023	3,900,000	20.31	(79,191,633)
2023030903543	BO	USDMXN	08/01/2023	50,000	18.56	(927,785)
2023040503434	BO	USDMXN	08/01/2023	150,000	18.52	(2,777,582)
2023041003222	B	USDMXN	08/01/2023	153,846	18.58	(2,858,160)
2023050203383	B	USDMXN	08/01/2023	81,818	18.34	(1,500,709)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023050503421	BO	USDMXN	08/01/2023	95,238	18.07	(1,720,764)
2023060903686	B	USDMXN	08/01/2023	2,000,000	17.45	(34,896,290)
2023071203335	BO	USDMXN	08/01/2023	20,000	16.88	(337,535)
2023071403670	SO	USDMXN	08/01/2023	(290,000)	16.77	4,863,791
2023072803099	B	USDMXN	08/01/2023	1,000,000	16.63	(16,632,750)
2023072803109	B	USDMXN	08/01/2023	1,000,000	16.63	(16,634,600)
2023072803190	B	USDMXN	08/01/2023	4,000,000	16.66	(66,654,400)
2023072803436	B	USDMXN	08/01/2023	1,000,000	16.69	(16,690,000)
2023072803554	B	USDMXN	08/01/2023	738,555	16.70	(12,333,417)
2023072803556	B	USDMXN	08/01/2023	1,340,262	16.70	(22,381,303)
2023072803124	S	USDMXN	08/01/2023	(628,500)	16.64	10,457,109
2023072803174	S	USDMXN	08/01/2023	(1,371,500)	16.67	22,856,048
2023072803291	S	USDMXN	08/01/2023	(1,000,000)	16.69	16,694,830
2023072803638	S	USDMXN	08/01/2023	(78,817)	16.68	1,314,778
2023072803723	S	USDMXN	08/01/2023	(273,120)	16.67	4,552,665
2023072803725	S	USDMXN	08/01/2023	(54,000)	16.67	900,222
2023072803727	S	USDMXN	08/01/2023	(54,000)	16.67	900,229
2023072803729	S	USDMXN	08/01/2023	(108,000)	16.67	1,800,511
2023072803731	S	USDMXN	08/01/2023	(108,000)	16.67	1,800,511
2023072803733	S	USDMXN	08/01/2023	(108,000)	16.67	1,800,511
2023072803776	S	USDMXN	08/01/2023	(1,800,000)	16.68	30,028,860
2023080103510	B	USDMXN	08/01/2023	20,000,000	16.88	(337,500,000)
2022091303248	SO	USDMXN	08/02/2023	(216,836)	21.22	4,601,216
2022092703347	SO	USDMXN	08/02/2023	(213,616)	21.56	4,604,848
2022101203328	SO	USDMXN	08/02/2023	(217,504)	21.09	4,586,780
2023050503495	BO	USDMXN	08/02/2023	100,000	18.10	(1,810,276)
2023060703388	BO	USDMXN	08/02/2023	158,400	17.55	(2,780,380)
2023062103331	BO	USDMXN	08/02/2023	151,468	17.30	(2,620,743)
2023062103336	BO	USDMXN	08/02/2023	15,232	17.27	(263,020)
2023062303337	B	USDMXN	08/02/2023	164,400	17.30	(2,844,369)
2023062703433	BO	USDMXN	08/02/2023	40,000	17.22	(688,756)
2023063003839	BO	USDMXN	08/02/2023	77,100	17.23	(1,328,214)
2023070503658	BO	USDMXN	08/02/2023	123,200	17.10	(2,106,419)
2023070703167	BO	USDMXN	08/02/2023	93,600	17.18	(1,608,206)
2023070703668	BO	USDMXN	08/02/2023	59,200	17.22	(1,019,487)
2023071103236	BO	USDMXN	08/02/2023	68,008	17.15	(1,166,479)
2023071103423	B	USDMXN	08/02/2023	114,000	17.11	(1,950,846)
2023071103527	BO	USDMXN	08/02/2023	107,200	17.12	(1,835,623)
2023071303629	BO	USDMXN	08/02/2023	287,200	16.89	(4,852,218)
2023071403459	BO	USDMXN	08/02/2023	48,614	16.83	(818,078)
2023071703434	BO	USDMXN	08/02/2023	88,792	16.80	(1,492,134)
2023071803594	BO	USDMXN	08/02/2023	17,800	16.79	(298,906)
2023071903361	B	USDMXN	08/02/2023	60,000	16.79	(1,007,555)
2023072403600	BO	USDMXN	08/02/2023	335,192	16.87	(5,653,641)
2023072403662	BO	USDMXN	08/02/2023	287,832	16.86	(4,853,069)
2023072603302	B	USDMXN	08/02/2023	145,912	16.89	(2,464,979)
2023073103061	B	USDMXN	08/02/2023	1,000,000	16.70	(16,699,180)
2023073103543	B	USDMXN	08/02/2023	178,268	16.74	(2,983,320)
2023073103545	B	USDMXN	08/02/2023	851,600	16.73	(14,249,067)
2023073103165	S	USDMXN	08/02/2023	(1,000,000)	16.73	16,731,600
2023073103187	S	USDMXN	08/02/2023	(13,500,000)	16.73	225,906,300
2023073103201	S	USDMXN	08/02/2023	(13,500,000)	16.74	226,041,300
2023073103209	S	USDMXN	08/02/2023	(250,000)	16.74	4,184,963
2023073103211	S	USDMXN	08/02/2023	(300,000)	16.74	5,022,210
2023073103214	S	USDMXN	08/02/2023	(300,000)	16.74	5,022,180
2023073103432	S	USDMXN	08/02/2023	(25,000,000)	16.73	418,371,750
2023073103437	S	USDMXN	08/02/2023	(25,000,000)	16.74	418,397,500
2023073103442	S	USDMXN	08/02/2023	(4,400,000)	16.74	73,651,600
2023080103107	S	USDMXN	08/02/2023	(250,000)	16.77	4,192,239



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023080103511	S	USDMXN	08/02/2023	(20,000,000)	16.88	337,555,000
2022080303073	S	USDMXN	08/03/2023	(10,000,000)	22.05	220,548,330
2022080803285	B	USDMXN	08/03/2023	10,000,000	21.59	(215,933,300)
2022080803439	BO	USDMXN	08/03/2023	250,000	21.61	(5,403,535)
2022120103194	B	USDMXN	08/03/2023	1,451,977	20.00	(29,036,166)
2023010603701	B	USDMXN	08/03/2023	6,223,700	19.89	(123,791,970)
2023030203462	BO	USDMXN	08/03/2023	100,000	18.64	(1,864,253)
2023032703605	BO	USDMXN	08/03/2023	30,071	18.82	(566,057)
2023032903540	BO	USDMXN	08/03/2023	25,000	18.55	(463,678)
2023051503821	BO	USDMXN	08/03/2023	30,071	17.74	(533,342)
2023051903261	BO	USDMXN	08/03/2023	3,298	17.98	(59,280)
2023061603459	BO	USDMXN	08/03/2023	60,000	17.24	(1,034,656)
2023062303327	BO	USDMXN	08/03/2023	26,208	17.31	(453,673)
2023062603477	S	USDMXN	08/03/2023	(250,000)	17.25	4,312,549
2023062703514	B	USDMXN	08/03/2023	60,000	17.21	(1,032,577)
2023070303202	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.16	(10,782,192)
2023070403308	B	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.14	(10,771,785)
2023070503354	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.08	(10,736,901)
2023070503532	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.13	(10,766,939)
2023070603509	BO	USDMXN	08/03/2023	628,000	17.43	(10,945,974)
2023070603549	BO	USDMXN	08/03/2023	500	17.34	(8,670)
2023071003498	B	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.11	(10,755,483)
2023071003519	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.12	(10,757,557)
2023071003621	BO	USDMXN	08/03/2023	20,000	17.13	(342,685)
2023071103152	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.15	(10,777,059)
2023071103327	BO	USDMXN	08/03/2023	628,500	17.13	(10,766,450)
2023071303534	B	USDMXN	08/03/2023	13,500,000	16.89	(227,967,858)
2023071303561	BO	USDMXN	08/03/2023	628,000	16.92	(10,622,626)
2023071303568	BO	USDMXN	08/03/2023	7,243	16.90	(122,393)
2023071403671	SO	USDMXN	08/03/2023	(135,000)	16.78	2,265,046
2023072703366	BO	USDMXN	08/03/2023	12,095	16.74	(202,500)
2023080103014	B	USDMXN	08/03/2023	1,000,000	16.78	(16,777,560)
2023080103032	B	USDMXN	08/03/2023	1,000,000	16.76	(16,763,260)
2023080103098	B	USDMXN	08/03/2023	1,000,000	16.79	(16,793,470)
2023080103122	B	USDMXN	08/03/2023	2,000,000	16.80	(33,609,720)
2023080103282	B	USDMXN	08/03/2023	5,000,000	16.88	(84,400,000)
2023080103357	B	USDMXN	08/03/2023	1,000,000	16.86	(16,860,800)
2023080103359	B	USDMXN	08/03/2023	1,000,000	16.86	(16,862,280)
2023080103494	B	USDMXN	08/03/2023	2,000,000	16.88	(33,760,000)
2023080103017	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.75	16,750,110
2023080103033	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.78	16,780,000
2023080103039	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.81	16,811,720
2023080103117	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.79	16,792,600
2023080103138	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.81	16,810,000
2023080103169	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.85	16,845,960
2023080103285	S	USDMXN	08/03/2023	(5,000,000)	16.89	84,448,750
2023080103317	S	USDMXN	08/03/2023	(2,320)	16.90	39,200
2023080103370	S	USDMXN	08/03/2023	(2,000,000)	16.89	33,770,000
2023080103400	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.89	16,886,910
2023080103455	S	USDMXN	08/03/2023	(1,000,000)	16.89	16,893,520
2023080103519	S	USDMXN	08/03/2023	(500)	16.86	8,432
2022050603511	SO	USDMXN	08/04/2023	(158,750)	21.84	3,467,195
2022082503552	BO	USDMXN	08/04/2023	130,000	21.32	(2,772,199)
2023011103358	BO	USDMXN	08/04/2023	100,000	19.74	(1,974,442)
2023012003458	BO	USDMXN	08/04/2023	139,845	19.55	(2,734,254)
2023012003540	SO	USDMXN	08/04/2023	(139,845)	19.56	2,735,003
2023041703186	BO	USDMXN	08/04/2023	250,000	18.38	(4,594,773)
2023051503634	BO	USDMXN	08/04/2023	50,000	17.73	(886,735)
2023060103505	BO	USDMXN	08/04/2023	250,000	17.78	(4,445,046)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060703226	BO	USDMXN	08/04/2023	569,000	17.56	(9,991,113)
2023061603178	BO	USDMXN	08/04/2023	70,000	17.26	(1,208,280)
2023071703427	SO	USDMXN	08/04/2023	(290,000)	16.87	4,892,895
2023071703516	SO	USDMXN	08/04/2023	(7,000)	16.79	117,514
2023072103069	BO	USDMXN	08/04/2023	46,000	16.96	(780,251)
2023072603451	BO	USDMXN	08/04/2023	30,000	16.91	(507,246)
2023080203038	B	USDMXN	08/04/2023	1,000,000	17.00	(16,997,710)
2023080203045	B	USDMXN	08/04/2023	1,000,000	16.98	(16,980,300)
2023080203227	B	USDMXN	08/04/2023	1,000,000	17.06	(17,058,260)
2023080203252	B	USDMXN	08/04/2023	1,000,000	17.02	(17,023,370)
2023080203402	B	USDMXN	08/04/2023	156,387	17.01	(2,659,633)
2023080203423	B	USDMXN	08/04/2023	500,000	17.01	(8,503,700)
2023080203459	B	USDMXN	08/04/2023	454,841	17.00	(7,734,389)
2023080203086	S	USDMXN	08/04/2023	(2,000,000)	17.01	34,020,000
2023080203181	S	USDMXN	08/04/2023	(1,000,000)	17.04	17,044,360
2023080203299	S	USDMXN	08/04/2023	(1,000,000)	17.01	17,009,670
2023080203377	S	USDMXN	08/04/2023	(3,000,000)	16.99	50,976,840
2023080203379	S	USDMXN	08/04/2023	(4,000,000)	17.00	67,998,840
2023080203389	S	USDMXN	08/04/2023	(372,507)	17.00	6,334,428
2023080203399	S	USDMXN	08/04/2023	(138,940)	17.00	2,362,529
2023080203455	S	USDMXN	08/04/2023	(99,781)	17.01	1,696,892
2023080303530	B	USDMXN	08/04/2023	7,000,000	17.30	(121,105,338)
2023071903514	SO	USDMXN	08/07/2023	(67,000)	16.79	1,124,783
2023072003390	SO	USDMXN	08/07/2023	(142,000)	16.90	2,399,259
2023080103106	BO	USDMXN	08/07/2023	88,464	16.79	(1,485,670)
2023080303179	B	USDMXN	08/07/2023	1,000,000	17.32	(17,315,950)
2023080303180	B	USDMXN	08/07/2023	1,000,000	17.31	(17,311,840)
2023080303340	B	USDMXN	08/07/2023	1,000,000	17.28	(17,278,400)
2023080303342	B	USDMXN	08/07/2023	500,000	17.28	(8,637,900)
2023080303346	B	USDMXN	08/07/2023	1,000,000	17.27	(17,266,800)
2023080303370	B	USDMXN	08/07/2023	600,000	17.28	(10,365,780)
2023080303372	B	USDMXN	08/07/2023	600,000	17.28	(10,365,480)
2023080303374	B	USDMXN	08/07/2023	600,000	17.28	(10,365,660)
2023080303604	B	USDMXN	08/07/2023	110,000	17.27	(1,899,678)
2023080303075	S	USDMXN	08/07/2023	(1,000,000)	17.36	17,360,000
2023080303227	S	USDMXN	08/07/2023	(2,000,000)	17.34	34,680,000
2023080303386	S	USDMXN	08/07/2023	(1,000,000)	17.30	17,300,000
2023080303393	S	USDMXN	08/07/2023	(575,000)	17.30	9,945,660
2023080303395	S	USDMXN	08/07/2023	(980)	17.30	16,951
2023011203105	B	USDMXN	08/08/2023	1,620,784	19.63	(31,817,547)
2023040503436	BO	USDMXN	08/08/2023	150,000	18.54	(2,781,401)
2023041003224	B	USDMXN	08/08/2023	153,846	18.61	(2,862,312)
2023050203385	B	USDMXN	08/08/2023	81,818	18.37	(1,502,784)
2023050503422	BO	USDMXN	08/08/2023	95,238	18.09	(1,723,173)
2023050503496	BO	USDMXN	08/08/2023	100,000	18.12	(1,812,461)
2023071103237	BO	USDMXN	08/08/2023	34,048	17.17	(584,665)
2023072003526	SO	USDMXN	08/08/2023	(290,000)	16.93	4,911,094
2023072603372	B	USDMXN	08/08/2023	2,000,000	16.92	(33,836,466)
2023080303531	S	USDMXN	08/08/2023	(7,000,000)	17.31	121,183,755
2023080403059	B	USDMXN	08/08/2023	1,000,000	17.08	(17,075,650)
2023080403063	B	USDMXN	08/08/2023	1,000,000	17.07	(17,070,970)
2023080403068	B	USDMXN	08/08/2023	1,000,000	17.07	(17,070,830)
2023080403356	B	USDMXN	08/08/2023	580,650	17.05	(9,901,981)
2023080403386	B	USDMXN	08/08/2023	25,000	17.07	(426,635)
2023080403396	B	USDMXN	08/08/2023	324,479	17.06	(5,534,739)
2023080403398	B	USDMXN	08/08/2023	117,936	17.06	(2,011,674)
2023080403198	S	USDMXN	08/08/2023	(1,000,000)	17.04	17,040,000
2023080403204	S	USDMXN	08/08/2023	(2,000,000)	17.05	34,100,000
2023080403338	S	USDMXN	08/08/2023	(500,000)	17.06	8,528,650

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023080403340	S	USDMXN	08/08/2023	(500,000)	17.06	8,528,600
2023080403342	S	USDMXN	08/08/2023	(500,000)	17.06	8,528,800
2023080403394	S	USDMXN	08/08/2023	(1,023,065)	17.05	17,438,245
2023080403405	S	USDMXN	08/08/2023	(25,000)	17.06	426,427
2023080403554	S	USDMXN	08/08/2023	(187,000)	17.09	3,196,316
2023080403556	S	USDMXN	08/08/2023	(187,000)	17.09	3,196,447
2023080403558	S	USDMXN	08/08/2023	(190,000)	17.09	3,247,518
2019080703110	SO	USDMXN	08/09/2023	(10,000)	24.31	243,100
2022081203470	B	USDMXN	08/09/2023	3,000,000	21.20	(63,593,430)
2022081703400	B	USDMXN	08/09/2023	1,555,000	21.40	(33,278,903)
2022122803074	BO	USDMXN	08/09/2023	990,000	20.22	(20,016,104)
2023011003484	B	USDMXN	08/09/2023	1,000,000	19.83	(19,825,066)
2023011103548	BO	USDMXN	08/09/2023	500,000	19.69	(9,845,326)
2023021703443	B	USDMXN	08/09/2023	500,000	18.98	(9,489,162)
2023050503738	B	USDMXN	08/09/2023	61,500	18.12	(1,114,152)
2023050803627	B	USDMXN	08/09/2023	500,000	18.11	(9,057,109)
2023060903330	BO	USDMXN	08/09/2023	100,000	17.47	(1,747,485)
2023062103337	BO	USDMXN	08/09/2023	97,300	17.29	(1,682,431)
2023062303336	B	USDMXN	08/09/2023	80,000	17.32	(1,385,948)
2023062703332	BO	USDMXN	08/09/2023	15,200	17.25	(262,206)
2023062803457	BO	USDMXN	08/09/2023	109,600	17.20	(1,884,701)
2023070603651	BO	USDMXN	08/09/2023	76,950	17.34	(1,334,419)
2023070703168	BO	USDMXN	08/09/2023	93,600	17.20	(1,610,346)
2023070703626	BO	USDMXN	08/09/2023	70,000	17.23	(1,206,084)
2023070703669	BO	USDMXN	08/09/2023	59,200	17.25	(1,020,919)
2023071103023	BO	USDMXN	08/09/2023	41,600	17.16	(713,959)
2023071103338	BO	USDMXN	08/09/2023	41,600	17.16	(713,933)
2023071103425	B	USDMXN	08/09/2023	17,200	17.14	(294,729)
2023071103357	SO	USDMXN	08/09/2023	(41,600)	17.16	713,725
2023071203636	BO	USDMXN	08/09/2023	30,600	16.97	(519,427)
2023071303630	BO	USDMXN	08/09/2023	116,000	16.92	(1,962,413)
2023071403458	BO	USDMXN	08/09/2023	48,614	16.85	(819,176)
2023071803605	BO	USDMXN	08/09/2023	34,800	16.82	(585,277)
2023071903363	B	USDMXN	08/09/2023	40,000	16.82	(672,621)
2023072603304	B	USDMXN	08/09/2023	36,000	16.92	(608,979)
2023072803724	B	USDMXN	08/09/2023	273,120	16.69	(4,559,174)
2023080203011	BO	USDMXN	08/09/2023	25,600	17.03	(435,842)
2023080703072	B	USDMXN	08/09/2023	1,000,000	17.04	(17,044,780)
2023080703098	B	USDMXN	08/09/2023	9,000,000	17.06	(153,536,400)
2023080703205	B	USDMXN	08/09/2023	1,000,000	17.05	(17,050,000)
2023080703253	B	USDMXN	08/09/2023	1,000,000	17.06	(17,060,000)
2023080703278	B	USDMXN	08/09/2023	2,000,000	17.04	(34,080,000)
2023080703080	S	USDMXN	08/09/2023	(425,000)	17.05	7,244,937
2023080703082	S	USDMXN	08/09/2023	(575,000)	17.06	9,806,970
2023080703092	S	USDMXN	08/09/2023	(1,000,000)	17.06	17,064,520
2023080703094	S	USDMXN	08/09/2023	(1,000,000)	17.07	17,072,220
2023080703286	S	USDMXN	08/09/2023	(575,000)	17.04	9,798,748
2023080703289	S	USDMXN	08/09/2023	(300,000)	17.04	5,111,850
2023080703347	S	USDMXN	08/09/2023	(2,000,000)	17.05	34,104,200
2023080703386	S	USDMXN	08/09/2023	(1,125,000)	17.04	19,174,680
2022092903200	SO	USDMXN	08/10/2023	(248,500)	21.33	5,299,949
2022101203329	SO	USDMXN	08/10/2023	(250,342)	21.12	5,287,888
2022102503606	S	USDMXN	08/10/2023	(253,020)	20.97	5,305,281
2022120103192	B	USDMXN	08/10/2023	1,451,977	20.02	(29,073,722)
2023030203463	BO	USDMXN	08/10/2023	100,000	18.67	(1,866,766)
2023032703606	BO	USDMXN	08/10/2023	30,071	18.85	(566,891)
2023032903530	BO	USDMXN	08/10/2023	222,200	18.58	(4,129,377)
2023051503823	BO	USDMXN	08/10/2023	30,071	17.76	(534,102)
2023060903183	BO	USDMXN	08/10/2023	52,800	17.51	(924,713)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023061603458	BO	USDMXN	08/10/2023	60,000	17.27	(1,036,072)
2023062703516	B	USDMXN	08/10/2023	60,000	17.23	(1,033,986)
2023071003622	BO	USDMXN	08/10/2023	20,000	17.16	(343,132)
2023071303532	B	USDMXN	08/10/2023	13,500,000	16.91	(228,291,450)
2023071803608	BO	USDMXN	08/10/2023	28,045	16.82	(471,676)
2023072003527	SO	USDMXN	08/10/2023	(259,174)	16.94	4,390,743
2023072703671	BO	USDMXN	08/10/2023	31,316	16.88	(528,533)
2023072803799	BO	USDMXN	08/10/2023	39,421	16.72	(659,030)
2023073103546	BO	USDMXN	08/10/2023	21,252	16.76	(356,100)
2023073103769	BO	USDMXN	08/10/2023	53,034	16.76	(888,932)
2023073103780	SO	USDMXN	08/10/2023	(20,000)	16.77	335,358
2023080103015	BO	USDMXN	08/10/2023	32,965	16.80	(553,772)
2023080203264	BO	USDMXN	08/10/2023	23,106	17.04	(393,780)
2023080303187	BO	USDMXN	08/10/2023	21,976	17.33	(380,841)
2023080303558	BO	USDMXN	08/10/2023	14,188	17.30	(245,391)
2023080703348	B	USDMXN	08/10/2023	2,000,000	17.06	(34,110,125)
2023080703099	S	USDMXN	08/10/2023	(9,000,000)	17.06	153,562,298
2023080803018	B	USDMXN	08/10/2023	7,000,000	17.21	(120,500,100)
2023080803050	B	USDMXN	08/10/2023	3,000,000	17.26	(51,775,920)
2023080803064	B	USDMXN	08/10/2023	2,000,000	17.24	(34,471,360)
2023080803235	S	USDMXN	08/10/2023	(3,000,000)	17.17	51,507,510
2023080803237	S	USDMXN	08/10/2023	(3,000,000)	17.17	51,505,620
2023080803407	S	USDMXN	08/10/2023	(575,000)	17.09	9,825,025
2023080803590	S	USDMXN	08/10/2023	(53,200)	17.12	910,548
2023080803592	S	USDMXN	08/10/2023	(471,696)	17.11	8,071,261
2023080803595	S	USDMXN	08/10/2023	(45,145)	17.11	772,325
2022051303490	S	USDMXN	08/11/2023	(158,750)	21.94	3,482,994
2023011103356	BO	USDMXN	08/11/2023	100,000	19.77	(1,976,942)
2023030103060	BO	USDMXN	08/11/2023	300,000	18.80	(5,639,818)
2023041703185	BO	USDMXN	08/11/2023	250,000	18.40	(4,601,190)
2023060503297	BO	USDMXN	08/11/2023	50,000	17.70	(885,053)
2023062903378	B	USDMXN	08/11/2023	600,000	17.25	(10,351,543)
2023072103526	SO	USDMXN	08/11/2023	(297,000)	17.00	5,050,116
2023080303371	S	USDMXN	08/11/2023	(600,000)	17.29	10,372,368
2023080803019	S	USDMXN	08/11/2023	(7,000,000)	17.22	120,519,490
2023080903014	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.11	(17,111,250)
2023080903040	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.09	(17,086,150)
2023080903152	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.08	(17,080,000)
2023080903156	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.08	(17,083,970)
2023080903485	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.06	(17,060,700)
2023080903558	B	USDMXN	08/11/2023	1,000,000	17.06	(17,064,520)
2023080903115	S	USDMXN	08/11/2023	(1,000,000)	17.07	17,069,590
2023080903117	S	USDMXN	08/11/2023	(425,000)	17.07	7,256,212
2023080903126	S	USDMXN	08/11/2023	(575,000)	17.09	9,823,933
2023080903132	S	USDMXN	08/11/2023	(1,000,000)	17.10	17,101,710
2023080903192	S	USDMXN	08/11/2023	(1,000,000)	17.05	17,053,290
2023080903292	S	USDMXN	08/11/2023	(350,000)	17.05	5,968,725
2023080903296	S	USDMXN	08/11/2023	(1,200,000)	17.06	20,466,480
2023080903302	S	USDMXN	08/11/2023	(250,000)	17.06	4,264,475
2023080903406	S	USDMXN	08/11/2023	(369,330)	17.05	6,297,893
2023080903408	S	USDMXN	08/11/2023	(196,102)	17.05	3,344,447
2023080903520	S	USDMXN	08/11/2023	(1,000,000)	17.07	17,065,000
2023072503272	SO	USDMXN	08/14/2023	(142,000)	16.96	2,408,153
2023072603400	BO	USDMXN	08/14/2023	10,000	16.95	(169,469)
2023072603531	SO	USDMXN	08/14/2023	(161,000)	16.91	2,721,885
2023080703290	B	USDMXN	08/14/2023	300,000	17.05	(5,116,404)
2023081003091	B	USDMXN	08/14/2023	1,000,000	16.92	(16,920,000)
2023081003221	B	USDMXN	08/14/2023	300,000	16.93	(5,079,000)
2023081003410	B	USDMXN	08/14/2023	575,000	17.01	(9,778,301)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023081003597	B	USDMXN	08/14/2023	4,000,000	17.05	(68,182,000)
2023081003013	S	USDMXN	08/14/2023	(15,000,000)	16.96	254,445,000
2023081003073	S	USDMXN	08/14/2023	(2,000,000)	16.95	33,900,000
2023081003112	S	USDMXN	08/14/2023	(1,000,000)	16.95	16,950,000
2023081003183	S	USDMXN	08/14/2023	(15,000,000)	16.94	254,044,500
2023081003231	S	USDMXN	08/14/2023	(400,000)	16.94	6,776,360
2023081003242	S	USDMXN	08/14/2023	(100,000)	16.94	1,693,962
2023081003246	S	USDMXN	08/14/2023	(550,000)	16.94	9,317,567
2023081003250	S	USDMXN	08/14/2023	(575,000)	16.95	9,744,468
2023081003420	S	USDMXN	08/14/2023	(575,000)	16.99	9,768,790
2023081003536	S	USDMXN	08/14/2023	(1,000,000)	17.00	17,001,810
2023081003564	S	USDMXN	08/14/2023	(1,000,000)	16.99	16,990,000
2023081003567	S	USDMXN	08/14/2023	(1,000,000)	17.00	16,999,870
2023081003573	S	USDMXN	08/14/2023	(1,000,000)	17.01	17,007,920
2023011103427	BO	USDMXN	08/15/2023	407,473	19.72	(8,034,970)
2023021303192	BO	USDMXN	08/15/2023	407,473	19.31	(7,869,707)
2023031003608	SO	USDMXN	08/15/2023	(175,000)	19.05	3,334,112
2023031403112	SO	USDMXN	08/15/2023	(175,000)	19.66	3,441,236
2023040503437	BO	USDMXN	08/15/2023	150,000	18.57	(2,785,318)
2023041003226	B	USDMXN	08/15/2023	153,846	18.63	(2,866,407)
2023042803535	B	USDMXN	08/15/2023	100,000	18.39	(1,838,780)
2023050203387	B	USDMXN	08/15/2023	81,818	18.39	(1,504,851)
2023050503423	BO	USDMXN	08/15/2023	95,238	18.12	(1,725,533)
2023051503674	BO	USDMXN	08/15/2023	50,000	17.83	(891,283)
2023072603374	B	USDMXN	08/15/2023	2,000,000	16.94	(33,880,958)
2023072703674	SO	USDMXN	08/15/2023	(290,000)	16.88	4,895,292
2023081403450	B	USDMXN	08/15/2023	9,000,000	17.04	(153,404,438)
2022013103147	B	USDMXN	08/16/2023	642,443	22.93	(14,729,741)
2022070603466	SO	USDMXN	08/16/2023	(905)	22.31	20,200
2022091303286	S	USDMXN	08/16/2023	(216,206)	21.26	4,595,790
2022092703348	SO	USDMXN	08/16/2023	(212,776)	21.61	4,598,232
2022110103543	S	USDMXN	08/16/2023	(48,276)	20.76	1,001,973
2022110103553	SO	USDMXN	08/16/2023	(124,577)	20.76	2,586,204
2022111503646	B	USDMXN	08/16/2023	376,195	20.34	(7,651,763)
2022111703242	BO	USDMXN	08/16/2023	956,018	20.42	(19,519,980)
2022111703762	B	USDMXN	08/16/2023	1,602,988	20.40	(32,694,643)
2022111803526	B	USDMXN	08/16/2023	296,802	20.45	(6,068,554)
2022112903727	B	USDMXN	08/16/2023	99,114	20.17	(1,999,494)
2023010403591	BO	USDMXN	08/16/2023	545,712	20.19	(11,018,805)
2023011903683	BO	USDMXN	08/16/2023	39,688	19.79	(785,398)
2023012603547	B	USDMXN	08/16/2023	434,650	19.52	(8,483,623)
2023020103656	B	USDMXN	08/16/2023	59,370	19.30	(1,145,821)
2023021003698	BO	USDMXN	08/16/2023	1,034,574	19.34	(20,013,738)
2023022103718	BO	USDMXN	08/16/2023	124,493	19.09	(2,376,508)
2023022103408	S	USDMXN	08/16/2023	(2,500,000)	19.04	47,611,383
2023022103545	SO	USDMXN	08/16/2023	(1,000,000)	19.05	19,047,675
2023032903473	BO	USDMXN	08/16/2023	65,006	18.59	(1,208,764)
2023041303254	B	USDMXN	08/16/2023	254,723	18.46	(4,702,947)
2023042003527	B	USDMXN	08/16/2023	173,603	18.46	(3,205,094)
2023050903486	B	USDMXN	08/16/2023	4,126,269	18.11	(74,706,634)
2023051603621	B	USDMXN	08/16/2023	4,980,570	17.78	(88,573,191)
2023051703575	BO	USDMXN	08/16/2023	82,052	17.88	(1,467,055)
2023060803552	B	USDMXN	08/16/2023	52,800	17.61	(929,719)
2023061503629	S	USDMXN	08/16/2023	(1,850,206)	17.30	32,008,296
2023061503633	S	USDMXN	08/16/2023	(78,923)	17.30	1,365,327
2023062303528	S	USDMXN	08/16/2023	(116,745)	17.33	2,023,311
2023062703413	B	USDMXN	08/16/2023	3,540,411	17.27	(61,136,362)
2023062803355	BO	USDMXN	08/16/2023	64,000	17.22	(1,102,274)
2023070503376	B	USDMXN	08/16/2023	1,250,000	17.13	(21,410,091)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023070603522	BO	USDMXN	08/16/2023	55,000	17.43	(958,449)
2023070603550	BO	USDMXN	08/16/2023	600	17.38	(10,430)
2023071103024	BO	USDMXN	08/16/2023	50,200	17.19	(862,719)
2023071103340	BO	USDMXN	08/16/2023	50,200	17.19	(862,720)
2023071103372	B	USDMXN	08/16/2023	59,200	17.17	(1,016,552)
2023071103528	BO	USDMXN	08/16/2023	50,000	17.17	(858,535)
2023071103358	SO	USDMXN	08/16/2023	(50,200)	17.18	862,436
2023071203568	BO	USDMXN	08/16/2023	94,400	16.99	(1,604,118)
2023071203637	BO	USDMXN	08/16/2023	19,400	17.00	(329,774)
2023071303631	BO	USDMXN	08/16/2023	48,800	16.94	(826,647)
2023071403460	BO	USDMXN	08/16/2023	48,614	16.87	(820,284)
2023071403822	BO	USDMXN	08/16/2023	36,500	16.90	(616,777)
2023072403380	BO	USDMXN	08/16/2023	82,600	16.89	(1,395,316)
2023072503493	S	USDMXN	08/16/2023	(4,368,414)	16.98	74,165,005
2023072503496	S	USDMXN	08/16/2023	(4,402,987)	16.97	74,738,315
2023072503503	S	USDMXN	08/16/2023	(3,514,303)	16.98	59,661,678
2023072803181	BO	USDMXN	08/16/2023	238,000	16.69	(3,971,605)
2023072803539	B	USDMXN	08/16/2023	341,638	16.74	(5,720,198)
2023073103188	B	USDMXN	08/16/2023	13,500,000	16.77	(226,461,474)
2023080203029	BO	USDMXN	08/16/2023	120,800	17.04	(2,059,021)
2023080203460	S	USDMXN	08/16/2023	(454,841)	17.04	7,750,051
2023080403391	B	USDMXN	08/16/2023	1,840,944	17.07	(31,427,176)
2023080403395	B	USDMXN	08/16/2023	1,023,065	17.07	(17,463,108)
2023080403664	BO	USDMXN	08/16/2023	208,884	17.10	(3,571,851)
2023080803593	B	USDMXN	08/16/2023	471,696	17.13	(8,079,761)
2023080803246	S	USDMXN	08/16/2023	(3,000,000)	17.16	51,486,415
2023080903303	B	USDMXN	08/16/2023	250,000	17.07	(4,268,198)
2023080903407	B	USDMXN	08/16/2023	369,330	17.07	(6,303,375)
2023080903486	S	USDMXN	08/16/2023	(1,000,000)	17.07	17,074,607
2023080903527	SO	USDMXN	08/16/2023	(1,000)	17.08	17,077
2023081403067	B	USDMXN	08/16/2023	1,000,000	17.09	(17,093,450)
2023081403127	B	USDMXN	08/16/2023	1,000,000	17.07	(17,068,040)
2023081403263	B	USDMXN	08/16/2023	1,971,628	17.06	(33,635,974)
2023081403320	B	USDMXN	08/16/2023	28,372	17.06	(483,952)
2023081403446	B	USDMXN	08/16/2023	9,000,000	17.05	(153,410,850)
2023081403174	S	USDMXN	08/16/2023	(1,000,000)	17.09	17,085,680
2023081403222	S	USDMXN	08/16/2023	(1,000,000)	17.09	17,090,000
2023081403229	S	USDMXN	08/16/2023	(600,000)	17.09	10,254,000
2023081403232	S	USDMXN	08/16/2023	(400,000)	17.08	6,832,604
2023081403239	S	USDMXN	08/16/2023	(1,000,000)	17.09	17,090,000
2023081403437	S	USDMXN	08/16/2023	(13,500,000)	17.04	230,071,050
2023081403451	S	USDMXN	08/16/2023	(9,000,000)	17.05	153,429,300
2023081503008	SO	USDMXN	08/16/2023	(60,000,000)	17.10	1,026,174,000
2022081003392	BO	USDMXN	08/17/2023	2,555,000	21.38	(54,621,805)
2022081003403	B	USDMXN	08/17/2023	2,000,000	21.36	(42,726,626)
2022081203471	S	USDMXN	08/17/2023	(3,000,000)	21.22	63,664,305
2022081703401	S	USDMXN	08/17/2023	(1,555,000)	21.42	33,310,605
2022082203348	B	USDMXN	08/17/2023	250,000	21.62	(5,406,069)
2022120103189	B	USDMXN	08/17/2023	1,451,977	20.05	(29,109,802)
2023030203464	BO	USDMXN	08/17/2023	100,000	18.69	(1,869,318)
2023032703607	BO	USDMXN	08/17/2023	30,071	18.88	(567,724)
2023032903541	BO	USDMXN	08/17/2023	25,000	18.60	(464,982)
2023051503675	BO	USDMXN	08/17/2023	50,000	17.83	(891,644)
2023051503824	BO	USDMXN	08/17/2023	30,071	17.79	(534,862)
2023060603571	BO	USDMXN	08/17/2023	50,000	17.64	(882,164)
2023061603462	BO	USDMXN	08/17/2023	60,000	17.29	(1,037,488)
2023062603479	S	USDMXN	08/17/2023	(250,000)	17.30	4,324,105
2023062703518	B	USDMXN	08/17/2023	60,000	17.26	(1,035,377)
2023070503352	BO	USDMXN	08/17/2023	60,000	17.13	(1,027,763)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023071003623	BO	USDMXN	08/17/2023	20,000	17.18	(343,592)
2023071803607	BO	USDMXN	08/17/2023	22,010	16.84	(370,681)
2023072703672	BO	USDMXN	08/17/2023	14,348	16.90	(242,461)
2023080103244	SO	USDMXN	08/17/2023	(140,000)	16.89	2,365,094
2023080203266	BO	USDMXN	08/17/2023	18,564	17.07	(316,822)
2023080803410	BO	USDMXN	08/17/2023	13,938	17.11	(238,505)
2023080803589	BO	USDMXN	08/17/2023	17,094	17.14	(292,909)
2023081003527	BO	USDMXN	08/17/2023	12,954	17.01	(220,376)
2023081403438	B	USDMXN	08/17/2023	13,500,000	17.05	(230,110,099)
2023081503038	B	USDMXN	08/17/2023	2,000,000	17.18	(34,360,740)
2023081503114	B	USDMXN	08/17/2023	1,000,000	17.15	(17,145,880)
2023081503115	B	USDMXN	08/17/2023	1,000,000	17.15	(17,152,180)
2023081503133	B	USDMXN	08/17/2023	1,000,000	17.13	(17,129,070)
2023081503370	B	USDMXN	08/17/2023	1,000,000	17.13	(17,133,950)
2023081503534	B	USDMXN	08/17/2023	184,053	17.12	(3,150,708)
2023081503017	S	USDMXN	08/17/2023	(1,000,000)	17.14	17,142,010
2023081503018	S	USDMXN	08/17/2023	(1,000,000)	17.14	17,137,170
2023081503269	S	USDMXN	08/17/2023	(3,000,000)	17.12	51,360,000
2023081503280	S	USDMXN	08/17/2023	(1,000,000)	17.13	17,134,950
2023081503388	S	USDMXN	08/17/2023	(20,000,000)	17.12	342,400,000
2023081503504	S	USDMXN	08/17/2023	(5,000,000)	17.12	85,600,000
2023081503508	S	USDMXN	08/17/2023	(2,000,000)	17.12	34,240,000
2023081503543	S	USDMXN	08/17/2023	(184,071)	17.12	3,151,173
2023081603041	BO	USDMXN	08/17/2023	1,088	17.09	(18,593)
2023081603048	B	USDMXN	08/17/2023	7,000,000	17.06	(119,446,863)
2022052003379	SO	USDMXN	08/18/2023	(158,250)	21.65	3,425,518
2022052003381	SO	USDMXN	08/18/2023	(500)	21.67	10,837
2023011103357	BO	USDMXN	08/18/2023	100,000	19.79	(1,979,460)
2023021403479	B	USDMXN	08/18/2023	1,262,610	19.20	(24,238,147)
2023022103732	B	USDMXN	08/18/2023	2,000,000	19.11	(38,222,796)
2023030603317	BO	USDMXN	08/18/2023	124,017	18.59	(2,305,443)
2023041703187	BO	USDMXN	08/18/2023	250,000	18.43	(4,607,607)
2023050203709	BO	USDMXN	08/18/2023	133,000	18.36	(2,441,604)
2023060703150	BO	USDMXN	08/18/2023	100,000	17.61	(1,760,620)
2023070503418	B	USDMXN	08/18/2023	6,494,569	17.14	(111,342,288)
2023071003486	B	USDMXN	08/18/2023	7,399,639	17.16	(126,997,325)
2023071203424	B	USDMXN	08/18/2023	5,897,965	17.00	(100,237,561)
2023072503593	B	USDMXN	08/18/2023	11,037,261	16.99	(187,531,704)
2023080103216	SO	USDMXN	08/18/2023	(153,000)	16.82	2,572,883
2023080103218	SO	USDMXN	08/18/2023	(145,000)	16.82	2,438,355
2023081603019	B	USDMXN	08/18/2023	1,000,000	17.08	(17,076,600)
2023081603020	B	USDMXN	08/18/2023	1,000,000	17.08	(17,076,670)
2023081603021	B	USDMXN	08/18/2023	1,000,000	17.08	(17,080,590)
2023081603158	B	USDMXN	08/18/2023	2,000,000	17.05	(34,101,100)
2023081603353	B	USDMXN	08/18/2023	2,000,000	17.09	(34,173,860)
2023081603441	B	USDMXN	08/18/2023	5,000,000	17.08	(85,415,000)
2023081603444	B	USDMXN	08/18/2023	5,000,000	17.08	(85,415,000)
2023081603609	B	USDMXN	08/18/2023	10,000,000	17.16	(171,600,000)
2023081603623	B	USDMXN	08/18/2023	1,000,000	17.14	(17,139,980)
2023081603647	B	USDMXN	08/18/2023	1,000,000	17.14	(17,136,290)
2023081603069	S	USDMXN	08/18/2023	(1,000,000)	17.05	17,048,910
2023081603070	S	USDMXN	08/18/2023	(1,000,000)	17.05	17,050,330
2023081603110	S	USDMXN	08/18/2023	(1,000,000)	17.06	17,058,000
2023081603163	S	USDMXN	08/18/2023	(2,000,000)	17.03	34,067,880
2023081603671	S	USDMXN	08/18/2023	(1,000,000)	17.14	17,137,880
2023081703078	BO	USDMXN	08/18/2023	1,390	17.13	(23,814)
2023081803109	B	USDMXN	08/18/2023	100,000,000	17.06	(1,706,000,000)
2023081803111	B	USDMXN	08/18/2023	100,000,000	17.06	(1,706,000,000)
2023081803036	S	USDMXN	08/18/2023	(64,000,000)	17.06	1,091,840,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023081803040	S	USDMXN	08/18/2023	(64,000,000)	17.06	1,091,840,000
2023081803042	S	USDMXN	08/18/2023	(36,000,000)	17.06	614,160,000
2023081803046	S	USDMXN	08/18/2023	(36,000,000)	17.06	614,160,000
2023081803048	S	USDMXN	08/18/2023	(40,000,000)	17.06	682,400,000
2023081803052	S	USDMXN	08/18/2023	(100,000,000)	17.06	1,706,000,000
2023072103207	BO	USDMXN	08/21/2023	400,000	17.03	(6,811,254)
2023080103217	SO	USDMXN	08/21/2023	(142,000)	16.91	2,400,617
2023080303593	SO	USDMXN	08/21/2023	(152,000)	17.09	2,598,287
2023081403621	BO	USDMXN	08/21/2023	71,926	17.07	(1,227,720)
2023081703126	B	USDMXN	08/21/2023	1,000,000	17.13	(17,130,000)
2023081703155	B	USDMXN	08/21/2023	1,000,000	17.12	(17,117,720)
2023081703278	B	USDMXN	08/21/2023	1,000,000	17.09	(17,090,350)
2023081703313	B	USDMXN	08/21/2023	425,000	17.09	(7,264,759)
2023081703124	S	USDMXN	08/21/2023	(1,000,000)	17.15	17,153,400
2023081703186	S	USDMXN	08/21/2023	(1,000,000)	17.12	17,117,610
2023081703288	S	USDMXN	08/21/2023	(425,000)	17.09	7,264,223
2023081703291	S	USDMXN	08/21/2023	(575,000)	17.09	9,827,325
2023081703497	S	USDMXN	08/21/2023	(425,000)	17.14	7,285,809
2023081703693	S	USDMXN	08/21/2023	(300)	17.12	5,141
2023081803037	B	USDMXN	08/21/2023	64,000,000	17.07	(1,092,384,000)
2023081803041	B	USDMXN	08/21/2023	64,000,000	17.07	(1,092,384,000)
2023081803043	B	USDMXN	08/21/2023	36,000,000	17.07	(614,466,000)
2023081803047	B	USDMXN	08/21/2023	36,000,000	17.07	(614,466,000)
2023081803049	B	USDMXN	08/21/2023	40,000,000	17.07	(682,740,000)
2023081803053	B	USDMXN	08/21/2023	100,000,000	17.07	(1,706,850,000)
2023081803105	S	USDMXN	08/21/2023	(35,000,000)	17.06	596,960,000
2023081803110	S	USDMXN	08/21/2023	(100,000,000)	17.07	1,706,930,000
2023040503438	BO	USDMXN	08/22/2023	150,000	18.60	(2,789,307)
2023041003228	B	USDMXN	08/22/2023	153,846	18.66	(2,870,536)
2023050203389	B	USDMXN	08/22/2023	81,818	18.42	(1,506,918)
2023050503424	BO	USDMXN	08/22/2023	95,238	18.14	(1,727,884)
2023051503677	BO	USDMXN	08/22/2023	50,000	17.85	(892,555)
2023060103474	B	USDMXN	08/22/2023	400,000	17.84	(7,136,123)
2023072803777	B	USDMXN	08/22/2023	1,800,000	16.75	(30,142,557)
2023080403408	SO	USDMXN	08/22/2023	(138,000)	17.45	2,407,613
2023081803106	B	USDMXN	08/22/2023	35,000,000	17.06	(597,061,500)
2023081803135	B	USDMXN	08/22/2023	1,000,000	17.06	(17,058,730)
2023081803161	B	USDMXN	08/22/2023	1,000,000	17.06	(17,058,780)
2023081803243	B	USDMXN	08/22/2023	13,466,506	17.05	(229,603,930)
2023081803471	B	USDMXN	08/22/2023	25,000	17.05	(426,133)
2023081803479	B	USDMXN	08/22/2023	1,000,000	17.02	(17,023,400)
2023081803521	B	USDMXN	08/22/2023	200,000	17.03	(3,406,480)
2023081803112	S	USDMXN	08/22/2023	(100,000,000)	17.07	1,707,240,000
2023081803148	S	USDMXN	08/22/2023	(1,000,000)	17.06	17,060,820
2023081803237	S	USDMXN	08/22/2023	(1,000,000)	17.05	17,051,450
2023081803288	S	USDMXN	08/22/2023	(15,000,000)	17.05	255,780,000
2023081803570	S	USDMXN	08/22/2023	(27,290)	17.05	465,267
2023081803581	S	USDMXN	08/22/2023	(1,000,000)	17.06	17,060,000
2023082103101	B	USDMXN	08/22/2023	100,000,000	17.03	(1,703,000,000)
2023082103089	S	USDMXN	08/22/2023	(45,000,000)	17.04	766,710,000
2022082303369	B	USDMXN	08/23/2023	319,000	21.51	(6,860,299)
2022091303524	SO	USDMXN	08/23/2023	(319,000)	21.29	6,790,087
2023011203240	BO	USDMXN	08/23/2023	500,000	19.64	(9,822,440)
2023011703071	B	USDMXN	08/23/2023	500,000	19.56	(9,782,257)
2023021503483	BO	USDMXN	08/23/2023	500,000	19.30	(9,651,125)
2023051003238	B	USDMXN	08/23/2023	500,000	17.94	(8,967,714)
2023051503422	BO	USDMXN	08/23/2023	500,000	17.89	(8,943,327)
2023060803554	B	USDMXN	08/23/2023	52,800	17.63	(930,954)
2023070703169	BO	USDMXN	08/23/2023	55,600	17.25	(959,131)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023071103427	B	USDMXN	08/23/2023	97,600	17.18	(1,676,892)
2023071103505	BO	USDMXN	08/23/2023	110,000	17.20	(1,891,755)
2023071303632	BO	USDMXN	08/23/2023	22,800	16.96	(386,743)
2023071403461	BO	USDMXN	08/23/2023	48,614	16.90	(821,393)
2023071403635	BO	USDMXN	08/23/2023	125,300	16.86	(2,112,138)
2023071703432	BO	USDMXN	08/23/2023	191,800	16.87	(3,236,270)
2023071903365	B	USDMXN	08/23/2023	118,200	16.86	(1,992,958)
2023071903516	BO	USDMXN	08/23/2023	40,800	16.84	(687,270)
2023072403052	BO	USDMXN	08/23/2023	53,450	16.99	(908,290)
2023072403381	BO	USDMXN	08/23/2023	146,600	16.91	(2,479,682)
2023072503710	B	USDMXN	08/23/2023	155,350	17.01	(2,642,535)
2023072803182	BO	USDMXN	08/23/2023	232,000	16.71	(3,876,499)
2023073103202	B	USDMXN	08/23/2023	13,500,000	16.81	(226,882,715)
2023080203030	BO	USDMXN	08/23/2023	102,000	17.07	(1,741,038)
2023081403659	BO	USDMXN	08/23/2023	398,988	17.07	(6,811,048)
2023081403681	BO	USDMXN	08/23/2023	261,248	17.07	(4,458,952)
2023081803289	B	USDMXN	08/23/2023	15,000,000	17.05	(255,823,500)
2023081803244	S	USDMXN	08/23/2023	(13,464,216)	17.05	229,603,930
2023082103090	B	USDMXN	08/23/2023	45,000,000	17.04	(766,838,250)
2023082103113	B	USDMXN	08/23/2023	1,000,000	17.06	(17,055,080)
2023082103134	B	USDMXN	08/23/2023	2,000,000	17.04	(34,074,120)
2023082103199	B	USDMXN	08/23/2023	2,000,000	17.03	(34,063,140)
2023082103492	B	USDMXN	08/23/2023	1,000,000	17.01	(17,005,080)
2023082103494	B	USDMXN	08/23/2023	1,000,000	17.01	(17,006,360)
2023082103553	B	USDMXN	08/23/2023	500,000	17.01	(8,503,850)
2023082103049	S	USDMXN	08/23/2023	(11,000,000)	17.03	187,334,400
2023082103102	S	USDMXN	08/23/2023	(100,000,000)	17.03	1,703,310,000
2023082103104	S	USDMXN	08/23/2023	(1,000,000)	17.05	17,047,990
2023082103172	S	USDMXN	08/23/2023	(2,000,000)	17.04	34,082,800
2023082103212	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,512,050
2023082103214	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,512,050
2023082103220	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.03	8,513,300
2023082103221	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,512,100
2023082103224	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,512,415
2023082103226	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,512,320
2023082103228	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,511,410
2023082103439	S	USDMXN	08/23/2023	(350,000)	17.02	5,956,003
2023082103448	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,508,800
2023082103450	S	USDMXN	08/23/2023	(650,000)	17.02	11,061,635
2023082103453	S	USDMXN	08/23/2023	(500,000)	17.02	8,508,950
2023082103600	S	USDMXN	08/23/2023	(1,500,000)	17.01	25,508,550
2023082103606	S	USDMXN	08/23/2023	(200,000)	17.01	3,401,140
2023082103608	S	USDMXN	08/23/2023	(300,000)	17.01	5,101,740
2023082103623	S	USDMXN	08/23/2023	(15,000,000)	17.01	255,120,000
2023082203128	B	USDMXN	08/23/2023	100,000,000	16.90	(1,690,000,000)
2022092203543	SO	USDMXN	08/24/2023	(250,378)	21.16	5,298,297
2022101203332	SO	USDMXN	08/24/2023	(249,706)	21.18	5,289,738
2022102503608	S	USDMXN	08/24/2023	(252,391)	21.02	5,305,677
2022120103187	B	USDMXN	08/24/2023	1,451,977	20.07	(29,147,102)
2022122803075	BO	USDMXN	08/24/2023	990,000	20.27	(20,070,908)
2023022303145	BO	USDMXN	08/24/2023	4,400,000	19.01	(83,638,271)
2023022303191	SO	USDMXN	08/24/2023	(403,366)	19.02	7,671,170
2023030203465	BO	USDMXN	08/24/2023	100,000	18.72	(1,871,871)
2023032703608	BO	USDMXN	08/24/2023	30,071	18.91	(568,558)
2023042603467	BO	USDMXN	08/24/2023	5,700,000	18.52	(105,574,346)
2023042603470	BO	USDMXN	08/24/2023	21,380	18.52	(395,938)
2023051503826	BO	USDMXN	08/24/2023	30,071	17.81	(535,649)
2023060903319	BO	USDMXN	08/24/2023	50,000	17.60	(879,863)
2023061603461	BO	USDMXN	08/24/2023	60,000	17.31	(1,038,892)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023062703520	B	USDMXN	08/24/2023	60,000	17.28	(1,036,768)
2023070503355	BO	USDMXN	08/24/2023	60,000	17.15	(1,029,160)
2023071003624	BO	USDMXN	08/24/2023	20,000	17.20	(344,057)
2023071203333	BO	USDMXN	08/24/2023	38,000	16.97	(644,982)
2023071203569	SO	USDMXN	08/24/2023	(38,000)	17.01	646,527
2023071803650	BO	USDMXN	08/24/2023	28,045	16.87	(473,098)
2023072103391	SO	USDMXN	08/24/2023	(500,000)	17.03	8,513,456
2023072503604	B	USDMXN	08/24/2023	2,813,283	17.01	(47,864,527)
2023080203267	BO	USDMXN	08/24/2023	18,564	17.09	(317,340)
2023080403410	SO	USDMXN	08/24/2023	(37,000)	17.45	645,721
2023081603355	BO	USDMXN	08/24/2023	11,289	17.11	(193,125)
2023082103050	B	USDMXN	08/24/2023	11,000,000	17.03	(187,366,059)
2023082103153	B	USDMXN	08/24/2023	2,500,000	17.05	(42,617,425)
2023082203071	B	USDMXN	08/24/2023	1,000,000	16.92	(16,920,000)
2023082203097	B	USDMXN	08/24/2023	1,500,000	16.91	(25,360,245)
2023082203306	B	USDMXN	08/24/2023	1,000,000	16.92	(16,920,000)
2023082203526	B	USDMXN	08/24/2023	3,703,852	16.92	(62,674,443)
2023082203072	S	USDMXN	08/24/2023	(300,000)	16.91	5,073,588
2023082203129	S	USDMXN	08/24/2023	(100,000,000)	16.90	1,690,310,000
2023082203153	S	USDMXN	08/24/2023	(575,000)	16.91	9,723,250
2023082203171	S	USDMXN	08/24/2023	(1,625,000)	16.92	27,493,538
2023082203217	S	USDMXN	08/24/2023	(1,000,000)	16.94	16,939,100
2023082203484	S	USDMXN	08/24/2023	(2,000,000)	16.92	33,840,000
2023082203491	S	USDMXN	08/24/2023	(1,700,000)	16.92	28,762,079
2023082203569	S	USDMXN	08/24/2023	(3,852)	16.92	65,201
2023082303090	B	USDMXN	08/24/2023	100,000,000	16.83	(1,683,000,000)
2023082303129	S	USDMXN	08/24/2023	(20,000,000)	16.81	336,260,000
2022052703627	B	USDMXN	08/25/2023	1,825,000	21.39	(39,040,656)
2022052703631	S	USDMXN	08/25/2023	(1,825,000)	21.41	39,073,069
2022052703659	SO	USDMXN	08/25/2023	(158,750)	21.41	3,398,562
2022082603143	B	USDMXN	08/25/2023	1,000,000	21.40	(21,395,176)
2022083003395	S	USDMXN	08/25/2023	(1,000,000)	21.61	21,613,805
2022111703393	BO	USDMXN	08/25/2023	4,000,000	20.47	(81,874,008)
2023011103359	BO	USDMXN	08/25/2023	100,000	19.82	(1,981,989)
2023030303589	BO	USDMXN	08/25/2023	100,000	18.60	(1,859,640)
2023041703188	BO	USDMXN	08/25/2023	250,000	18.46	(4,613,980)
2023051503676	BO	USDMXN	08/25/2023	50,000	17.86	(893,101)
2023052903437	B	USDMXN	08/25/2023	300,000	17.90	(5,368,881)
2023060903320	BO	USDMXN	08/25/2023	50,000	17.60	(880,031)
2023080403486	SO	USDMXN	08/25/2023	(286,000)	17.14	4,902,272
2023082303130	B	USDMXN	08/25/2023	20,000,000	16.82	(336,316,000)
2023082303091	S	USDMXN	08/25/2023	(100,000,000)	16.83	1,683,310,000
2023082303313	S	USDMXN	08/25/2023	(17,500,000)	16.80	294,059,500
2023082303438	S	USDMXN	08/25/2023	(575,000)	16.81	9,666,038
2023082303510	S	USDMXN	08/25/2023	(222,692)	16.79	3,738,576
2023082303512	S	USDMXN	08/25/2023	(60,000)	16.79	1,007,286
2023082303518	S	USDMXN	08/25/2023	(47,200)	16.79	792,398
2023082303521	S	USDMXN	08/25/2023	(60,000)	16.79	1,007,352
2023082403278	B	USDMXN	08/25/2023	100,000,000	16.80	(1,680,000,000)
2023082403707	BO	USDMXN	08/25/2023	5,000,000	16.82	(84,092,235)
2023082403032	S	USDMXN	08/25/2023	(25,000,000)	16.82	420,575,000
2023082503201	S	USDMXN	08/25/2023	(11,285,015)	16.78	189,362,552
2023081003496	BO	USDMXN	08/28/2023	96,000	17.05	(1,636,407)
2023081603519	SO	USDMXN	08/28/2023	(400,000)	17.12	6,847,512
2023081603620	SO	USDMXN	08/28/2023	(32,000)	17.16	549,223
2023082403007	B	USDMXN	08/28/2023	1,000,000	16.80	(16,797,230)
2023082403033	B	USDMXN	08/28/2023	25,000,000	16.83	(420,781,250)
2023082403479	B	USDMXN	08/28/2023	3,000,000	16.81	(50,415,000)
2023082403679	B	USDMXN	08/28/2023	150,000	16.82	(2,523,393)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023082403035	S	USDMXN	08/28/2023	(1,000,000)	16.78	16,781,080
2023082403108	S	USDMXN	08/28/2023	(1,000,000)	16.81	16,808,170
2023082403115	S	USDMXN	08/28/2023	(1,000,000)	16.81	16,807,880
2023082403279	S	USDMXN	08/28/2023	(100,000,000)	16.81	1,680,900,000
2023082403630	S	USDMXN	08/28/2023	(1,000,000)	16.82	16,820,000
2023082503202	B	USDMXN	08/28/2023	11,285,015	16.79	(189,451,139)
2023082503261	B	USDMXN	08/28/2023	100,000,000	16.80	(1,680,000,000)
2023082503097	S	USDMXN	08/28/2023	(59,587,653)	16.78	1,000,000,000
2023082503103	S	USDMXN	08/28/2023	(17,872,036)	16.79	300,000,000
2023040503439	BO	USDMXN	08/29/2023	150,000	18.62	(2,793,297)
2023041003230	B	USDMXN	08/29/2023	153,846	18.69	(2,874,695)
2023050203391	B	USDMXN	08/29/2023	81,818	18.44	(1,508,772)
2023050503425	BO	USDMXN	08/29/2023	95,238	18.17	(1,730,236)
2023051503678	BO	USDMXN	08/29/2023	50,000	17.88	(893,830)
2023051603624	B	USDMXN	08/29/2023	329,470	17.83	(5,874,459)
2023053003720	B	USDMXN	08/29/2023	5,364,992	17.97	(96,400,725)
2023062703424	S	USDMXN	08/29/2023	(912,221)	17.31	15,790,562
2023063003522	SO	USDMXN	08/29/2023	(557,000)	17.30	9,636,049
2023063003627	SO	USDMXN	08/29/2023	(614)	17.30	10,621
2023070703580	SO	USDMXN	08/29/2023	(186,147)	17.28	3,216,049
2023071203670	BO	USDMXN	08/29/2023	200,000	17.04	(3,408,758)
2023071403631	S	USDMXN	08/29/2023	(1,467,150)	16.87	24,758,111
2023071403675	S	USDMXN	08/29/2023	(1,190,804)	16.87	20,083,655
2023072103578	B	USDMXN	08/29/2023	190,881	17.08	(3,261,147)
2023072103540	S	USDMXN	08/29/2023	(200,000)	17.08	3,415,261
2023072503321	B	USDMXN	08/29/2023	48,000,000	17.00	(816,049,090)
2023072503509	S	USDMXN	08/29/2023	(147,873)	17.02	2,516,771
2023072503513	S	USDMXN	08/29/2023	(84,225)	17.03	1,433,970
2023072803546	B	USDMXN	08/29/2023	309,560	16.78	(5,195,354)
2023073103443	B	USDMXN	08/29/2023	4,400,000	16.82	(74,006,008)
2023073103542	BO	USDMXN	08/29/2023	79,807	16.82	(1,341,961)
2023080203456	B	USDMXN	08/29/2023	99,781	17.08	(1,704,587)
2023080403397	S	USDMXN	08/29/2023	(324,479)	17.12	5,554,777
2023080803247	B	USDMXN	08/29/2023	3,000,000	17.20	(51,609,022)
2023080903409	B	USDMXN	08/29/2023	196,102	17.11	(3,355,138)
2023080903392	S	USDMXN	08/29/2023	(825,302)	17.11	14,123,660
2023080903394	S	USDMXN	08/29/2023	(992,824)	17.11	16,991,190
2023080903398	S	USDMXN	08/29/2023	(3,150,416)	17.11	53,916,815
2023081003495	SO	USDMXN	08/29/2023	(182,000)	17.04	3,101,133
2023081403447	S	USDMXN	08/29/2023	(9,000,000)	17.08	153,750,879
2023081503544	B	USDMXN	08/29/2023	184,071	17.16	(3,157,768)
2023081503511	S	USDMXN	08/29/2023	(522,090)	17.15	8,951,764
2023081503513	S	USDMXN	08/29/2023	(782,988)	17.15	13,425,138
2023081603049	S	USDMXN	08/29/2023	(7,000,000)	17.10	119,687,047
2023081703573	S	USDMXN	08/29/2023	(670,037)	17.16	11,498,700
2023082203522	B	USDMXN	08/29/2023	15,596,159	16.93	(264,118,408)
2023082203398	S	USDMXN	08/29/2023	(48,000,000)	16.94	813,199,512
2023082503042	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.76	(16,757,740)
2023082503044	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.75	(16,752,030)
2023082503098	B	USDMXN	08/29/2023	59,577,979	16.78	(1,000,000,000)
2023082503104	B	USDMXN	08/29/2023	17,869,162	16.79	(300,000,000)
2023082503132	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.81	(16,810,510)
2023082503142	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.79	(16,789,330)
2023082503196	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.78	(16,783,550)
2023082503330	B	USDMXN	08/29/2023	1,000,000	16.78	(16,780,500)
2023082503334	B	USDMXN	08/29/2023	10,966	16.78	(184,011)
2023082503630	B	USDMXN	08/29/2023	100,000	16.75	(1,675,114)
2023082503048	S	USDMXN	08/29/2023	(2,000,000)	16.78	33,560,000
2023082503133	S	USDMXN	08/29/2023	(1,000,000)	16.81	16,808,980

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023082503192	S	USDMXN	08/29/2023	(1,000,000)	16.79	16,789,920
2023082503207	S	USDMXN	08/29/2023	(425,000)	16.78	7,133,557
2023082503240	S	USDMXN	08/29/2023	(1,000,000)	16.81	16,805,000
2023082503262	S	USDMXN	08/29/2023	(100,000,000)	16.80	1,680,300,000
2023082503287	S	USDMXN	08/29/2023	(575,000)	16.78	9,650,886
2023082503616	S	USDMXN	08/29/2023	(1,640,000)	16.74	27,457,667
2023082803071	B	USDMXN	08/29/2023	100,000,000	16.72	(1,672,000,000)
2023082803062	S	USDMXN	08/29/2023	(65,000,000)	16.73	1,087,125,000
2022092703349	SO	USDMXN	08/30/2023	(212,187)	21.66	4,596,924
2022101203333	SO	USDMXN	08/30/2023	(216,522)	21.20	4,590,915
2022110103554	SO	USDMXN	08/30/2023	(172,496)	20.80	3,588,709
2023031003609	SO	USDMXN	08/30/2023	(125,000)	19.11	2,388,314
2023031403374	BO	USDMXN	08/30/2023	761,826	19.23	(14,653,671)
2023031403113	SO	USDMXN	08/30/2023	(125,000)	19.72	2,465,537
2023061603179	BO	USDMXN	08/30/2023	91,160	17.35	(1,581,957)
2023062303400	B	USDMXN	08/30/2023	111,600	17.38	(1,940,126)
2023062703333	BO	USDMXN	08/30/2023	15,200	17.32	(263,264)
2023071103370	B	USDMXN	08/30/2023	65,600	17.22	(1,129,508)
2023071103429	B	USDMXN	08/30/2023	97,600	17.20	(1,679,155)
2023071403462	BO	USDMXN	08/30/2023	48,614	16.92	(822,504)
2023071403638	BO	USDMXN	08/30/2023	52,000	16.88	(877,775)
2023071903368	B	USDMXN	08/30/2023	99,000	16.88	(1,671,464)
2023072403382	BO	USDMXN	08/30/2023	212,800	16.94	(3,604,169)
2023072403602	BO	USDMXN	08/30/2023	50,400	16.96	(854,584)
2023072503712	B	USDMXN	08/30/2023	54,450	17.03	(927,435)
2023072603307	B	USDMXN	08/30/2023	111,000	16.99	(1,885,801)
2023072603668	BO	USDMXN	08/30/2023	21,300	16.96	(361,230)
2023072803183	BO	USDMXN	08/30/2023	116,000	16.73	(1,940,721)
2023072803609	BO	USDMXN	08/30/2023	16,850	16.77	(282,523)
2023081403491	BO	USDMXN	08/30/2023	120,000	17.09	(2,051,234)
2023081503416	BO	USDMXN	08/30/2023	34,960	17.15	(599,536)
2023081703656	BO	USDMXN	08/30/2023	272,796	17.15	(4,678,914)
2023081803732	BO	USDMXN	08/30/2023	132,384	17.10	(2,263,460)
2023082203439	BO	USDMXN	08/30/2023	171,000	16.93	(2,895,874)
2023082203570	BO	USDMXN	08/30/2023	488	16.94	(8,269)
2023082303511	B	USDMXN	08/30/2023	222,692	16.80	(3,741,862)
2023082803063	B	USDMXN	08/30/2023	65,000,000	16.73	(1,087,300,500)
2023082803200	B	USDMXN	08/30/2023	3,576	16.73	(59,831)
2023082803072	S	USDMXN	08/30/2023	(100,000,000)	16.72	1,672,300,000
2023082803188	S	USDMXN	08/30/2023	(575,000)	16.73	9,619,348
2023082803452	S	USDMXN	08/30/2023	(575,000)	16.76	9,639,070
2023082803521	S	USDMXN	08/30/2023	(3,249,322)	16.77	54,492,502
2023082803523	S	USDMXN	08/30/2023	(48,051)	16.77	805,849
2023082903117	B	USDMXN	08/30/2023	100,000,000	16.85	(1,685,000,000)
2023082903085	S	USDMXN	08/30/2023	(50,000,000)	16.83	841,250,000
2023082903385	S	USDMXN	08/30/2023	(32,500,000)	16.84	547,235,000
2022100503293	B	USDMXN	08/31/2023	640,000	21.37	(13,674,493)
2022110103574	B	USDMXN	08/31/2023	3,590,000	20.86	(74,885,483)
2022111003477	BO	USDMXN	08/31/2023	200,000	20.46	(4,092,594)
2022120103185	B	USDMXN	08/31/2023	1,451,977	20.10	(29,179,612)
2023030203466	BO	USDMXN	08/31/2023	100,000	18.74	(1,874,424)
2023030203665	B	USDMXN	08/31/2023	162,500	18.75	(3,047,481)
2023030203696	BO	USDMXN	08/31/2023	11,200	18.76	(210,123)
2023030203695	SO	USDMXN	08/31/2023	(5,600)	18.75	104,980
2023032703609	BO	USDMXN	08/31/2023	30,071	18.93	(569,392)
2023032903542	BO	USDMXN	08/31/2023	25,000	18.65	(466,286)
2023033003399	B	USDMXN	08/31/2023	3,000,000	18.64	(55,907,840)
2023041303562	B	USDMXN	08/31/2023	2,000,000	18.52	(37,030,114)
2023041303627	BO	USDMXN	08/31/2023	81,500	18.51	(1,508,260)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023042703697	B	USDMXN	08/31/2023	214,968	18.50	(3,976,729)
2023042703695	SO	USDMXN	08/31/2023	(214,968)	18.47	3,971,224
2023051203494	BO	USDMXN	08/31/2023	144,000	17.98	(2,589,075)
2023051503679	BO	USDMXN	08/31/2023	50,000	17.88	(894,194)
2023051503827	BO	USDMXN	08/31/2023	30,071	17.84	(536,416)
2023061603463	BO	USDMXN	08/31/2023	60,000	17.34	(1,040,279)
2023062603481	S	USDMXN	08/31/2023	(200,000)	17.34	3,468,743
2023062703522	B	USDMXN	08/31/2023	60,000	17.30	(1,038,214)
2023070303491	B	USDMXN	08/31/2023	192,800	17.25	(3,325,379)
2023070503356	BO	USDMXN	08/31/2023	60,000	17.18	(1,030,556)
2023071003625	BO	USDMXN	08/31/2023	20,000	17.23	(344,523)
2023071403547	BO	USDMXN	08/31/2023	250,000	16.90	(4,223,762)
2023071403669	S	USDMXN	08/31/2023	(250,000)	16.87	4,218,045
2023071703431	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.90	(10,621,204)
2023071803409	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.89	(10,615,193)
2023071803505	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.88	(10,610,542)
2023071803651	BO	USDMXN	08/31/2023	22,365	16.89	(377,792)
2023071903350	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.89	(10,613,630)
2023071903522	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.86	(10,597,498)
2023072103525	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	17.07	(10,729,447)
2023072403565	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.96	(10,658,853)
2023072503490	BO	USDMXN	08/31/2023	628,500	17.03	(10,703,873)
2023072503542	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	17.03	(10,703,056)
2023072603329	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.99	(10,680,206)
2023072703724	BO	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.96	(10,662,183)
2023072803125	B	USDMXN	08/31/2023	628,500	16.73	(10,514,490)
2023080103108	B	USDMXN	08/31/2023	250,000	16.86	(4,214,056)
2023080203268	BO	USDMXN	08/31/2023	24,752	17.12	(423,720)
2023081403618	SO	USDMXN	08/31/2023	(117,000)	17.16	2,007,363
2023081603575	BO	USDMXN	08/31/2023	33,980	17.16	(583,019)
2023082403662	BO	USDMXN	08/31/2023	20,146	16.83	(339,114)
2023082903064	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.82	(16,815,560)
2023082903086	B	USDMXN	08/31/2023	50,000,000	16.83	(841,385,000)
2023082903092	B	USDMXN	08/31/2023	575,000	16.84	(9,680,533)
2023082903094	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.83	(16,834,150)
2023082903109	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.87	(16,871,540)
2023082903150	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.85	(16,850,000)
2023082903165	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.85	(16,850,000)
2023082903386	B	USDMXN	08/31/2023	32,500,000	16.84	(547,326,000)
2023082903410	B	USDMXN	08/31/2023	1,000,000	16.83	(16,825,000)
2023082903644	B	USDMXN	08/31/2023	274,000	16.79	(4,599,391)
2023082903647	B	USDMXN	08/31/2023	1,411,995	16.79	(23,700,330)
2023082903023	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.82	16,820,480
2023082903072	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.84	16,838,290
2023082903102	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.85	16,850,890
2023082903107	S	USDMXN	08/31/2023	(575,000)	16.85	9,689,923
2023082903118	S	USDMXN	08/31/2023	(100,000,000)	16.85	1,685,300,000
2023082903136	S	USDMXN	08/31/2023	(30,000,000)	16.85	505,623,600
2023082903168	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.85	16,851,060
2023082903174	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.85	16,852,300
2023082903523	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.82	16,815,000
2023082903530	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.82	16,815,000
2023082903559	S	USDMXN	08/31/2023	(1,000,000)	16.79	16,789,840
2023082903562	S	USDMXN	08/31/2023	(2,000,000)	16.79	33,574,400
2023082903596	S	USDMXN	08/31/2023	(3,000,000)	16.79	50,355,000
2023082903646	S	USDMXN	08/31/2023	(5,000,000)	16.79	83,925,000
2023082903682	S	USDMXN	08/31/2023	(435,995)	16.80	7,323,847
2023083003221	B	USDMXN	08/31/2023	100,000,000	16.77	(1,677,000,000)
2023083003070	S	USDMXN	08/31/2023	(30,000,000)	16.76	502,650,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023083003148	S	USDMXN	08/31/2023	(50,000,000)	16.76	838,100,000
2022060303231	B	USDMXN	09/01/2023	1,460,000	21.33	(31,147,640)
2022060303265	S	USDMXN	09/01/2023	(1,460,000)	21.32	31,133,122
2023030203468	BO	USDMXN	09/01/2023	100,000	18.75	(1,874,789)
2023050203104	B	USDMXN	09/01/2023	250,000	18.49	(4,623,313)
2023061303562	BO	USDMXN	09/01/2023	50,000	17.46	(873,245)
2023072703832	BO	USDMXN	09/01/2023	108,000	16.98	(1,833,863)
2023080103545	BO	USDMXN	09/01/2023	575,000	16.97	(9,758,451)
2023080203422	BO	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.06	(9,810,195)
2023080303394	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.38	(9,991,163)
2023080703083	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.13	(9,848,605)
2023080703287	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.11	(9,840,210)
2023080803408	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.16	(9,864,224)
2023080903127	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.15	(9,860,370)
2023081003251	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.00	(9,775,705)
2023081003421	B	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.04	(9,799,970)
2023081403014	BO	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.01	(9,783,606)
2023081403272	BO	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.12	(9,846,859)
2023081403617	SO	USDMXN	09/01/2023	(273,000)	17.16	4,684,665
2023081503178	BO	USDMXN	09/01/2023	575,000	17.17	(9,871,185)
2023083003071	B	USDMXN	09/01/2023	30,000,000	16.76	(502,731,000)
2023083003149	B	USDMXN	09/01/2023	50,000,000	16.76	(838,237,500)
2023083003222	S	USDMXN	09/01/2023	(100,000,000)	16.77	1,677,300,000
2023083003474	S	USDMXN	09/01/2023	(1,000,000)	16.76	16,755,000
2023083003512	S	USDMXN	09/01/2023	(1,000,000)	16.76	16,755,000
2023083003513	S	USDMXN	09/01/2023	(1,300,000)	16.76	21,784,048
2023083003517	S	USDMXN	09/01/2023	(700,000)	16.76	11,729,550
2023083003728	S	USDMXN	09/01/2023	(350,000)	16.75	5,862,777
2023083103179	B	USDMXN	09/01/2023	100,000,000	16.85	(1,685,000,000)
2023083103066	S	USDMXN	09/01/2023	(75,000,000)	16.77	1,257,825,000
2022090703161	B	USDMXN	09/05/2023	200,000	21.47	(4,293,682)
2022111503355	B	USDMXN	09/05/2023	4,200,000	20.43	(85,806,659)
2023011203103	B	USDMXN	09/05/2023	766,219	19.73	(15,115,177)
2023040503440	BO	USDMXN	09/05/2023	150,000	18.65	(2,797,286)
2023041003232	B	USDMXN	09/05/2023	153,846	18.71	(2,878,870)
2023050203394	B	USDMXN	09/05/2023	81,818	18.47	(1,510,839)
2023050503426	BO	USDMXN	09/05/2023	95,238	18.19	(1,732,588)
2023061503486	BO	USDMXN	09/05/2023	30,000	17.39	(521,594)
2023062603483	S	USDMXN	09/05/2023	(200,000)	17.36	3,471,753
2023081403619	SO	USDMXN	09/05/2023	(111,000)	17.11	1,899,134
2023081603481	S	USDMXN	09/05/2023	(200,000)	17.12	3,424,751
2023081603484	S	USDMXN	09/05/2023	(131,000)	17.13	2,243,586
2023081603493	S	USDMXN	09/05/2023	(227,000)	17.12	3,885,902
2023083103067	B	USDMXN	09/05/2023	75,000,000	16.78	(1,258,635,000)
2023083103119	B	USDMXN	09/05/2023	1,000,000	16.83	(16,827,840)
2023083103125	B	USDMXN	09/05/2023	1,000,000	16.83	(16,832,400)
2023083103131	B	USDMXN	09/05/2023	1,000,000	16.85	(16,853,700)
2023083103154	B	USDMXN	09/05/2023	500,000	16.96	(8,482,100)
2023083103172	B	USDMXN	09/05/2023	500,000	16.93	(8,464,050)
2023083103500	B	USDMXN	09/05/2023	25,000	16.92	(422,968)
2023083103798	B	USDMXN	09/05/2023	2,574,080	17.03	(43,843,020)
2023083103045	S	USDMXN	09/05/2023	(20,000,000)	16.78	335,534,000
2023083103118	S	USDMXN	09/05/2023	(1,000,000)	16.83	16,828,190
2023083103124	S	USDMXN	09/05/2023	(1,000,000)	16.83	16,834,680
2023083103129	S	USDMXN	09/05/2023	(1,000,000)	16.84	16,837,650
2023083103180	S	USDMXN	09/05/2023	(100,000,000)	16.86	1,686,200,000
2023083103237	S	USDMXN	09/05/2023	(1,000,000)	16.89	16,887,860
2023083103425	S	USDMXN	09/05/2023	(930)	16.94	15,751
2023083103445	S	USDMXN	09/05/2023	(5,000,000)	16.91	84,546,100

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023083103516	S	USDMXN	09/05/2023	(25,000)	16.93	423,279
2023083103799	S	USDMXN	09/05/2023	(2,574,080)	17.03	43,831,257
2023083103809	S	USDMXN	09/05/2023	(5,497,000)	17.02	93,543,548
2023090103116	B	USDMXN	09/05/2023	100,000,000	17.14	(1,714,000,000)
2023030603628	BO	USDMXN	09/06/2023	2,000,000	18.65	(37,290,346)
2023061603689	BO	USDMXN	09/06/2023	30,000	17.32	(519,602)
2023071103431	B	USDMXN	09/06/2023	97,600	17.23	(1,681,359)
2023071403463	BO	USDMXN	09/06/2023	48,614	16.94	(823,620)
2023072403383	BO	USDMXN	09/06/2023	180,200	16.96	(3,056,091)
2023072403601	BO	USDMXN	09/06/2023	31,000	16.98	(526,339)
2023072603309	B	USDMXN	09/06/2023	40,000	17.01	(680,488)
2023072603671	BO	USDMXN	09/06/2023	10,550	16.98	(179,158)
2023072803610	BO	USDMXN	09/06/2023	40,650	16.79	(682,515)
2023072803726	B	USDMXN	09/06/2023	54,000	16.78	(906,212)
2023081603572	BO	USDMXN	09/06/2023	68,025	17.18	(1,168,447)
2023081603354	S	USDMXN	09/06/2023	(2,000,000)	17.14	34,285,858
2023081703652	BO	USDMXN	09/06/2023	45,600	17.17	(783,125)
2023082403663	BO	USDMXN	09/06/2023	33,200	16.85	(559,435)
2023082503747	BO	USDMXN	09/06/2023	237,664	16.78	(3,988,455)
2023090103232	B	USDMXN	09/06/2023	1,000,000	17.11	(17,110,000)
2023090103392	B	USDMXN	09/06/2023	2,500,000	17.11	(42,765,000)
2023090103117	S	USDMXN	09/06/2023	(100,000,000)	17.14	1,714,300,000
2023090103389	S	USDMXN	09/06/2023	(1,000,000)	17.12	17,118,070
2023090403259	S	USDMXN	09/06/2023	(10,000,000)	17.16	171,640,000
2023090503099	B	USDMXN	09/06/2023	100,000,000	17.32	(1,732,000,000)
2022102103436	B	USDMXN	09/07/2023	6,180,000	21.17	(130,809,155)
2022110103123	B	USDMXN	09/07/2023	5,000,000	20.89	(104,470,685)
2022120103180	B	USDMXN	09/07/2023	1,840,909	20.12	(37,035,137)
2023010603703	B	USDMXN	09/07/2023	6,223,700	20.02	(124,583,276)
2023032803537	BO	USDMXN	09/07/2023	100,000	18.81	(1,881,476)
2023051503837	BO	USDMXN	09/07/2023	62,635	17.86	(1,118,571)
2023061503487	BO	USDMXN	09/07/2023	40,000	17.39	(695,726)
2023061603464	BO	USDMXN	09/07/2023	60,000	17.36	(1,041,665)
2023062703524	B	USDMXN	09/07/2023	60,000	17.33	(1,039,628)
2023070503358	BO	USDMXN	09/07/2023	60,000	17.20	(1,031,953)
2023071803652	BO	USDMXN	09/07/2023	16,330	16.92	(276,225)
2023080203269	BO	USDMXN	09/07/2023	18,564	17.14	(318,228)
2023081703562	BO	USDMXN	09/07/2023	60,000	17.16	(1,029,336)
2023082303445	BO	USDMXN	09/07/2023	6,000	16.85	(101,096)
2023082903333	BO	USDMXN	09/07/2023	28,167	16.85	(474,563)
2023082903653	BO	USDMXN	09/07/2023	21,636	16.80	(363,522)
2023083003410	BO	USDMXN	09/07/2023	17,453	16.76	(292,478)
2023083103411	BO	USDMXN	09/07/2023	13,505	16.96	(228,973)
2023083103422	BO	USDMXN	09/07/2023	17,599	16.95	(298,301)
2023083103819	SO	USDMXN	09/07/2023	(135,000)	17.02	2,297,719
2023090503081	B	USDMXN	09/07/2023	10,000,000	17.33	(173,270,000)
2023090503135	B	USDMXN	09/07/2023	1,000,000	17.36	(17,360,030)
2023090503138	B	USDMXN	09/07/2023	1,000,000	17.35	(17,352,190)
2023090503342	B	USDMXN	09/07/2023	239	17.34	(4,152)
2023090503484	B	USDMXN	09/07/2023	2,000,000	17.38	(34,768,180)
2023090503503	B	USDMXN	09/07/2023	15,000,000	17.39	(260,850,000)
2023090503536	B	USDMXN	09/07/2023	665,000	17.39	(11,565,600)
2023090503633	B	USDMXN	09/07/2023	211,734	17.45	(3,695,069)
2023090503723	B	USDMXN	09/07/2023	1,121,997	17.43	(19,561,450)
2023090503100	S	USDMXN	09/07/2023	(100,000,000)	17.32	1,732,300,000
2023090503421	S	USDMXN	09/07/2023	(2,000,000)	17.38	34,760,000
2023090503448	S	USDMXN	09/07/2023	(5,000,000)	17.39	86,925,000
2023090503455	S	USDMXN	09/07/2023	(211,734)	17.40	3,683,540
2023090503595	S	USDMXN	09/07/2023	(665,000)	17.44	11,598,332



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023090503684	S	USDMXN	09/07/2023	(3,000,000)	17.42	52,260,000
2023090503687	S	USDMXN	09/07/2023	(1,000,000)	17.43	17,425,000
2023090503720	S	USDMXN	09/07/2023	(1,121,997)	17.43	19,554,976
2022090903109	BO	USDMXN	09/08/2023	1,000,000	21.28	(21,279,462)
2022092303402	S	USDMXN	09/08/2023	(1,000,000)	21.48	21,484,795
2023030103059	BO	USDMXN	09/08/2023	300,000	18.90	(5,670,012)
2023030203467	BO	USDMXN	09/08/2023	100,000	18.77	(1,877,359)
2023050203106	B	USDMXN	09/08/2023	250,000	18.52	(4,629,403)
2023061503490	BO	USDMXN	09/08/2023	30,000	17.40	(521,893)
2023061603690	BO	USDMXN	09/08/2023	20,000	17.33	(346,533)
2023072603085	BO	USDMXN	09/08/2023	125,000	17.01	(2,126,224)
2023083103818	SO	USDMXN	09/08/2023	(421,000)	17.03	7,167,600
2023090603016	B	USDMXN	09/08/2023	1,000,000	17.50	(17,500,560)
2023090603042	B	USDMXN	09/08/2023	10,000,000	17.51	(175,130,000)
2023090603126	B	USDMXN	09/08/2023	665,000	17.61	(11,709,672)
2023090603193	B	USDMXN	09/08/2023	1,000,000	17.56	(17,555,040)
2023090603204	B	USDMXN	09/08/2023	1,000,000	17.55	(17,551,990)
2023090603281	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,663,667)
2023090603284	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.58	(3,663,317)
2023090603288	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.58	(3,662,662)
2023090603290	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.58	(3,662,394)
2023090603292	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,663,823)
2023090603297	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,663,948)
2023090603299	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,665,069)
2023090603304	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,664,906)
2023090603307	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,664,552)
2023090603311	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,664,040)
2023090603313	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,663,898)
2023090603315	B	USDMXN	09/08/2023	208,333	17.59	(3,664,300)
2023090603330	B	USDMXN	09/08/2023	5,000,000	17.59	(87,967,000)
2023090603037	S	USDMXN	09/08/2023	(1,000,000)	17.55	17,550,640
2023090603215	S	USDMXN	09/08/2023	(665,000)	17.56	11,674,680
2023090603236	S	USDMXN	09/08/2023	(2,000,000)	17.58	35,160,000
2023090603269	S	USDMXN	09/08/2023	(2,500,000)	17.59	43,975,725
2023080703074	B	USDMXN	09/11/2023	20,000,000	17.14	(342,896,800)
2023081003443	BO	USDMXN	09/11/2023	500,000	17.12	(8,561,674)
2023082303442	B	USDMXN	09/11/2023	273,000	16.86	(4,603,163)
2023082303392	SO	USDMXN	09/11/2023	(421,000)	16.87	7,103,699
2023082303393	SO	USDMXN	09/11/2023	(273,000)	16.87	4,606,328
2023082303478	S	USDMXN	09/11/2023	(20,000,000)	16.86	337,225,490
2023090703446	B	USDMXN	09/11/2023	665,000	17.58	(11,690,700)
2023090703493	S	USDMXN	09/11/2023	(665,000)	17.59	11,696,552
2023090703554	S	USDMXN	09/11/2023	(820)	17.58	14,416
2023032903321	BO	USDMXN	09/12/2023	1,000,000	18.68	(18,682,231)
2023040503441	BO	USDMXN	09/12/2023	150,000	18.68	(2,801,276)
2023041003234	B	USDMXN	09/12/2023	153,846	18.74	(2,882,779)
2023050203397	B	USDMXN	09/12/2023	81,818	18.49	(1,512,899)
2023050503427	BO	USDMXN	09/12/2023	95,238	18.22	(1,734,941)
2023060103476	B	USDMXN	09/12/2023	600,000	17.91	(10,747,352)
2023071203558	BO	USDMXN	09/12/2023	500,000	17.17	(8,582,522)
2023071203686	BO	USDMXN	09/12/2023	500,000	17.10	(8,550,075)
2023071903346	BO	USDMXN	09/12/2023	1,000,000	16.94	(16,936,808)
2023080303341	S	USDMXN	09/12/2023	(1,000,000)	17.39	17,392,303
2023080303605	S	USDMXN	09/12/2023	(110,000)	17.38	1,912,189
2023081803522	S	USDMXN	09/12/2023	(200,000)	17.09	3,418,940
2023082303443	S	USDMXN	09/12/2023	(273,000)	16.86	4,603,920
2023082403680	S	USDMXN	09/12/2023	(150,000)	16.87	2,529,777
2023082503631	S	USDMXN	09/12/2023	(100,000)	16.79	1,679,088
2023090703672	S	USDMXN	09/12/2023	(500,000)	17.60	8,798,150

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023090803334	B	USDMXN	09/12/2023	125,000	17.59	(2,199,038)
2023090803336	B	USDMXN	09/12/2023	125,000	17.59	(2,198,638)
2023090803338	B	USDMXN	09/12/2023	125,000	17.59	(2,198,700)
2023090803340	B	USDMXN	09/12/2023	125,000	17.59	(2,198,713)
2023090803649	B	USDMXN	09/12/2023	50,000	17.61	(880,445)
2023090803651	B	USDMXN	09/12/2023	50,000	17.61	(880,420)
2023090803653	B	USDMXN	09/12/2023	50,000	17.61	(880,410)
2023090803655	B	USDMXN	09/12/2023	50,000	17.61	(880,425)
2023090803657	B	USDMXN	09/12/2023	50,000	17.61	(880,380)
2023090803692	B	USDMXN	09/12/2023	3,365,000	17.60	(59,224,000)
2023090803166	S	USDMXN	09/12/2023	(1,000,000)	17.56	17,561,820
2023090803233	S	USDMXN	09/12/2023	(1,000,000)	17.57	17,574,500
2023090803240	S	USDMXN	09/12/2023	(1,000,000)	17.59	17,592,050
2023090803662	S	USDMXN	09/12/2023	(665,000)	17.61	11,709,121
2023091103077	B	USDMXN	09/12/2023	178,000	17.46	(3,108,430)
2023091103501	S	USDMXN	09/12/2023	(1,000,000)	17.30	17,301,233
2022102503610	S	USDMXN	09/13/2023	(351,077)	21.10	7,407,157
2023011103348	BO	USDMXN	09/13/2023	500,000	19.82	(9,909,055)
2023021703446	B	USDMXN	09/13/2023	1,000,000	19.11	(19,105,055)
2023060603481	B	USDMXN	09/13/2023	5,698,526	17.74	(101,090,870)
2023071103344	BO	USDMXN	09/13/2023	108,800	17.28	(1,879,670)
2023071103433	B	USDMXN	09/13/2023	97,600	17.25	(1,683,603)
2023071403464	BO	USDMXN	09/13/2023	48,614	16.97	(824,737)
2023072103579	S	USDMXN	09/13/2023	(190,881)	17.13	3,270,456
2023072103601	SO	USDMXN	09/13/2023	(7,406)	17.13	126,872
2023072403384	BO	USDMXN	09/13/2023	124,800	16.98	(2,119,378)
2023072503494	B	USDMXN	09/13/2023	4,368,414	17.07	(74,566,498)
2023072803184	BO	USDMXN	09/13/2023	58,000	16.77	(972,900)
2023072803728	B	USDMXN	09/13/2023	54,000	16.80	(907,405)
2023072803540	S	USDMXN	09/13/2023	(341,638)	16.83	5,749,891
2023072803547	S	USDMXN	09/13/2023	(309,560)	16.83	5,209,960
2023072803555	S	USDMXN	09/13/2023	(738,555)	16.83	12,430,357
2023080103016	BO	USDMXN	09/13/2023	42,000	16.90	(709,963)
2023080803339	BO	USDMXN	09/13/2023	20,350	17.24	(350,795)
2023080903548	BO	USDMXN	09/13/2023	21,350	17.17	(366,547)
2023081003675	BO	USDMXN	09/13/2023	22,400	17.40	(389,737)
2023081403493	BO	USDMXN	09/13/2023	25,800	17.14	(442,114)
2023081603570	BO	USDMXN	09/13/2023	34,052	17.20	(585,670)
2023081703581	S	USDMXN	09/13/2023	(137,976)	17.22	2,376,146
2023081703583	S	USDMXN	09/13/2023	(54,695)	17.22	941,916
2023081703587	SO	USDMXN	09/13/2023	(72,281)	17.22	1,244,719
2023082203523	S	USDMXN	09/13/2023	(15,596,159)	16.98	264,819,588
2023082203524	S	USDMXN	09/13/2023	(1,699,988)	16.98	28,863,114
2023082203527	S	USDMXN	09/13/2023	(3,703,852)	16.98	62,893,593
2023082403622	B	USDMXN	09/13/2023	154,185	16.85	(2,598,711)
2023082903392	BO	USDMXN	09/13/2023	60,993	16.88	(1,029,784)
2023083003407	BO	USDMXN	09/13/2023	232,000	16.78	(3,893,951)
2023083003412	BO	USDMXN	09/13/2023	704	16.77	(11,808)
2023090103666	BO	USDMXN	09/13/2023	188,560	17.12	(3,227,512)
2023090503314	BO	USDMXN	09/13/2023	2,412	17.35	(41,847)
2023090503619	B	USDMXN	09/13/2023	4,487,969	17.47	(78,404,495)
2023090503751	BO	USDMXN	09/13/2023	282,464	17.44	(4,926,207)
2023091103224	B	USDMXN	09/13/2023	1,000,000	17.40	(17,401,130)
2023091103549	B	USDMXN	09/13/2023	1,000,000	17.30	(17,300,000)
2023091103648	B	USDMXN	09/13/2023	97,766	17.31	(1,692,186)
2023091103659	B	USDMXN	09/13/2023	3,000,000	17.31	(51,915,000)
2023091103665	B	USDMXN	09/13/2023	97,473	17.30	(1,686,702)
2023091103710	B	USDMXN	09/13/2023	100	17.28	(1,728)
2023091103204	S	USDMXN	09/13/2023	(1,000,000)	17.45	17,451,960

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091103362	S	USDMXN	09/13/2023	(1,261)	17.32	21,839
2023091103481	S	USDMXN	09/13/2023	(1,000,000)	17.33	17,327,990
2023091103588	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,360
2023091103590	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,330
2023091103592	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,330
2023091103594	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,330
2023091103596	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,370
2023091103598	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.31	1,731,380
2023091103600	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.32	1,731,620
2023091103602	S	USDMXN	09/13/2023	(100,000)	17.32	1,731,580
2023091103653	S	USDMXN	09/13/2023	(195,239)	17.30	3,378,558
2022110803256	SO	USDMXN	09/14/2023	(250,000)	20.59	5,148,601
2022110803257	SO	USDMXN	09/14/2023	(2,488)	20.59	51,236
2022120103175	B	USDMXN	09/14/2023	1,840,909	20.14	(37,084,971)
2022120603289	SO	USDMXN	09/14/2023	(197,944)	20.85	4,126,888
2022121303341	S	USDMXN	09/14/2023	(200,027)	20.63	4,125,863
2023032803538	BO	USDMXN	09/14/2023	100,000	18.84	(1,884,131)
2023032903543	BO	USDMXN	09/14/2023	25,000	18.70	(467,575)
2023051503838	BO	USDMXN	09/14/2023	62,635	17.88	(1,120,189)
2023062703509	BO	USDMXN	09/14/2023	686,376	17.35	(11,909,640)
2023062703526	B	USDMXN	09/14/2023	60,000	17.35	(1,041,012)
2023070503357	BO	USDMXN	09/14/2023	60,000	17.22	(1,033,339)
2023081703560	BO	USDMXN	09/14/2023	60,000	17.18	(1,030,639)
2023090503750	BO	USDMXN	09/14/2023	25,816	17.44	(450,311)
2023090603546	BO	USDMXN	09/14/2023	5,239	17.59	(92,137)
2023091203107	B	USDMXN	09/14/2023	1,000,000	17.32	(17,318,390)
2023091203121	B	USDMXN	09/14/2023	665,000	17.30	(11,501,275)
2023091203497	B	USDMXN	09/14/2023	2,000,000	17.24	(34,480,000)
2023091203502	B	USDMXN	09/14/2023	1,000,000	17.23	(17,231,790)
2023091203666	B	USDMXN	09/14/2023	5,000,000	17.25	(86,250,000)
2023091203714	B	USDMXN	09/14/2023	105,876	17.23	(1,824,220)
2023091203111	S	USDMXN	09/14/2023	(1,000,000)	17.28	17,283,940
2023091203326	S	USDMXN	09/14/2023	(665,000)	17.26	11,475,372
2023091203582	S	USDMXN	09/14/2023	(1,000,000)	17.24	17,237,790
2023091203641	S	USDMXN	09/14/2023	(273,831)	17.26	4,725,278
2023091203646	S	USDMXN	09/14/2023	(693,640)	17.26	11,968,821
2023091203649	S	USDMXN	09/14/2023	(252,102)	17.26	4,350,219
2023091203668	S	USDMXN	09/14/2023	(386,304)	17.25	6,662,971
2022013103149	B	USDMXN	09/15/2023	509,964	23.04	(11,747,345)
2023011103420	BO	USDMXN	09/15/2023	388,500	19.83	(7,705,509)
2023011103487	BO	USDMXN	09/15/2023	43	19.84	(853)
2023012603336	B	USDMXN	09/15/2023	3,000,000	19.65	(58,957,335)
2023021303193	BO	USDMXN	09/15/2023	388,543	19.43	(7,549,909)
2023030203469	BO	USDMXN	09/15/2023	100,000	18.80	(1,879,972)
2023031003610	SO	USDMXN	09/15/2023	(175,000)	19.16	3,353,682
2023031403116	SO	USDMXN	09/15/2023	(175,000)	19.79	3,463,049
2023042803537	B	USDMXN	09/15/2023	100,000	18.50	(1,849,786)
2023050203108	B	USDMXN	09/15/2023	250,000	18.54	(4,634,409)
2023051503732	B	USDMXN	09/15/2023	700,000	17.87	(12,510,777)
2023062903380	B	USDMXN	09/15/2023	600,000	17.37	(10,420,678)
2023080303373	S	USDMXN	09/15/2023	(600,000)	17.40	10,439,458
2023082903645	S	USDMXN	09/15/2023	(274,000)	16.83	4,610,899
2023083103722	BO	USDMXN	09/15/2023	80,471	17.04	(1,371,446)
2023091303088	B	USDMXN	09/15/2023	500,000	17.16	(8,577,500)
2023091303095	B	USDMXN	09/15/2023	500,000	17.13	(8,565,000)
2023091303119	B	USDMXN	09/15/2023	800,000	17.11	(13,688,000)
2023091303137	B	USDMXN	09/15/2023	300,000	17.12	(5,134,500)
2023091303238	B	USDMXN	09/15/2023	1,000,000	17.11	(17,105,000)
2023091303389	B	USDMXN	09/15/2023	500,000	17.14	(8,571,690)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091303392	B	USDMXN	09/15/2023	1,000,000	17.14	(17,141,340)
2023091303434	B	USDMXN	09/15/2023	420,000	17.14	(7,199,640)
2023091303023	S	USDMXN	09/15/2023	(10,000,000)	17.16	171,552,000
2023091303091	S	USDMXN	09/15/2023	(500,000)	17.15	8,573,155
2023091303098	S	USDMXN	09/15/2023	(500,000)	17.12	8,561,960
2023091303130	S	USDMXN	09/15/2023	(300,000)	17.12	5,135,370
2023091303133	S	USDMXN	09/15/2023	(500,000)	17.12	8,559,100
2023091303138	S	USDMXN	09/15/2023	(300,000)	17.11	5,131,920
2023091303185	S	USDMXN	09/15/2023	(1,000,000)	17.13	17,127,150
2023091303311	S	USDMXN	09/15/2023	(1,000,000)	17.13	17,129,410
2023091303317	S	USDMXN	09/15/2023	(2,000,000)	17.13	34,265,960
2023091303387	S	USDMXN	09/15/2023	(665,000)	17.14	11,398,898
2023091303431	S	USDMXN	09/15/2023	(250,000)	17.14	4,285,910
2023091303517	S	USDMXN	09/15/2023	(48,400)	17.14	829,803
2023091303519	S	USDMXN	09/15/2023	(48,200)	17.14	826,350
2023091303521	S	USDMXN	09/15/2023	(48,100)	17.14	824,631
2023091303523	S	USDMXN	09/15/2023	(48,000)	17.14	822,917
2023091303525	S	USDMXN	09/15/2023	(47,700)	17.15	817,821
2023091303528	S	USDMXN	09/15/2023	(47,700)	17.15	817,828
2023091303531	S	USDMXN	09/15/2023	(47,500)	17.14	814,321
2023091403608	BO	USDMXN	09/15/2023	3,000,000	17.09	(51,258,018)
2022092203243	BO	USDMXN	09/18/2023	200,000	21.24	(4,247,449)
2023031503511	BO	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	19.67	(19,665,000)
2023031503513	BO	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	19.67	(19,665,000)
2023031603661	B	USDMXN	09/18/2023	600,000	19.42	(11,654,254)
2023032103465	B	USDMXN	09/18/2023	960,000	19.31	(18,535,131)
2023032303363	B	USDMXN	09/18/2023	600,000	19.21	(11,526,835)
2023032803228	B	USDMXN	09/18/2023	400,000	18.88	(7,551,488)
2023033003682	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	18.69	(18,688,793)
2023062603486	S	USDMXN	09/18/2023	(200,000)	17.40	3,480,483
2023080103283	BO	USDMXN	09/18/2023	3,300,000	17.02	(56,177,187)
2023080103286	B	USDMXN	09/18/2023	5,000,000	17.03	(85,163,545)
2023080103287	BO	USDMXN	09/18/2023	58,911	17.03	(1,003,346)
2023082803524	B	USDMXN	09/18/2023	48,051	16.83	(808,529)
2023083103421	SO	USDMXN	09/18/2023	(421,000)	16.81	7,076,516
2023090103393	S	USDMXN	09/18/2023	(2,500,000)	17.14	42,852,750
2023091403079	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	17.14	(17,140,000)
2023091403101	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	17.12	(17,121,050)
2023091403107	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	17.12	(17,115,880)
2023091403161	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	17.12	(17,118,450)
2023091403341	B	USDMXN	09/18/2023	1,000,000	17.09	(17,085,000)
2023091403345	B	USDMXN	09/18/2023	600,000	17.08	(10,250,784)
2023091403364	B	USDMXN	09/18/2023	700,000	17.09	(11,959,500)
2023091403443	B	USDMXN	09/18/2023	600,000	17.09	(10,255,482)
2023091403715	B	USDMXN	09/18/2023	210,816	17.12	(3,608,959)
2023091403717	B	USDMXN	09/18/2023	1,612,126	17.12	(27,598,354)
2023091403072	S	USDMXN	09/18/2023	(1,000,000)	17.17	17,165,010
2023091403140	S	USDMXN	09/18/2023	(1,000,000)	17.12	17,116,130
2023091403142	S	USDMXN	09/18/2023	(1,000,000)	17.12	17,119,410
2023091403363	S	USDMXN	09/18/2023	(300,000)	17.12	5,134,500
2023091403429	S	USDMXN	09/18/2023	(600,000)	17.09	10,256,604
2023091403449	S	USDMXN	09/18/2023	(393,034)	17.09	6,717,537
2023091403451	S	USDMXN	09/18/2023	(402,758)	17.09	6,883,601
2023091403453	S	USDMXN	09/18/2023	(409,230)	17.09	6,993,921
2023091403455	S	USDMXN	09/18/2023	(384,522)	17.09	6,571,819
2023091403459	S	USDMXN	09/18/2023	(367,881)	17.09	6,287,160
2023091403462	S	USDMXN	09/18/2023	(49,600)	17.09	847,664
2023091403464	S	USDMXN	09/18/2023	(49,600)	17.09	847,669
2023091403466	S	USDMXN	09/18/2023	(169,640)	17.09	2,899,148

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091403468	S	USDMXN	09/18/2023	(43,735)	17.09	747,466
2023091403623	S	USDMXN	09/18/2023	(200,000)	17.10	3,419,104
2023091403627	S	USDMXN	09/18/2023	(200,000)	17.09	3,418,786
2023091403631	S	USDMXN	09/18/2023	(200,000)	17.10	3,419,102
2023091403635	S	USDMXN	09/18/2023	(200,000)	17.09	3,418,580
2023091403637	S	USDMXN	09/18/2023	(300,000)	17.10	5,129,220
2023091403687	S	USDMXN	09/18/2023	(665,000)	17.12	11,382,832
2023032803539	BO	USDMXN	09/19/2023	100,000	18.86	(1,886,028)
2023040503442	BO	USDMXN	09/19/2023	150,000	18.70	(2,805,257)
2023041003237	B	USDMXN	09/19/2023	153,846	18.77	(2,886,952)
2023050203399	B	USDMXN	09/19/2023	81,818	18.52	(1,514,950)
2023050203710	BO	USDMXN	09/19/2023	67,000	18.47	(1,237,587)
2023050503428	BO	USDMXN	09/19/2023	95,238	18.24	(1,737,307)
2023071903273	BO	USDMXN	09/19/2023	30,000	16.95	(508,532)
2023072003607	BO	USDMXN	09/19/2023	2,000,000	17.09	(34,188,880)
2023083103419	SO	USDMXN	09/19/2023	(137,000)	16.81	2,303,209
2023091403762	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.12	(17,115,420)
2023091403779	B	USDMXN	09/19/2023	744,991	17.12	(12,750,900)
2023091503016	B	USDMXN	09/19/2023	350,000	17.09	(5,981,500)
2023091503039	B	USDMXN	09/19/2023	350,000	17.07	(5,974,500)
2023091503056	B	USDMXN	09/19/2023	1,600,000	17.07	(27,312,000)
2023091503137	B	USDMXN	09/19/2023	3,000,000	17.08	(51,246,000)
2023091503189	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.07	(17,073,590)
2023091503271	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.08	(17,080,000)
2023091503379	B	USDMXN	09/19/2023	25,000	17.08	(427,065)
2023091503558	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.06	(17,055,000)
2023091503619	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.06	(17,063,070)
2023091503622	B	USDMXN	09/19/2023	1,000,000	17.06	(17,062,680)
2023091503063	S	USDMXN	09/19/2023	(250,000)	17.07	4,267,725
2023091503066	S	USDMXN	09/19/2023	(250,000)	17.07	4,267,823
2023091503068	S	USDMXN	09/19/2023	(250,000)	17.07	4,267,723
2023091503070	S	USDMXN	09/19/2023	(350,000)	17.07	5,974,952
2023091503072	S	USDMXN	09/19/2023	(500,000)	17.07	8,536,100
2023091503075	S	USDMXN	09/19/2023	(300,000)	17.07	5,122,440
2023091503077	S	USDMXN	09/19/2023	(350,000)	17.07	5,975,323
2023091503082	S	USDMXN	09/19/2023	(50,000)	17.07	853,737
2023091503111	S	USDMXN	09/19/2023	(2,000,000)	17.10	34,201,140
2023091503149	S	USDMXN	09/19/2023	(1,000,000)	17.09	17,090,000
2023091503228	S	USDMXN	09/19/2023	(1,000,000)	17.08	17,080,000
2023091503236	S	USDMXN	09/19/2023	(1,000,000)	17.09	17,093,550
2023091503321	S	USDMXN	09/19/2023	(660)	17.08	11,271
2023091503556	S	USDMXN	09/19/2023	(665,000)	17.05	11,341,243
2023091503562	S	USDMXN	09/19/2023	(50,000)	17.05	852,496
2023091503566	S	USDMXN	09/19/2023	(450,000)	17.05	7,672,460
2023091503569	S	USDMXN	09/19/2023	(500,000)	17.05	8,524,940
2023091503614	S	USDMXN	09/19/2023	(25,000)	17.06	426,611
2023091503689	S	USDMXN	09/19/2023	(2,000,000)	17.07	34,138,000
2023091503745	S	USDMXN	09/19/2023	(196,000)	17.08	3,346,704
2023091503748	S	USDMXN	09/19/2023	(134,631)	17.07	2,298,819
2023091503751	S	USDMXN	09/19/2023	(113,600)	17.07	1,939,433
2023091503753	S	USDMXN	09/19/2023	(135,830)	17.07	2,318,353
2022111503650	B	USDMXN	09/20/2023	384,896	20.46	(7,876,416)
2022111703243	BO	USDMXN	09/20/2023	958,110	20.55	(19,690,090)
2022111703764	B	USDMXN	09/20/2023	1,533,266	20.54	(31,489,849)
2022111803523	B	USDMXN	09/20/2023	295,450	20.58	(6,081,209)
2022112903731	B	USDMXN	09/20/2023	95,585	20.31	(1,941,551)
2023010403593	B	USDMXN	09/20/2023	559,750	20.32	(11,374,493)
2023011903684	BO	USDMXN	09/20/2023	38,426	19.92	(765,364)
2023012603549	B	USDMXN	09/20/2023	516,687	19.65	(10,153,750)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023020103658	B	USDMXN	09/20/2023	52,887	19.43	(1,027,471)
2023021003700	BO	USDMXN	09/20/2023	1,038,656	19.48	(20,236,736)
2023022103719	BO	USDMXN	09/20/2023	128,318	19.22	(2,466,295)
2023032903474	BO	USDMXN	09/20/2023	61,500	18.73	(1,151,690)
2023041303257	B	USDMXN	09/20/2023	236,535	18.59	(4,397,400)
2023042003529	B	USDMXN	09/20/2023	166,616	18.60	(3,099,565)
2023051703574	BO	USDMXN	09/20/2023	73,431	18.00	(1,321,997)
2023071403465	BO	USDMXN	09/20/2023	48,614	16.99	(825,866)
2023072403385	BO	USDMXN	09/20/2023	176,000	17.00	(2,992,872)
2023072403603	BO	USDMXN	09/20/2023	43,408	17.02	(739,002)
2023072403604	BO	USDMXN	09/20/2023	592	17.02	(10,073)
2023072803730	B	USDMXN	09/20/2023	108,000	16.83	(1,817,238)
2023080803591	B	USDMXN	09/20/2023	53,200	17.25	(917,459)
2023081403492	BO	USDMXN	09/20/2023	46,200	17.16	(792,703)
2023081803608	BO	USDMXN	09/20/2023	97,700	17.14	(1,674,953)
2023082403669	BO	USDMXN	09/20/2023	66,400	16.89	(1,121,797)
2023082503641	B	USDMXN	09/20/2023	50,000	16.81	(840,602)
2023082903393	BO	USDMXN	09/20/2023	20,331	16.90	(343,692)
2023082903656	BO	USDMXN	09/20/2023	36,000	16.84	(606,215)
2023083103420	SO	USDMXN	09/20/2023	(49,000)	16.81	823,919
2023091103358	BO	USDMXN	09/20/2023	23,625	17.35	(409,793)
2023091203669	B	USDMXN	09/20/2023	386,304	17.27	(6,669,604)
2023091803134	B	USDMXN	09/20/2023	2,650,000	17.13	(45,394,500)
2023091803180	B	USDMXN	09/20/2023	1,000,000	17.12	(17,120,300)
2023091803064	S	USDMXN	09/20/2023	(20,000,000)	17.14	342,895,000
2023091803196	S	USDMXN	09/20/2023	(1,000,000)	17.14	17,136,200
2023091803231	S	USDMXN	09/20/2023	(380)	17.12	6,507
2022120103173	B	USDMXN	09/21/2023	1,840,909	20.17	(37,134,574)
2023032803542	BO	USDMXN	09/21/2023	100,000	18.87	(1,886,795)
2023042603474	BO	USDMXN	09/21/2023	5,000,000	18.62	(93,112,565)
2023042603476	BO	USDMXN	09/21/2023	4,339,775	18.65	(80,933,658)
2023051503840	BO	USDMXN	09/21/2023	62,635	17.91	(1,121,781)
2023062703528	B	USDMXN	09/21/2023	60,000	17.37	(1,042,268)
2023070503359	BO	USDMXN	09/21/2023	60,000	17.25	(1,034,722)
2023071903274	BO	USDMXN	09/21/2023	30,000	16.96	(508,728)
2023081003014	B	USDMXN	09/21/2023	15,000,000	17.08	(256,205,561)
2023081703561	BO	USDMXN	09/21/2023	60,000	17.20	(1,031,944)
2023082103213	B	USDMXN	09/21/2023	500,000	17.11	(8,556,231)
2023082303446	BO	USDMXN	09/21/2023	6,000	16.89	(101,349)
2023082903330	BO	USDMXN	09/21/2023	10,739	16.89	(181,404)
2023091203318	BO	USDMXN	09/21/2023	15,427	17.28	(266,580)
2023091303535	BO	USDMXN	09/21/2023	6,904	17.17	(118,508)
2023091903061	B	USDMXN	09/21/2023	665,000	17.09	(11,366,579)
2023091903287	B	USDMXN	09/21/2023	3,500,000	17.06	(59,710,000)
2023091903679	B	USDMXN	09/21/2023	19,423	17.07	(331,528)
2023091903106	S	USDMXN	09/21/2023	(5,000,000)	17.09	85,450,000
2023091903110	S	USDMXN	09/21/2023	(20,000,000)	17.09	341,800,000
2023091903170	S	USDMXN	09/21/2023	(10,000,000)	17.06	170,622,600
2023091903427	S	USDMXN	09/21/2023	(350,000)	17.08	5,978,595
2023091903430	S	USDMXN	09/21/2023	(250,000)	17.09	4,271,900
2023091903432	S	USDMXN	09/21/2023	(250,000)	17.09	4,271,900
2023091903434	S	USDMXN	09/21/2023	(250,000)	17.09	4,271,925
2023091903436	S	USDMXN	09/21/2023	(400,000)	17.09	6,834,000
2023091903438	S	USDMXN	09/21/2023	(250,000)	17.08	4,271,150
2023091903441	S	USDMXN	09/21/2023	(450,000)	17.08	7,688,115
2023091903443	S	USDMXN	09/21/2023	(250,000)	17.08	4,271,075
2023091903445	S	USDMXN	09/21/2023	(50,000)	17.09	854,355
2023091903447	S	USDMXN	09/21/2023	(50,000)	17.09	854,365
2023091903449	S	USDMXN	09/21/2023	(100,000)	17.09	1,708,600

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091903451	S	USDMXN	09/21/2023	(1,330,000)	17.09	22,725,843
2023091903453	S	USDMXN	09/21/2023	(100,000)	17.08	1,708,380
2023091903456	S	USDMXN	09/21/2023	(85,000)	17.08	1,452,167
2023091903654	S	USDMXN	09/21/2023	(1,600,000)	17.08	27,320,000
2023091903663	S	USDMXN	09/21/2023	(3,400,000)	17.07	58,044,800
2023092003241	B	USDMXN	09/21/2023	3,850,000	17.04	(65,585,992)
2022062403537	B	USDMXN	09/22/2023	1,450,000	21.66	(31,400,954)
2022062403571	B	USDMXN	09/22/2023	1,460,000	21.66	(31,617,512)
2022062403542	S	USDMXN	09/22/2023	(1,450,000)	21.66	31,405,624
2022062403574	S	USDMXN	09/22/2023	(10,000)	21.66	216,620
2022070603467	SO	USDMXN	09/22/2023	(236)	22.46	5,292
2023011103210	BO	USDMXN	09/22/2023	2,200,000	19.92	(43,829,549)
2023030203470	BO	USDMXN	09/22/2023	100,000	18.82	(1,882,337)
2023050203110	B	USDMXN	09/22/2023	250,000	18.56	(4,641,023)
2023052903439	B	USDMXN	09/22/2023	300,000	17.99	(5,397,962)
2023072103051	BO	USDMXN	09/22/2023	983,000	17.10	(16,807,017)
2023072103344	S	USDMXN	09/22/2023	(925,550)	17.14	15,864,357
2023080403441	BO	USDMXN	09/22/2023	300,000	17.20	(5,160,165)
2023083103721	SO	USDMXN	09/22/2023	(282,000)	16.98	4,787,378
2023092003150	B	USDMXN	09/22/2023	1,550,000	17.03	(26,397,275)
2023092003430	B	USDMXN	09/22/2023	1,000,000	17.04	(17,035,300)
2023092003438	B	USDMXN	09/22/2023	1,000,000	17.03	(17,033,920)
2023092003154	S	USDMXN	09/22/2023	(200,000)	17.03	3,405,058
2023092003158	S	USDMXN	09/22/2023	(300,000)	17.03	5,108,256
2023092003160	S	USDMXN	09/22/2023	(200,000)	17.02	3,404,996
2023092003162	S	USDMXN	09/22/2023	(300,000)	17.02	5,107,206
2023092003164	S	USDMXN	09/22/2023	(300,000)	17.03	5,107,983
2023092003168	S	USDMXN	09/22/2023	(250,000)	17.03	4,257,593
2023092003242	S	USDMXN	09/22/2023	(3,850,000)	17.04	65,596,685
2023092003375	S	USDMXN	09/22/2023	(665,000)	17.02	11,317,835
2023092003528	S	USDMXN	09/22/2023	(1,000,000)	17.03	17,034,750
2023092003529	S	USDMXN	09/22/2023	(1,000,000)	17.04	17,035,500
2022102003405	BO	USDMXN	09/25/2023	200,000	21.36	(4,271,565)
2022102003480	B	USDMXN	09/25/2023	45,000	21.36	(961,317)
2022102003481	BO	USDMXN	09/25/2023	5,000	21.37	(106,825)
2023030303590	BO	USDMXN	09/25/2023	100,000	18.71	(1,870,664)
2023062603584	B	USDMXN	09/25/2023	6,082,167	17.43	(106,018,638)
2023062603488	S	USDMXN	09/25/2023	(250,000)	17.43	4,356,381
2023072103549	B	USDMXN	09/25/2023	200,000	17.17	(3,433,309)
2023072103545	S	USDMXN	09/25/2023	(500,000)	17.16	8,582,196
2023072603452	BO	USDMXN	09/25/2023	27,800	17.08	(474,749)
2023080103307	BO	USDMXN	09/25/2023	2,066,896	17.07	(35,284,500)
2023082803522	B	USDMXN	09/25/2023	3,249,322	16.85	(54,742,267)
2023082903659	S	USDMXN	09/25/2023	(200,000)	16.85	3,370,148
2023090703503	SO	USDMXN	09/25/2023	(278,000)	17.64	4,904,198
2023092103356	B	USDMXN	09/25/2023	19,500	17.17	(334,734)
2023092103358	B	USDMXN	09/25/2023	19,500	17.16	(334,698)
2023092103361	B	USDMXN	09/25/2023	19,500	17.16	(334,710)
2023092103363	B	USDMXN	09/25/2023	19,500	17.16	(334,714)
2023092103365	B	USDMXN	09/25/2023	15,600	17.16	(267,703)
2023092103368	B	USDMXN	09/25/2023	15,600	17.17	(267,798)
2023092103370	B	USDMXN	09/25/2023	15,600	17.17	(267,820)
2023092103372	B	USDMXN	09/25/2023	15,600	17.16	(267,761)
2023092103374	B	USDMXN	09/25/2023	15,600	17.16	(267,756)
2023092103376	B	USDMXN	09/25/2023	19,500	17.16	(334,699)
2023092103620	B	USDMXN	09/25/2023	2,000,000	17.22	(34,440,000)
2023092103657	B	USDMXN	09/25/2023	200,636	17.24	(3,459,209)
2023092103707	B	USDMXN	09/25/2023	956,885	17.23	(16,488,373)
2023092103238	S	USDMXN	09/25/2023	(175,500)	17.18	3,015,090



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092103671	S	USDMXN	09/25/2023	(6,157,521)	17.24	106,138,298
2023032803540	BO	USDMXN	09/26/2023	100,000	18.89	(1,888,677)
2023040503443	BO	USDMXN	09/26/2023	150,000	18.73	(2,809,536)
2023041003239	B	USDMXN	09/26/2023	153,846	18.79	(2,891,165)
2023050203401	B	USDMXN	09/26/2023	81,818	18.54	(1,517,036)
2023050503429	BO	USDMXN	09/26/2023	95,238	18.27	(1,739,673)
2023071403636	BO	USDMXN	09/26/2023	378,258	16.97	(6,418,601)
2023072703528	BO	USDMXN	09/26/2023	30,000	16.91	(507,155)
2023072803557	S	USDMXN	09/26/2023	(1,340,262)	16.87	22,612,801
2023080203400	B	USDMXN	09/26/2023	138,940	17.17	(2,385,947)
2023080403392	S	USDMXN	09/26/2023	(1,840,944)	17.20	31,666,269
2023080903393	B	USDMXN	09/26/2023	825,302	17.20	(14,198,202)
2023081503512	B	USDMXN	09/26/2023	522,090	17.23	(8,998,021)
2023081703582	B	USDMXN	09/26/2023	137,976	17.26	(2,381,975)
2023082403624	B	USDMXN	09/26/2023	407,042	16.89	(6,876,526)
2023082903648	S	USDMXN	09/26/2023	(1,411,995)	16.86	23,806,712
2023090503620	S	USDMXN	09/26/2023	(4,487,969)	17.51	78,581,294
2023090503624	S	USDMXN	09/26/2023	(3,080,938)	17.51	53,934,973
2023090503628	S	USDMXN	09/26/2023	(942,161)	17.51	16,499,149
2023090503630	S	USDMXN	09/26/2023	(277,198)	17.51	4,854,077
2023090503634	S	USDMXN	09/26/2023	(211,734)	17.51	3,706,981
2023090603331	S	USDMXN	09/26/2023	(5,000,000)	17.65	88,235,725
2023090703490	SO	USDMXN	09/26/2023	(264,000)	17.63	4,653,148
2023091103641	B	USDMXN	09/26/2023	649,167	17.35	(11,262,733)
2023091403711	S	USDMXN	09/26/2023	(340,575)	17.14	5,836,760
2023091403713	S	USDMXN	09/26/2023	(515,232)	17.14	8,830,017
2023091403718	S	USDMXN	09/26/2023	(1,612,126)	17.14	27,633,859
2023092203634	B	USDMXN	09/26/2023	3,000,000	17.18	(51,553,320)
2023092203580	S	USDMXN	09/26/2023	(665,000)	17.16	11,411,733
2023092203616	S	USDMXN	09/26/2023	(3,000,000)	17.17	51,510,000
2022112303551	SO	USDMXN	09/27/2023	(385,950)	20.47	7,901,983
2023011203252	B	USDMXN	09/27/2023	500,000	19.75	(9,875,557)
2023011703074	B	USDMXN	09/27/2023	500,000	19.69	(9,844,602)
2023051503420	BO	USDMXN	09/27/2023	500,000	18.01	(9,006,582)
2023061403318	BO	USDMXN	09/27/2023	2,600,000	17.50	(45,509,553)
2023061603180	BO	USDMXN	09/27/2023	90,840	17.45	(1,584,884)
2023061603203	BO	USDMXN	09/27/2023	320	17.43	(5,576)
2023062703334	BO	USDMXN	09/27/2023	15,200	17.41	(264,688)
2023071403466	BO	USDMXN	09/27/2023	48,614	17.01	(826,986)
2023071403515	B	USDMXN	09/27/2023	25,000,000	16.99	(424,659,745)
2023071403676	B	USDMXN	09/27/2023	1,190,804	16.96	(20,197,432)
2023071403673	S	USDMXN	09/27/2023	(1,190,804)	16.96	20,199,670
2023072403386	BO	USDMXN	09/27/2023	124,800	17.03	(2,125,036)
2023072803732	B	USDMXN	09/27/2023	108,000	16.85	(1,819,616)
2023080203031	BO	USDMXN	09/27/2023	59,200	17.18	(1,017,226)
2023081703654	BO	USDMXN	09/27/2023	112,800	17.24	(1,944,662)
2023081803526	BO	USDMXN	09/27/2023	23,600	17.15	(404,679)
2023082203399	B	USDMXN	09/27/2023	48,000,000	17.03	(817,507,483)
2023082303513	B	USDMXN	09/27/2023	60,000	16.89	(1,013,266)
2023082503786	BO	USDMXN	09/27/2023	49,050	16.85	(826,280)
2023082503801	BO	USDMXN	09/27/2023	49,050	16.85	(826,385)
2023082803482	BO	USDMXN	09/27/2023	52,200	16.85	(879,562)
2023082903394	BO	USDMXN	09/27/2023	83,131	16.93	(1,407,050)
2023083103699	B	USDMXN	09/27/2023	100,000	17.07	(1,706,739)
2023083103723	BO	USDMXN	09/27/2023	68,381	17.08	(1,167,872)
2023091403467	B	USDMXN	09/27/2023	169,640	17.12	(2,903,519)
2023092003517	BO	USDMXN	09/27/2023	375,368	17.02	(6,389,129)
2023092503111	B	USDMXN	09/27/2023	1,000,000	17.36	(17,358,250)
2023092503126	S	USDMXN	09/27/2023	(1,000,000)	17.36	17,357,500

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092503197	S	USDMXN	09/27/2023	(48,000,000)	17.38	834,273,600
2023092603481	S	USDMXN	09/27/2023	(25,000,000)	17.49	437,125,000
2022093003617	BO	USDMXN	09/28/2023	200,000	21.48	(4,296,768)
2022120103170	B	USDMXN	09/28/2023	1,840,909	20.20	(37,184,288)
2022121303343	S	USDMXN	09/28/2023	(199,621)	20.67	4,125,570
2022122703509	SO	USDMXN	09/28/2023	(41,934)	20.45	857,675
2022122703510	SO	USDMXN	09/28/2023	(159,983)	20.48	3,276,248
2023010303407	S	USDMXN	09/28/2023	(202,431)	20.38	4,125,141
2023031403372	BO	USDMXN	09/28/2023	757,467	19.35	(14,656,920)
2023032803543	BO	USDMXN	09/28/2023	100,000	18.89	(1,889,428)
2023032903544	BO	USDMXN	09/28/2023	25,000	18.75	(468,864)
2023051503839	BO	USDMXN	09/28/2023	62,635	17.94	(1,123,386)
2023062603492	S	USDMXN	09/28/2023	(200,000)	17.43	3,486,870
2023070503360	BO	USDMXN	09/28/2023	60,000	17.27	(1,036,088)
2023072103542	S	USDMXN	09/28/2023	(200,000)	17.17	3,434,775
2023072703529	BO	USDMXN	09/28/2023	20,000	16.91	(338,231)
2023081003184	B	USDMXN	09/28/2023	15,000,000	17.08	(256,137,564)
2023081603482	B	USDMXN	09/28/2023	200,000	17.20	(3,439,413)
2023081703563	BO	USDMXN	09/28/2023	60,000	17.22	(1,033,306)
2023082903329	BO	USDMXN	09/28/2023	29,959	16.92	(506,792)
2023091203689	BO	USDMXN	09/28/2023	60,000	17.28	(1,036,971)
2023091903601	BO	USDMXN	09/28/2023	24,000	17.09	(410,208)
2023092003516	BO	USDMXN	09/28/2023	25,406	17.02	(432,508)
2023092603078	B	USDMXN	09/28/2023	1,000,000	17.44	(17,435,780)
2023092603085	B	USDMXN	09/28/2023	1,000,000	17.42	(17,423,140)
2023092603248	B	USDMXN	09/28/2023	1,000,000	17.51	(17,506,650)
2023092603270	B	USDMXN	09/28/2023	1,000,000	17.48	(17,482,990)
2023092603482	B	USDMXN	09/28/2023	25,000,000	17.49	(437,196,250)
2023092603642	B	USDMXN	09/28/2023	1,000,000	17.55	(17,551,000)
2023092603657	B	USDMXN	09/28/2023	4,063,078	17.55	(71,290,603)
2023092603184	S	USDMXN	09/28/2023	(2,000,000)	17.47	34,937,120
2023092603195	S	USDMXN	09/28/2023	(1,000,000)	17.46	17,462,830
2023092603205	S	USDMXN	09/28/2023	(1,000,000)	17.46	17,464,650
2023092603627	S	USDMXN	09/28/2023	(1,000,000)	17.54	17,543,880
2023092603640	S	USDMXN	09/28/2023	(1,000,000)	17.55	17,550,000
2023092603646	S	USDMXN	09/28/2023	(1,000,000)	17.55	17,550,690
2023092603650	S	USDMXN	09/28/2023	(2,063,078)	17.55	36,206,977
2023092603673	S	USDMXN	09/28/2023	(240)	17.53	4,208
2022070103351	S	USDMXN	09/29/2023	(127,000)	22.11	2,808,043
2022092903525	BO	USDMXN	09/29/2023	237	21.59	(5,117)
2022100303430	SO	USDMXN	09/29/2023	(14,462)	21.37	309,082
2022100503299	B	USDMXN	09/29/2023	640,000	21.48	(13,748,597)
2022110103577	B	USDMXN	09/29/2023	3,590,000	20.97	(75,264,896)
2023030203471	BO	USDMXN	09/29/2023	100,000	18.85	(1,884,960)
2023031003611	SO	USDMXN	09/29/2023	(125,000)	19.21	2,401,850
2023031403115	SO	USDMXN	09/29/2023	(125,000)	19.84	2,480,307
2023041303560	B	USDMXN	09/29/2023	2,000,000	18.62	(37,244,870)
2023041303628	BO	USDMXN	09/29/2023	60,700	18.61	(1,129,829)
2023050203112	B	USDMXN	09/29/2023	250,000	18.59	(4,647,293)
2023060503423	BO	USDMXN	09/29/2023	69,080	17.86	(1,233,766)
2023061403682	B	USDMXN	09/29/2023	4,000,000	17.46	(69,835,448)
2023070303489	B	USDMXN	09/29/2023	192,800	17.34	(3,343,852)
2023072103050	BO	USDMXN	09/29/2023	983,000	17.12	(16,829,569)
2023072103346	S	USDMXN	09/29/2023	(925,631)	17.16	15,887,694
2023072803342	BO	USDMXN	09/29/2023	50,000	16.83	(841,440)
2023081403487	BO	USDMXN	09/29/2023	600,000	17.18	(10,308,509)
2023081603485	B	USDMXN	09/29/2023	131,000	17.20	(2,253,620)
2023081603618	BO	USDMXN	09/29/2023	375,000	17.27	(6,477,658)
2023081703292	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.21	(9,897,011)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023081803132	BO	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.18	(9,877,310)
2023081803518	BO	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.14	(9,855,075)
2023082103136	BO	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.15	(9,863,660)
2023082103607	B	USDMXN	09/29/2023	200,000	17.12	(3,423,927)
2023082203154	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.02	(9,786,938)
2023082203449	BO	USDMXN	09/29/2023	275,000	17.03	(4,682,691)
2023082203501	BO	USDMXN	09/29/2023	575,000	17.04	(9,798,451)
2023082303439	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.92	(9,726,964)
2023082503288	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.87	(9,703,072)
2023082803189	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.82	(9,670,035)
2023082803453	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.85	(9,689,758)
2023082903108	B	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.94	(9,738,386)
2023082903137	B	USDMXN	09/29/2023	30,000,000	16.94	(508,155,060)
2023082903660	B	USDMXN	09/29/2023	200,000	16.86	(3,372,655)
2023083003137	BO	USDMXN	09/29/2023	575,000	16.85	(9,687,369)
2023083103810	B	USDMXN	09/29/2023	5,497,000	17.09	(93,938,860)
2023083103830	SO	USDMXN	09/29/2023	(29,397)	17.07	501,877
2023091103078	S	USDMXN	09/29/2023	(178,000)	17.51	3,117,067
2023092503566	BO	USDMXN	09/29/2023	137,613	17.43	(2,398,234)
2023092703351	B	USDMXN	09/29/2023	1,000,000	17.72	(17,717,800)
2023092703548	B	USDMXN	09/29/2023	1,000,000	17.66	(17,659,100)
2023092703643	B	USDMXN	09/29/2023	2,316,958	17.69	(40,980,963)
2023092703152	S	USDMXN	09/29/2023	(1,000,000)	17.65	17,654,500
2023092703169	S	USDMXN	09/29/2023	(1,000,000)	17.67	17,669,700
2023092703404	S	USDMXN	09/29/2023	(1,000,000)	17.76	17,763,100
2023092703557	S	USDMXN	09/29/2023	(1,000,000)	17.70	17,697,200
2023092703564	S	USDMXN	09/29/2023	(1,000,000)	17.70	17,702,100
2023092703621	S	USDMXN	09/29/2023	(316,958)	17.67	5,600,109
2023092803058	S	USDMXN	09/29/2023	(11,000,000)	17.64	194,073,000
2023033003455	S	USDMXN	07/03/2023	(30,000,000)	18.40	551,940,000
2023042703395	B	USDMXN	07/03/2023	10,000,000	18.29	(182,865,000)
2023042803610	S	USDMXN	07/03/2023	(30,000,000)	18.22	546,465,000
2023053103010	B	USDMXN	07/03/2023	30,000,000	17.76	(532,800,000)
2023053103684	S	USDMXN	07/03/2023	(10,000,000)	17.81	178,060,000
2023062903018	B	USDMXN	07/03/2023	65,881	17.10	(1,126,458)
2023062903057	B	USDMXN	07/03/2023	40,000,000	17.13	(685,392,000)
2023062903679	S	USDMXN	07/03/2023	(20,000,000)	17.11	342,160,000
2023063003014	B	USDMXN	07/03/2023	934,119	17.07	(15,948,502)
2023063003605	B	USDMXN	07/03/2023	3,000,000	17.13	(51,386,400)
2023063003610	B	USDMXN	07/03/2023	3,000,000	17.13	(51,386,400)
2023050303588	B	USDMXN	07/05/2023	10,000,000	18.15	(181,500,000)
2023060103587	S	USDMXN	07/05/2023	(20,000,000)	17.68	353,574,000
2023063003108	B	USDMXN	07/05/2023	30,000,000	17.12	(513,600,000)
2023063003015	S	USDMXN	07/05/2023	(934,119)	17.08	15,954,387
2023070303007	B	USDMXN	07/05/2023	934,119	17.07	(15,941,706)
2023070503256	S	USDMXN	07/05/2023	(40,700,000)	17.00	691,900,000
2023060203284	BON	USDMXN	07/06/2023	40,000,000	17.59	(703,540,000)
2023060203096	S	USDMXN	07/06/2023	(20,000,000)	17.56	351,290,000
2023070303294	BO	USDMXN	07/06/2023	0	17.07	(20,810,000)
2023070303335	B	USDMXN	07/06/2023	10,000,000	17.06	(170,620,000)
2023070303008	S	USDMXN	07/06/2023	(934,119)	17.07	15,944,205
2023070303293	SON	USDMXN	07/06/2023	(40,000,000)	17.59	703,540,000
2023070403029	B	USDMXN	07/06/2023	20,425,000	17.03	(347,878,600)
2023070503006	B	USDMXN	07/06/2023	509,119	17.00	(8,656,949)
2023070503257	B	USDMXN	07/06/2023	40,700,000	17.00	(692,018,030)
2023070603524	B	USDMXN	07/06/2023	17,923,726	17.29	(309,901,227)
2023070603219	S	USDMXN	07/06/2023	(41,000,000)	17.21	705,692,000
2023070603576	S	USDMXN	07/06/2023	(17,938,251)	17.28	309,901,227
2023060503204	BON	USDMXN	07/07/2023	35,000,000	17.58	(615,272,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023060503208	S	USDMXN	07/07/2023	(80,000,000)	17.61	1,408,960,000
2023060503210	S	USDMXN	07/07/2023	(80,000,000)	17.60	1,408,296,000
2023060503484	S	USDMXN	07/07/2023	(30,000,000)	17.57	527,130,000
2023060603255	SO	USDMXN	07/07/2023	(80,000,000)	17.61	1,408,960,000
2023070503203	BO	USDMXN	07/07/2023	0	17.01	(19,887,000)
2023070503214	B	USDMXN	07/07/2023	20,000,000	17.01	(340,220,000)
2023070503007	S	USDMXN	07/07/2023	(509,119)	17.01	8,658,391
2023070503202	SON	USDMXN	07/07/2023	(35,000,000)	17.58	615,272,000
2023070503250	S	USDMXN	07/07/2023	(7,000,000)	17.01	119,073,500
2023070503615	S	USDMXN	07/07/2023	(30,000,000)	17.01	510,360,000
2023070603044	B	USDMXN	07/07/2023	509,119	17.18	(8,748,912)
2023070603220	B	USDMXN	07/07/2023	41,000,000	17.21	(705,802,700)
2023070603577	B	USDMXN	07/07/2023	17,935,344	17.28	(309,901,227)
2023070603525	S	USDMXN	07/07/2023	(17,920,824)	17.29	309,901,227
2023070703001	B	USDMXN	07/07/2023	28,920,280	17.24	(498,585,627)
2023070703006	B	USDMXN	07/07/2023	28,920,280	17.24	(498,585,627)
2023070703241	B	USDMXN	07/07/2023	28,920,280	17.24	(498,585,627)
2023070703266	B	USDMXN	07/07/2023	79,720	17.09	(1,362,115)
2023070703183	S	USDMXN	07/07/2023	(88,000,000)	17.11	1,505,680,000
2023070703195	S	USDMXN	07/07/2023	(29,000,000)	17.12	496,480,000
2023070703244	S	USDMXN	07/07/2023	(29,000,000)	17.12	496,480,000
2023040403411	S	USDMXN	07/10/2023	(10,000,000)	18.45	184,480,000
2023050403263	S	USDMXN	07/10/2023	(20,000,000)	18.18	363,530,000
2023060603162	BON	USDMXN	07/10/2023	45,000,000	17.55	(789,849,000)
2023060603107	S	USDMXN	07/10/2023	(25,000,000)	17.57	439,275,000
2023060603266	S	USDMXN	07/10/2023	(30,000,000)	17.53	525,765,000
2023060703498	B	USDMXN	07/10/2023	10,000,000	17.45	(174,545,000)
2023062903323	B	USDMXN	07/10/2023	30,000,000	17.13	(513,975,000)
2023070603235	BO	USDMXN	07/10/2023	0	17.22	(14,971,500)
2023070603045	S	USDMXN	07/10/2023	(509,119)	17.19	8,753,240
2023070603234	SON	USDMXN	07/10/2023	(45,000,000)	17.55	789,849,000
2023070603387	S	USDMXN	07/10/2023	(5,000,000)	17.33	86,645,000
2023070703008	B	USDMXN	07/10/2023	509,119	17.17	(8,740,302)
2023070703184	B	USDMXN	07/10/2023	88,000,000	17.12	(1,506,447,360)
2023070703196	B	USDMXN	07/10/2023	29,000,000	17.13	(496,738,100)
2023070703245	B	USDMXN	07/10/2023	29,000,000	17.13	(496,738,100)
2023070703002	S	USDMXN	07/10/2023	(28,907,034)	17.25	498,585,627
2023070703007	S	USDMXN	07/10/2023	(28,907,034)	17.25	498,585,627
2023070703242	S	USDMXN	07/10/2023	(28,907,034)	17.25	498,585,627
2023070703267	S	USDMXN	07/10/2023	(79,720)	17.09	1,362,579
2023070703268	S	USDMXN	07/10/2023	(13,246)	17.09	226,314
2023071003373	S	USDMXN	07/10/2023	(23,452,000)	17.06	399,973,860
2023071003376	S	USDMXN	07/10/2023	(30,958,000)	17.06	527,988,690
2023071003434	S	USDMXN	07/10/2023	(34,990,000)	17.05	596,579,500
2023050903279	S	USDMXN	07/11/2023	(30,000,000)	17.98	539,310,000
2023050903283	S	USDMXN	07/11/2023	(10,000,000)	17.98	179,752,000
2023070703269	B	USDMXN	07/11/2023	13,246	17.09	(226,353)
2023070703376	B	USDMXN	07/11/2023	30,000,000	17.11	(513,270,000)
2023070703009	S	USDMXN	07/11/2023	(509,119)	17.17	8,741,581
2023070703378	S	USDMXN	07/11/2023	(20,000,000)	17.10	342,000,000
2023071003144	B	USDMXN	07/11/2023	495,873	17.07	(8,462,758)
2023071003349	B	USDMXN	07/11/2023	20,000,000	17.06	(341,100,000)
2023071003374	B	USDMXN	07/11/2023	23,452,000	17.06	(400,044,216)
2023071003377	B	USDMXN	07/11/2023	30,958,000	17.06	(528,081,564)
2023071003435	B	USDMXN	07/11/2023	34,990,000	17.05	(596,684,470)
2023050903114	BON	USDMXN	07/12/2023	40,000,000	17.98	(719,228,000)
2023051003030	B	USDMXN	07/12/2023	10,000,000	17.87	(178,680,000)
2023071003155	BO	USDMXN	07/12/2023	0	17.07	(36,368,000)
2023071003158	B	USDMXN	07/12/2023	30,000,000	17.07	(512,145,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023071003274	B	USDMXN	07/12/2023	26,217,304	17.05	(447,005,027)
2023071003145	S	USDMXN	07/12/2023	(495,873)	17.07	8,464,110
2023071003154	SON	USDMXN	07/12/2023	(40,000,000)	17.98	719,228,000
2023071003350	S	USDMXN	07/12/2023	(20,000,000)	17.06	341,158,000
2023071003566	S	USDMXN	07/12/2023	(10,000,000)	17.06	170,630,000
2023071103027	B	USDMXN	07/12/2023	278,570	17.07	(4,755,063)
2023060903103	S	USDMXN	07/13/2023	(25,000,000)	17.41	435,312,500
2023071003275	S	USDMXN	07/13/2023	(26,212,691)	17.05	447,005,027
2023071103028	S	USDMXN	07/13/2023	(278,570)	17.07	4,755,879
2023071203037	B	USDMXN	07/13/2023	491,261	16.84	(8,271,484)
2023071203556	B	USDMXN	07/13/2023	55,000,000	16.88	(928,180,000)
2023071303363	S	USDMXN	07/13/2023	(50,000,000)	16.96	847,900,000
2023071203040	B	USDMXN	07/14/2023	17,450,000	16.99	(296,423,150)
2023071203038	S	USDMXN	07/14/2023	(491,261)	16.84	8,272,885
2023071203042	S	USDMXN	07/14/2023	(17,450,000)	16.82	293,509,000
2023071203054	S	USDMXN	07/14/2023	(33,063,945)	16.83	556,300,877
2023071203147	S	USDMXN	07/14/2023	(2,995,944)	16.86	50,496,630
2023071203557	S	USDMXN	07/14/2023	(55,000,000)	16.88	928,342,250
2023071303173	B	USDMXN	07/14/2023	551,150	16.90	(9,317,105)
2023071303234	B	USDMXN	07/14/2023	81,000,000	16.91	(1,369,710,000)
2023071303364	B	USDMXN	07/14/2023	50,000,000	16.96	(848,050,000)
2023071303365	S	USDMXN	07/14/2023	(30,000,000)	16.96	508,710,000
2023071403047	S	USDMXN	07/14/2023	(30,000,000)	16.85	505,470,000
2023051103470	S	USDMXN	07/17/2023	(30,000,000)	17.83	535,035,000
2023051203553	B	USDMXN	07/17/2023	30,000,000	17.81	(534,411,000)
2023071203055	B	USDMXN	07/17/2023	33,045,483	16.83	(556,300,877)
2023071203148	B	USDMXN	07/17/2023	2,994,274	16.86	(50,496,630)
2023071303366	B	USDMXN	07/17/2023	30,000,000	16.97	(508,980,000)
2023071303174	S	USDMXN	07/17/2023	(551,150)	16.91	9,321,596
2023071303235	S	USDMXN	07/17/2023	(81,000,000)	16.92	1,370,422,800
2023071403044	B	USDMXN	07/17/2023	511,393	16.86	(8,623,398)
2023071403048	B	USDMXN	07/17/2023	30,000,000	16.86	(505,728,000)
2023071403050	B	USDMXN	07/17/2023	15,000,000	16.86	(252,900,000)
2023071703084	S	USDMXN	07/17/2023	(45,400,000)	16.87	765,898,000
2022071403121	S	USDMXN	07/18/2023	(10,000,000)	22.49	224,900,000
2023071403045	S	USDMXN	07/18/2023	(511,393)	16.87	8,624,799
2023071403051	S	USDMXN	07/18/2023	(15,000,000)	16.86	252,943,500
2023071403355	S	USDMXN	07/18/2023	(4,997,915)	16.79	83,890,000
2023071703085	B	USDMXN	07/18/2023	45,400,000	16.87	(766,029,660)
2023071703089	B	USDMXN	07/18/2023	509,308	16.83	(8,570,120)
2023071703327	B	USDMXN	07/18/2023	30,000,000	16.77	(503,100,000)
2023071803359	S	USDMXN	07/18/2023	(40,000,000)	16.75	670,120,000
2023071403356	B	USDMXN	07/19/2023	4,997,022	16.79	(83,890,000)
2023071703090	S	USDMXN	07/19/2023	(509,308)	16.83	8,571,551
2023071703328	S	USDMXN	07/19/2023	(30,000,000)	16.77	503,188,500
2023071803004	B	USDMXN	07/19/2023	512,286	16.73	(8,572,061)
2023071803291	B	USDMXN	07/19/2023	55,000,000	16.74	(920,645,000)
2023071803360	B	USDMXN	07/19/2023	40,000,000	16.76	(670,242,000)
2023071903118	S	USDMXN	07/19/2023	(30,000,000)	16.78	503,400,000
2023071803275	B	USDMXN	07/20/2023	19,950,000	16.71	(333,404,400)
2023071803005	S	USDMXN	07/20/2023	(512,286)	16.74	8,573,572
2023071803270	S	USDMXN	07/20/2023	(9,970,149)	16.75	167,000,000
2023071803292	S	USDMXN	07/20/2023	(55,000,000)	16.74	920,810,000
2023071803385	S	USDMXN	07/20/2023	(30,000,000)	16.76	502,650,000
2023071903002	B	USDMXN	07/20/2023	532,436	16.76	(8,921,224)
2023071903119	B	USDMXN	07/20/2023	30,000,000	16.78	(503,487,000)
2023071903271	B	USDMXN	07/20/2023	45,000,000	16.77	(754,650,000)
2023041903264	S	USDMXN	07/21/2023	(10,000,000)	18.39	183,920,000
2023062003438	BON	USDMXN	07/21/2023	35,000,000	17.25	(603,760,500)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023062803561	S	USDMXN	07/21/2023	(35,000,000)	17.14	599,935,000
2023071803271	B	USDMXN	07/21/2023	9,968,364	16.75	(167,000,000)
2023071903124	BO	USDMXN	07/21/2023	0	16.77	(16,915,500)
2023071903128	B	USDMXN	07/21/2023	25,000,000	16.77	(419,175,000)
2023071903003	S	USDMXN	07/21/2023	(532,436)	16.76	8,922,768
2023071903062	S	USDMXN	07/21/2023	(9,200,761)	16.78	154,342,758
2023071903123	SON	USDMXN	07/21/2023	(35,000,000)	17.25	603,760,500
2023071903272	S	USDMXN	07/21/2023	(45,000,000)	16.77	754,778,250
2023072003028	B	USDMXN	07/21/2023	764,832	16.77	(12,824,867)
2023072003475	B	USDMXN	07/21/2023	84,000,000	16.87	(1,417,080,000)
2023072103184	S	USDMXN	07/21/2023	(35,700,000)	16.91	603,687,000
2023051803242	S	USDMXN	07/24/2023	(10,000,000)	17.97	179,675,000
2023051803245	S	USDMXN	07/24/2023	(10,000,000)	17.97	179,675,000
2023051903518	S	USDMXN	07/24/2023	(15,000,000)	17.99	269,872,500
2023052203461	B	USDMXN	07/24/2023	50,000,000	18.14	(906,800,000)
2023052203677	B	USDMXN	07/24/2023	50,000,000	18.14	(906,800,000)
2023062903324	S	USDMXN	07/24/2023	(30,000,000)	17.18	515,346,000
2023071903063	B	USDMXN	07/24/2023	9,195,772	16.78	(154,342,758)
2023072003029	S	USDMXN	07/24/2023	(764,832)	16.78	12,831,513
2023072003476	S	USDMXN	07/24/2023	(84,000,000)	16.88	1,417,810,800
2023072103056	B	USDMXN	07/24/2023	569,060	16.91	(9,622,892)
2023072103178	B	USDMXN	07/24/2023	50,000,000	16.93	(846,250,000)
2023072103185	B	USDMXN	07/24/2023	35,700,000	16.92	(603,997,590)
2023072103284	B	USDMXN	07/24/2023	40,000,000	16.96	(678,200,000)
2023072103182	S	USDMXN	07/24/2023	(40,000,000)	16.93	677,200,000
2023042103051	B	USDMXN	07/25/2023	20,000,000	18.34	(366,740,000)
2023052303229	B	USDMXN	07/25/2023	30,000,000	18.23	(546,750,000)
2023052303235	B	USDMXN	07/25/2023	30,000,000	18.23	(546,750,000)
2023062303433	BON	USDMXN	07/25/2023	40,000,000	17.29	(691,768,000)
2023072103149	BO	USDMXN	07/25/2023	0	16.94	(14,228,000)
2023072103598	B	USDMXN	07/25/2023	17,058,624	16.97	(289,484,848)
2023072103057	S	USDMXN	07/25/2023	(569,060)	16.91	9,624,457
2023072103147	SON	USDMXN	07/25/2023	(40,000,000)	17.29	691,768,000
2023072103179	S	USDMXN	07/25/2023	(50,000,000)	16.93	846,392,500
2023072103285	S	USDMXN	07/25/2023	(40,000,000)	16.96	678,314,000
2023072403002	S	USDMXN	07/25/2023	(489,564)	16.91	8,278,010
2023072403075	S	USDMXN	07/25/2023	(13,588,706)	16.85	228,969,696
2023072403079	S	USDMXN	07/25/2023	(2,411,294)	16.84	40,607,228
2023072503042	S	USDMXN	07/25/2023	(45,000,000)	16.87	758,925,000
2023072103599	S	USDMXN	07/26/2023	(17,055,709)	16.97	289,484,848
2023072403003	B	USDMXN	07/26/2023	489,564	16.91	(8,279,454)
2023072403076	B	USDMXN	07/26/2023	13,586,368	16.85	(228,969,696)
2023072403080	B	USDMXN	07/26/2023	2,411,294	16.84	(40,614,390)
2023072403573	B	USDMXN	07/26/2023	10,000,000	16.85	(168,460,000)
2023072403364	S	USDMXN	07/26/2023	(12,209,232)	16.82	205,298,228
2023072503003	B	USDMXN	07/26/2023	2,777,715	16.86	(46,844,502)
2023072503043	B	USDMXN	07/26/2023	45,000,000	16.87	(759,060,000)
2023072503162	S	USDMXN	07/26/2023	(30,000,000)	16.93	507,750,000
2023072603070	S	USDMXN	07/26/2023	(68,200,000)	16.88	1,150,875,000
2023072103183	B	USDMXN	07/27/2023	40,000,000	16.94	(677,556,000)
2023072403365	B	USDMXN	07/27/2023	12,207,126	16.82	(205,298,228)
2023072503006	B	USDMXN	07/27/2023	30,000,000	16.87	(506,100,000)
2023072503163	B	USDMXN	07/27/2023	30,000,000	16.93	(507,840,000)
2023072503569	B	USDMXN	07/27/2023	30,000,000	16.91	(507,240,000)
2023072503004	S	USDMXN	07/27/2023	(2,777,715)	16.87	46,852,557
2023072503577	S	USDMXN	07/27/2023	(20,000,000)	16.92	338,300,000
2023072603000	B	USDMXN	07/27/2023	570,589	16.90	(9,640,345)
2023072603071	B	USDMXN	07/27/2023	68,200,000	16.88	(1,151,070,052)
2023072603334	B	USDMXN	07/27/2023	11,020,758	16.89	(186,085,500)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023072603340	B	USDMXN	07/27/2023	570,589	16.88	(9,632,288)
2023072603078	S	USDMXN	07/27/2023	(39,000,000)	16.89	658,515,000
2023072603197	S	USDMXN	07/27/2023	(11,033,827)	16.87	186,085,500
2023072603345	S	USDMXN	07/27/2023	(557,520)	16.88	9,409,570
2023072603079	B	USDMXN	07/28/2023	39,000,000	16.89	(658,630,050)
2023072603198	B	USDMXN	07/28/2023	11,031,930	16.87	(186,085,500)
2023072603346	B	USDMXN	07/28/2023	557,520	16.88	(9,411,267)
2023072603580	B	USDMXN	07/28/2023	15,000,000	16.84	(252,645,000)
2023072603001	S	USDMXN	07/28/2023	(570,589)	16.90	9,641,986
2023072603335	S	USDMXN	07/28/2023	(11,018,866)	16.89	186,085,500
2023072603341	S	USDMXN	07/28/2023	(570,589)	16.88	9,633,883
2023072703117	B	USDMXN	07/28/2023	3,570,594	16.77	(59,872,070)
2023072703131	S	USDMXN	07/28/2023	(40,000,000)	16.77	670,600,000
2023072703466	S	USDMXN	07/28/2023	(37,000,000)	16.77	620,564,000
2023072803442	S	USDMXN	07/28/2023	(11,983,000)	16.69	199,996,270
2023072803607	S	USDMXN	07/28/2023	(13,817,000)	16.67	230,329,390
2023072703132	B	USDMXN	07/31/2023	40,000,000	16.77	(670,908,000)
2023072703467	B	USDMXN	07/31/2023	37,000,000	16.78	(620,860,000)
2023072703118	S	USDMXN	07/31/2023	(3,570,594)	16.78	59,898,136
2023072703760	S	USDMXN	07/31/2023	(20,000,000)	16.88	337,600,000
2023072803009	B	USDMXN	07/31/2023	570,594	16.69	(9,524,733)
2023072803443	B	USDMXN	07/31/2023	11,983,000	16.70	(200,090,936)
2023072803608	B	USDMXN	07/31/2023	13,817,000	16.68	(230,444,071)
2023073103267	B	USDMXN	07/31/2023	200,000,000	16.73	(3,346,000,000)
2023073103269	S	USDMXN	07/31/2023	(200,000,000)	16.73	3,346,000,000
2023072803010	S	USDMXN	08/01/2023	(570,594)	16.70	9,526,231
2023073103057	B	USDMXN	08/01/2023	570,594	16.73	(9,548,079)
2023073103270	B	USDMXN	08/01/2023	200,000,000	16.73	(3,346,620,000)
2023073103313	B	USDMXN	08/01/2023	16,000,000	16.73	(267,680,000)
2023073103268	S	USDMXN	08/01/2023	(200,000,000)	16.73	3,346,620,000
2022083103241	B	USDMXN	08/02/2023	10,000,000	21.47	(214,695,000)
2023050203054	BON	USDMXN	08/02/2023	25,000,000	18.34	(458,600,000)
2023073103175	BO	USDMXN	08/02/2023	0	16.70	(41,037,500)
2023073103709	B	USDMXN	08/02/2023	10,000,000	16.75	(167,450,000)
2023073103058	S	USDMXN	08/02/2023	(570,594)	16.74	9,549,511
2023073103174	SON	USDMXN	08/02/2023	(25,000,000)	18.34	458,600,000
2023073103176	S	USDMXN	08/02/2023	(20,000,000)	16.70	333,920,000
2023073103179	S	USDMXN	08/02/2023	(15,000,000)	16.71	250,575,000
2023073103314	S	USDMXN	08/02/2023	(16,000,000)	16.73	267,723,200
2023080103000	B	USDMXN	08/02/2023	570,594	16.84	(9,609,618)
2023080103416	B	USDMXN	08/02/2023	43,000,000	16.89	(726,270,000)
2023080103527	B	USDMXN	08/02/2023	40,000,000	16.87	(674,600,000)
2023060103184	BON	USDMXN	08/03/2023	40,000,000	17.77	(710,628,000)
2023062903680	B	USDMXN	08/03/2023	20,000,000	17.21	(344,190,000)
2023080103140	BO	USDMXN	08/03/2023	0	16.80	(38,688,000)
2023080103195	B	USDMXN	08/03/2023	30,000,000	16.84	(505,140,000)
2023080103001	S	USDMXN	08/03/2023	(570,594)	16.84	9,611,078
2023080103139	SON	USDMXN	08/03/2023	(40,000,000)	17.77	710,628,000
2023080103417	S	USDMXN	08/03/2023	(43,000,000)	16.89	726,390,400
2023080103528	S	USDMXN	08/03/2023	(40,000,000)	16.87	674,710,000
2023080203001	B	USDMXN	08/03/2023	570,594	16.89	(9,636,769)
2023080203039	B	USDMXN	08/03/2023	13,000,000	16.97	(220,584,000)
2023050203102	S	USDMXN	08/04/2023	(30,000,000)	18.41	552,180,000
2023070303292	BON	USDMXN	08/04/2023	40,000,000	17.16	(686,452,000)
2023080203007	B	USDMXN	08/04/2023	30,000,000	16.92	(507,570,000)
2023080203121	B	USDMXN	08/04/2023	15,000,000	17.05	(255,780,000)
2023080203131	BO	USDMXN	08/04/2023	0	17.06	(4,232,000)
2023080203523	B	USDMXN	08/04/2023	10,000,000	17.03	(170,275,000)
2023080203533	B	USDMXN	08/04/2023	10,000,000	17.03	(170,275,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023080203002	S	USDMXN	08/04/2023	(570,594)	16.89	9,638,353
2023080203040	S	USDMXN	08/04/2023	(13,000,000)	16.97	220,621,050
2023080203130	SON	USDMXN	08/04/2023	(40,000,000)	17.16	686,452,000
2023080203332	S	USDMXN	08/04/2023	(20,000,000)	16.99	339,760,000
2023080303002	B	USDMXN	08/04/2023	570,594	17.24	(9,839,630)
2023080303465	B	USDMXN	08/04/2023	8,000,000	17.30	(138,416,000)
2023060103472	S	USDMXN	08/07/2023	(30,000,000)	17.78	533,475,000
2023063003109	S	USDMXN	08/07/2023	(30,000,000)	17.23	516,900,000
2023070303336	S	USDMXN	08/07/2023	(10,000,000)	17.17	171,655,000
2023080303323	B	USDMXN	08/07/2023	403,387	17.35	(7,000,000)
2023080303003	S	USDMXN	08/07/2023	(570,594)	17.25	9,844,394
2023080303466	S	USDMXN	08/07/2023	(8,000,000)	17.31	138,483,600
2023080403004	B	USDMXN	08/07/2023	167,207	17.11	(2,861,225)
2023080403006	B	USDMXN	08/07/2023	50,000,000	17.12	(855,750,000)
2023080403009	B	USDMXN	08/07/2023	28,000,000	17.13	(479,724,000)
2023080703177	S	USDMXN	08/07/2023	(11,000,000)	17.07	187,715,000
2023080703329	S	USDMXN	08/07/2023	(19,000,000)	17.05	324,026,000
2023050403541	B	USDMXN	08/08/2023	20,000,000	18.24	(364,800,000)
2023080403224	B	USDMXN	08/08/2023	30,000,000	17.02	(510,660,000)
2023080403326	B	USDMXN	08/08/2023	30,000,000	17.02	(510,660,000)
2023080403388	B	USDMXN	08/08/2023	10,000,000	17.04	(170,370,000)
2023080403005	S	USDMXN	08/08/2023	(167,207)	17.11	2,861,689
2023080403007	S	USDMXN	08/08/2023	(50,000,000)	17.12	855,895,000
2023080403010	S	USDMXN	08/08/2023	(28,000,000)	17.14	479,805,200
2023080403011	S	USDMXN	08/08/2023	(747,126)	17.40	13,000,000
2023080403221	S	USDMXN	08/08/2023	(25,000,000)	17.04	426,087,500
2023080703007	B	USDMXN	08/08/2023	914,333	17.07	(15,605,885)
2023080703178	B	USDMXN	08/08/2023	11,000,000	17.07	(187,744,700)
2023080703283	B	USDMXN	08/08/2023	18,000,000	17.05	(306,810,000)
2023080703330	B	USDMXN	08/08/2023	19,000,000	17.06	(324,077,300)
2023080803331	S	USDMXN	08/08/2023	(30,000,000)	17.15	514,500,000
2023073103180	B	USDMXN	08/09/2023	15,000,000	16.73	(250,875,000)
2023080703129	B	USDMXN	08/09/2023	10,000,000	17.05	(170,500,000)
2023080703172	B	USDMXN	08/09/2023	15,000,000	17.06	(255,960,000)
2023080703008	S	USDMXN	08/09/2023	(914,333)	17.07	15,608,486
2023080703284	S	USDMXN	08/09/2023	(18,000,000)	17.05	306,860,400
2023080803000	B	USDMXN	08/09/2023	914,333	17.21	(15,737,202)
2023080803046	B	USDMXN	08/09/2023	8,000,000	17.21	(137,640,000)
2023080803332	B	USDMXN	08/09/2023	30,000,000	17.15	(514,582,500)
2023080803472	S	USDMXN	08/09/2023	(40,000,000)	17.11	684,200,000
2023080903097	S	USDMXN	08/09/2023	(20,000,000)	17.08	341,600,000
2023060903478	BON	USDMXN	08/10/2023	35,000,000	17.53	(613,417,000)
2023080803198	BO	USDMXN	08/10/2023	0	17.21	(11,172,000)
2023080803212	B	USDMXN	08/10/2023	17,000,000	17.21	(292,519,000)
2023080803437	B	USDMXN	08/10/2023	351,247	17.08	(6,000,000)
2023080803473	B	USDMXN	08/10/2023	40,000,000	17.11	(684,314,000)
2023080803001	S	USDMXN	08/10/2023	(914,333)	17.21	15,739,602
2023080803047	S	USDMXN	08/10/2023	(8,000,000)	17.21	137,662,400
2023080803197	SON	USDMXN	08/10/2023	(35,000,000)	17.53	613,417,000
2023080803522	S	USDMXN	08/10/2023	(30,000,000)	17.09	512,700,000
2023080803543	S	USDMXN	08/10/2023	(25,000,000)	17.10	427,375,000
2023080903004	B	USDMXN	08/10/2023	563,086	17.12	(9,638,952)
2023080903098	B	USDMXN	08/10/2023	20,000,000	17.08	(341,655,000)
2023080903101	B	USDMXN	08/10/2023	28,000,000	17.09	(478,520,000)
2022080903291	S	USDMXN	08/11/2023	(35,000,000)	21.63	757,080,555
2023050903202	S	USDMXN	08/11/2023	(10,000,000)	18.09	180,855,000
2023080903103	B	USDMXN	08/11/2023	30,000,000	17.12	(513,510,000)
2023080903005	S	USDMXN	08/11/2023	(563,086)	17.12	9,640,430
2023080903102	S	USDMXN	08/11/2023	(28,000,000)	17.09	478,598,400

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023080903105	S	USDMXN	08/11/2023	(20,000,000)	17.10	341,960,000
2023081003007	B	USDMXN	08/11/2023	563,086	16.97	(9,554,799)
2023081003383	B	USDMXN	08/11/2023	63,000,000	16.95	(1,067,913,000)
2023060803589	S	USDMXN	08/14/2023	(10,000,000)	17.60	176,000,000
2023060903426	S	USDMXN	08/14/2023	(35,000,000)	17.48	611,638,433
2023081003127	B	USDMXN	08/14/2023	20,000,000	16.96	(339,200,000)
2023081003008	S	USDMXN	08/14/2023	(563,086)	16.98	9,559,402
2023081003384	S	USDMXN	08/14/2023	(63,000,000)	16.96	1,068,435,900
2023081103002	B	USDMXN	08/14/2023	563,086	17.05	(9,598,724)
2023081103235	B	USDMXN	08/14/2023	88,000,000	16.99	(1,495,120,000)
2022081103274	B	USDMXN	08/15/2023	30,000,000	21.30	(639,060,000)
2022081103277	B	USDMXN	08/15/2023	30,000,000	21.30	(639,090,000)
2023081103393	B	USDMXN	08/15/2023	382,375	17.00	(6,500,000)
2023081103003	S	USDMXN	08/15/2023	(563,086)	17.05	9,600,226
2023081103236	S	USDMXN	08/15/2023	(88,000,000)	16.99	1,495,359,800
2023081103452	S	USDMXN	08/15/2023	(20,000,000)	17.00	340,000,000
2023081403009	B	USDMXN	08/15/2023	180,711	17.08	(3,086,710)
2023081403130	B	USDMXN	08/15/2023	18,000,000	17.07	(307,260,000)
2022081203440	S	USDMXN	08/16/2023	(30,000,000)	20.79	623,550,000
2022081203454	S	USDMXN	08/16/2023	(30,000,000)	21.23	637,020,000
2023081403010	S	USDMXN	08/16/2023	(180,711)	17.08	3,087,209
2023081403131	S	USDMXN	08/16/2023	(18,000,000)	17.07	307,310,850
2023081503013	B	USDMXN	08/16/2023	180,711	17.13	(3,095,203)
2023081503042	B	USDMXN	08/16/2023	50,000,000	17.13	(856,500,000)
2023061603585	BON	USDMXN	08/17/2023	35,000,000	17.33	(606,410,000)
2023081503158	BO	USDMXN	08/17/2023	0	17.14	(6,510,000)
2023081503014	S	USDMXN	08/17/2023	(180,711)	17.13	3,095,703
2023081503043	S	USDMXN	08/17/2023	(50,000,000)	17.13	856,641,250
2023081503157	SON	USDMXN	08/17/2023	(35,000,000)	17.33	606,410,000
2023081503469	S	USDMXN	08/17/2023	(20,000,000)	17.10	341,940,000
2023081603005	B	USDMXN	08/17/2023	180,711	17.10	(3,090,148)
2023081603056	B	USDMXN	08/17/2023	30,000,000	17.08	(512,250,000)
2023081603113	B	USDMXN	08/17/2023	3,000,000	17.06	(51,165,188)
2023081603435	B	USDMXN	08/17/2023	1,296,250	17.08	(22,144,742)
2023081703050	B	USDMXN	08/17/2023	13,440,475	17.10	(229,832,130)
2023081703178	S	USDMXN	08/17/2023	(13,413,022)	17.14	229,832,130
2023081703191	S	USDMXN	08/17/2023	(27,454)	17.10	469,394
2023080903104	S	USDMXN	08/18/2023	(30,000,000)	17.14	514,113,000
2023081603189	B	USDMXN	08/18/2023	11,812,502	17.05	(201,403,165)
2023081603006	S	USDMXN	08/18/2023	(180,711)	17.10	3,090,643
2023081603057	S	USDMXN	08/18/2023	(30,000,000)	17.08	512,334,000
2023081603114	S	USDMXN	08/18/2023	(3,000,000)	17.06	51,173,400
2023081603436	S	USDMXN	08/18/2023	(1,296,250)	17.09	22,148,251
2023081703001	B	USDMXN	08/18/2023	180,711	17.08	(3,086,388)
2023081703179	B	USDMXN	08/18/2023	13,410,830	17.14	(229,832,130)
2023081703181	B	USDMXN	08/18/2023	50,000,000	17.10	(855,000,000)
2023081703192	B	USDMXN	08/18/2023	27,454	17.10	(469,475)
2023081703575	B	USDMXN	08/18/2023	43,000,000	17.14	(737,149,000)
2023081703051	S	USDMXN	08/18/2023	(13,438,275)	17.10	229,832,130
2023081803033	S	USDMXN	08/18/2023	(40,000,000)	17.06	682,400,000
2023051703594	S	USDMXN	08/21/2023	(20,000,000)	17.90	358,020,000
2023081603190	S	USDMXN	08/21/2023	(11,812,502)	17.06	201,501,947
2023081703002	S	USDMXN	08/21/2023	(180,711)	17.09	3,087,932
2023081703182	S	USDMXN	08/21/2023	(50,000,000)	17.11	855,435,000
2023081703576	S	USDMXN	08/21/2023	(43,000,000)	17.15	737,516,650
2023081803004	B	USDMXN	08/21/2023	180,711	17.08	(3,086,997)
2023081803008	B	USDMXN	08/21/2023	50,000,000	17.10	(854,750,000)
2023081803034	B	USDMXN	08/21/2023	40,000,000	17.07	(682,740,000)
2023081803549	B	USDMXN	08/21/2023	100,000,000	17.03	(1,703,000,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023081803585	S	USDMXN	08/21/2023	(50,000,000)	17.04	852,000,000
2023081803590	S	USDMXN	08/21/2023	(50,000,000)	17.04	852,000,000
2023082103210	S	USDMXN	08/21/2023	(20,000,000)	17.03	340,600,000
2023051803243	B	USDMXN	08/22/2023	10,000,000	18.07	(180,725,000)
2023051803246	B	USDMXN	08/22/2023	10,000,000	18.07	(180,725,000)
2023051803581	B	USDMXN	08/22/2023	30,000,000	18.04	(541,140,000)
2023080403382	S	USDMXN	08/22/2023	(20,000,000)	17.10	341,940,000
2023081803586	B	USDMXN	08/22/2023	50,000,000	17.04	(852,145,000)
2023081803591	B	USDMXN	08/22/2023	50,000,000	17.04	(852,145,000)
2023081803005	S	USDMXN	08/22/2023	(180,711)	17.08	3,087,426
2023081803009	S	USDMXN	08/22/2023	(50,000,000)	17.10	854,891,250
2023081803550	S	USDMXN	08/22/2023	(100,000,000)	17.03	1,703,285,000
2023082103000	B	USDMXN	08/22/2023	180,711	17.03	(3,076,905)
2023082103002	B	USDMXN	08/22/2023	30,000,000	17.04	(511,200,000)
2023082103211	B	USDMXN	08/22/2023	20,000,000	17.03	(340,656,000)
2023051903219	S	USDMXN	08/23/2023	(30,000,000)	18.06	541,650,000
2023082103001	S	USDMXN	08/23/2023	(180,711)	17.03	3,077,397
2023082103003	S	USDMXN	08/23/2023	(30,000,000)	17.04	511,284,000
2023082103437	S	USDMXN	08/23/2023	(10,000,000)	17.02	170,150,000
2023082203033	B	USDMXN	08/23/2023	180,711	16.93	(3,059,241)
2023082203142	B	USDMXN	08/23/2023	23,000,000	16.90	(388,700,000)
2023081503315	BO	USDMXN	08/24/2023	10,000	17.17	(171,696)
2023081503321	SO	USDMXN	08/24/2023	(10,000)	17.16	171,607
2023082203058	B	USDMXN	08/24/2023	17,650,000	16.95	(299,167,500)
2023082203034	S	USDMXN	08/24/2023	(180,711)	16.93	3,059,741
2023082203143	S	USDMXN	08/24/2023	(23,000,000)	16.90	388,764,400
2023082203560	S	USDMXN	08/24/2023	(30,000,000)	16.92	507,540,000
2023082303000	B	USDMXN	08/24/2023	530,711	16.86	(8,949,046)
2023082303106	B	USDMXN	08/24/2023	35,000,000	16.82	(588,700,000)
2023052303447	B	USDMXN	08/25/2023	20,000,000	18.31	(366,200,000)
2023082303341	B	USDMXN	08/25/2023	30,000,000	16.80	(504,000,000)
2023082303502	B	USDMXN	08/25/2023	40,000,000	16.81	(672,400,000)
2023082303001	S	USDMXN	08/25/2023	(530,711)	16.87	8,950,491
2023082303107	S	USDMXN	08/25/2023	(35,000,000)	16.82	588,797,125
2023082303109	S	USDMXN	08/25/2023	(25,000,000)	16.84	420,912,500
2023082403002	B	USDMXN	08/25/2023	530,711	16.83	(8,933,543)
2023042403579	S	USDMXN	08/28/2023	(10,000,000)	18.42	184,200,000
2023062603281	B	USDMXN	08/28/2023	30,000,000	17.32	(519,720,000)
2023072503007	S	USDMXN	08/28/2023	(30,000,000)	16.97	509,145,000
2023082403275	B	USDMXN	08/28/2023	4,760,771	16.82	(80,094,263)
2023082403527	B	USDMXN	08/28/2023	50,000,000	16.80	(840,100,000)
2023082403003	S	USDMXN	08/28/2023	(530,711)	16.84	8,937,648
2023082503004	B	USDMXN	08/28/2023	530,711	16.78	(8,904,292)
2023082803099	B	USDMXN	08/28/2023	3,000,000	16.72	(50,152,741)
2023082803405	S	USDMXN	08/28/2023	(37,000,000)	16.76	620,120,000
2023082803409	S	USDMXN	08/28/2023	(500,000)	16.77	8,382,500
2023082403276	S	USDMXN	08/29/2023	(4,760,771)	16.83	80,106,091
2023082503677	B	USDMXN	08/29/2023	11,040,000	16.75	(184,897,920)
2023082503005	S	USDMXN	08/29/2023	(530,711)	16.78	8,905,593
2023082803042	B	USDMXN	08/29/2023	530,711	16.72	(8,874,999)
2023082803114	B	USDMXN	08/29/2023	14,761,189	16.72	(246,807,080)
2023082803406	B	USDMXN	08/29/2023	37,000,000	16.76	(620,219,900)
2023082803410	B	USDMXN	08/29/2023	500,000	16.77	(8,383,875)
2023082803184	S	USDMXN	08/29/2023	(14,761,189)	16.72	246,807,080
2023072803265	BON	USDMXN	08/30/2023	20,000,000	16.73	(334,540,000)
2023082803185	B	USDMXN	08/30/2023	14,761,189	16.72	(246,846,935)
2023082803348	BO	USDMXN	08/30/2023	0	16.72	(75,000)
2023082803415	B	USDMXN	08/30/2023	10,000,000	16.77	(167,700,000)
2023082803043	S	USDMXN	08/30/2023	(530,711)	16.73	8,876,191

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023082803100	S	USDMXN	08/30/2023	(3,000,000)	16.72	50,166,300
2023082803115	S	USDMXN	08/30/2023	(14,758,806)	16.72	246,807,080
2023082803347	SON	USDMXN	08/30/2023	(20,000,000)	16.73	334,540,000
2023082903005	B	USDMXN	08/30/2023	528,328	16.85	(8,900,464)
2023082903144	B	USDMXN	08/30/2023	14,638,617	16.86	(246,807,080)
2023082903207	S	USDMXN	08/30/2023	(14,642,959)	16.86	246,807,080
2023053103351	BON	USDMXN	08/31/2023	30,000,000	18.08	(542,287,500)
2023053103396	BON	USDMXN	08/31/2023	30,000,000	18.08	(542,289,000)
2023072703761	B	USDMXN	08/31/2023	20,000,000	16.98	(339,530,000)
2023082903164	B	USDMXN	08/31/2023	10,000,000	16.88	(168,810,000)
2023082903167	B	USDMXN	08/31/2023	5,000,000	16.88	(84,405,000)
2023082903171	BO	USDMXN	08/31/2023	0	16.88	(35,859,000)
2023082903208	B	USDMXN	08/31/2023	14,640,614	16.86	(246,807,080)
2023082903006	S	USDMXN	08/31/2023	(528,328)	16.85	8,901,685
2023082903145	S	USDMXN	08/31/2023	(14,636,273)	16.86	246,807,080
2023082903170	SON	USDMXN	08/31/2023	(30,000,000)	18.08	542,289,000
2023082903654	S	USDMXN	08/31/2023	(15,000,000)	16.78	251,700,000
2023083003000	B	USDMXN	08/31/2023	523,986	16.75	(8,777,782)
2023083003142	S	USDMXN	08/31/2023	(50,000,000)	16.76	838,100,000
2023083103322	B	USDMXN	08/31/2023	70,000,000	16.89	(1,181,950,000)
2023083103315	S	USDMXN	08/31/2023	(90,000,000)	16.89	1,519,650,000
2023083103579	S	USDMXN	08/31/2023	(90,000,000)	16.89	1,519,650,000
2023083003143	B	USDMXN	09/01/2023	50,000,000	16.76	(838,237,500)
2023083003001	S	USDMXN	09/01/2023	(523,986)	16.75	8,779,025
2023083103004	B	USDMXN	09/01/2023	523,986	16.73	(8,766,055)
2023083103026	B	USDMXN	09/01/2023	10,716,774	16.74	(179,398,790)
2023083103316	B	USDMXN	09/01/2023	90,000,000	16.89	(1,519,929,000)
2023083103580	B	USDMXN	09/01/2023	90,000,000	16.89	(1,519,929,000)
2023083103283	S	USDMXN	09/01/2023	(10,616,884)	16.90	179,398,790
2023083103323	S	USDMXN	09/01/2023	(70,000,000)	16.89	1,182,167,000
2023083103372	S	USDMXN	09/01/2023	(99,890)	16.93	1,691,296
2023053103475	S	USDMXN	09/05/2023	(30,000,000)	18.01	540,240,000
2023080203008	S	USDMXN	09/05/2023	(30,000,000)	17.02	510,540,000
2023080203122	S	USDMXN	09/05/2023	(15,000,000)	17.15	257,287,500
2023082403528	S	USDMXN	09/05/2023	(50,000,000)	16.82	841,215,000
2023083103284	B	USDMXN	09/05/2023	10,610,134	16.91	(179,398,790)
2023083103373	B	USDMXN	09/05/2023	99,890	16.94	(1,692,617)
2023083103005	S	USDMXN	09/05/2023	(523,986)	16.74	8,771,375
2023083103027	S	USDMXN	09/05/2023	(10,709,928)	16.75	179,398,790
2023090103008	B	USDMXN	09/05/2023	523,891	17.02	(8,914,377)
2023090103107	B	USDMXN	09/05/2023	50,000,000	17.07	(853,250,000)
2023080203132	BON	USDMXN	09/06/2023	40,000,000	17.16	(686,288,000)
2023090103269	BO	USDMXN	09/06/2023	0	17.13	(1,168,000)
2023090103496	B	USDMXN	09/06/2023	30,000,000	17.09	(512,550,000)
2023090103009	S	USDMXN	09/06/2023	(523,891)	17.02	8,915,626
2023090103017	S	USDMXN	09/06/2023	(20,000,000)	16.99	339,800,000
2023090103108	S	USDMXN	09/06/2023	(50,000,000)	17.07	853,391,250
2023090103268	SON	USDMXN	09/06/2023	(40,000,000)	17.16	686,288,000
2023090503000	B	USDMXN	09/06/2023	523,891	17.24	(9,033,254)
2023090503087	B	USDMXN	09/06/2023	10,000,000	17.32	(173,200,000)
2023090503094	S	USDMXN	09/06/2023	(30,000,000)	17.34	520,200,000
2023070503616	B	USDMXN	09/07/2023	30,000,000	17.22	(516,495,000)
2023070703387	BON	USDMXN	09/07/2023	15,000,000	17.30	(259,572,000)
2023090503095	B	USDMXN	09/07/2023	30,000,000	17.34	(520,281,000)
2023090503161	B	USDMXN	09/07/2023	10,000,000	17.39	(173,880,000)
2023090503001	S	USDMXN	09/07/2023	(523,891)	17.24	9,034,444
2023090503088	S	USDMXN	09/07/2023	(10,000,000)	17.32	173,226,500
2023090503158	SON	USDMXN	09/07/2023	(15,000,000)	17.30	259,572,000
2023090503159	SO	USDMXN	09/07/2023	0	17.39	1,248,000



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023090603007	B	USDMXN	09/07/2023	523,891	17.50	(9,165,511)
2023090603123	B	USDMXN	09/07/2023	55,000,000	17.58	(966,625,000)
2023060603577	S	USDMXN	09/08/2023	(20,000,000)	17.71	354,250,000
2023080403223	BON	USDMXN	09/08/2023	30,000,000	17.14	(514,161,000)
2023080403225	S	USDMXN	09/08/2023	(30,000,000)	17.12	513,540,000
2023080403327	S	USDMXN	09/08/2023	(30,000,000)	17.12	513,534,000
2023090603586	B	USDMXN	09/08/2023	30,000,000	17.57	(527,100,000)
2023090603008	S	USDMXN	09/08/2023	(523,891)	17.50	9,166,847
2023090603124	S	USDMXN	09/08/2023	(55,000,000)	17.58	966,773,500
2023090603137	SON	USDMXN	09/08/2023	(30,000,000)	17.14	514,161,000
2023090603138	SO	USDMXN	09/08/2023	0	17.58	13,171,500
2023090703010	B	USDMXN	09/08/2023	65,000,000	17.48	(1,136,200,000)
2023090703030	B	USDMXN	09/08/2023	523,891	17.52	(9,179,112)
2023090703093	B	USDMXN	09/08/2023	70,000,000	17.52	(1,226,400,000)
2023090703498	S	USDMXN	09/08/2023	(30,000,000)	17.59	527,550,000
2023060703448	B	USDMXN	09/11/2023	10,000,000	17.68	(176,750,000)
2023070703377	S	USDMXN	09/11/2023	(30,000,000)	17.31	519,330,000
2023080803544	B	USDMXN	09/11/2023	25,000,000	17.19	(429,845,000)
2023090703320	B	USDMXN	09/11/2023	30,000,000	17.59	(527,700,000)
2023090703499	B	USDMXN	09/11/2023	30,000,000	17.59	(527,796,000)
2023090703505	B	USDMXN	09/11/2023	30,000,000	17.59	(527,730,000)
2023090703514	B	USDMXN	09/11/2023	30,000,000	17.59	(527,730,000)
2023090703516	B	USDMXN	09/11/2023	20,000,000	17.59	(351,700,000)
2023090703011	S	USDMXN	09/11/2023	(65,000,000)	17.49	1,136,726,500
2023090703031	S	USDMXN	09/11/2023	(523,891)	17.53	9,183,281
2023090703094	S	USDMXN	09/11/2023	(70,000,000)	17.53	1,226,967,000
2023090703122	S	USDMXN	09/11/2023	(10,000,000)	17.55	175,480,000
2023090703508	S	USDMXN	09/11/2023	(20,000,000)	17.58	351,600,000
2023090703510	S	USDMXN	09/11/2023	(20,000,000)	17.59	351,700,000
2023090803012	B	USDMXN	09/11/2023	523,891	17.48	(9,157,517)
2023090803102	B	USDMXN	09/11/2023	50,000,000	17.47	(873,250,000)
2023071003567	B	USDMXN	09/12/2023	10,000,000	17.26	(172,645,000)
2023090803013	S	USDMXN	09/12/2023	(523,891)	17.48	9,158,868
2023090803103	S	USDMXN	09/12/2023	(50,000,000)	17.47	873,385,000
2023090803105	S	USDMXN	09/12/2023	(30,000,000)	17.45	523,590,000
2023090803510	S	USDMXN	09/12/2023	(20,000,000)	17.60	352,090,000
2023091103118	B	USDMXN	09/12/2023	523,891	17.46	(9,148,968)
2023091103485	B	USDMXN	09/12/2023	80,000,000	17.32	(1,385,640,000)
2023091203470	S	USDMXN	09/12/2023	(178,000)	17.24	3,068,844
2023081103607	BO	USDMXN	09/13/2023	24,850	17.11	(425,080)
2023091103119	S	USDMXN	09/13/2023	(523,891)	17.47	9,150,329
2023091103486	S	USDMXN	09/13/2023	(80,000,000)	17.32	1,385,856,000
2023091203008	B	USDMXN	09/13/2023	523,891	17.35	(9,091,779)
2023091203297	B	USDMXN	09/13/2023	80,000,000	17.26	(1,380,800,000)
2023091203471	B	USDMXN	09/13/2023	178,000	17.24	(3,069,347)
2023091203464	B	USDMXN	09/14/2023	30,000,000	17.25	(517,440,000)
2023091203492	B	USDMXN	09/14/2023	30,000,000	17.25	(517,350,000)
2023091203009	S	USDMXN	09/14/2023	(523,891)	17.36	9,093,120
2023091203298	S	USDMXN	09/14/2023	(80,000,000)	17.26	1,381,014,000
2023091303055	B	USDMXN	09/14/2023	523,891	17.16	(8,987,425)
2023091303266	B	USDMXN	09/14/2023	15,000,000	17.12	(256,770,000)
2023091303056	S	USDMXN	09/15/2023	(523,891)	17.16	8,988,761
2023091303267	S	USDMXN	09/15/2023	(15,000,000)	17.12	256,810,500
2023091303465	S	USDMXN	09/15/2023	(30,000,000)	17.16	514,725,000
2023091403076	B	USDMXN	09/15/2023	523,891	17.15	(8,985,951)
2023091403103	B	USDMXN	09/15/2023	50,000,000	17.14	(857,050,000)
2023091403575	S	USDMXN	09/15/2023	(30,000,000)	17.09	512,550,000
2023091403576	B	USDMXN	09/18/2023	30,000,000	17.09	(512,796,000)
2023091403587	B	USDMXN	09/18/2023	40,000,000	17.09	(683,600,000)



External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023091403077	S	USDMXN	09/18/2023	(523,891)	17.16	8,990,071
2023091403104	S	USDMXN	09/18/2023	(50,000,000)	17.15	857,455,000
2023091403592	S	USDMXN	09/18/2023	(40,000,000)	17.09	683,600,000
2023091503003	B	USDMXN	09/18/2023	923,891	17.07	(15,772,643)
2023091503035	B	USDMXN	09/18/2023	30,000,000	17.10	(513,000,000)
2023091503057	B	USDMXN	09/18/2023	18,000,000	17.07	(307,260,000)
2023091503059	B	USDMXN	09/18/2023	20,000,000	17.07	(341,400,000)
2023091503061	B	USDMXN	09/18/2023	22,000,000	17.07	(375,540,000)
2023091503131	B	USDMXN	09/18/2023	9,000,000	17.10	(153,918,000)
2023091503684	B	USDMXN	09/19/2023	20,000,000	17.07	(341,300,000)
2023091503004	S	USDMXN	09/19/2023	(923,891)	17.07	15,775,158
2023091503036	S	USDMXN	09/19/2023	(30,000,000)	17.10	513,085,500
2023091503058	S	USDMXN	09/19/2023	(18,000,000)	17.07	307,312,200
2023091503060	S	USDMXN	09/19/2023	(20,000,000)	17.07	341,458,000
2023091503062	S	USDMXN	09/19/2023	(22,000,000)	17.07	375,603,800
2023091503132	S	USDMXN	09/19/2023	(9,000,000)	17.10	153,943,200
2023091803070	B	USDMXN	09/19/2023	923,891	17.13	(15,829,356)
2023091803183	B	USDMXN	09/19/2023	29,000,000	17.12	(496,465,573)
2022051703177	B	USDMXN	09/20/2023	11,604,437	21.91	(254,230,000)
2022051703424	S	USDMXN	09/20/2023	(11,606,556)	21.90	254,230,000
2023041403237	B	USDMXN	09/20/2023	38,000,000	18.62	(707,560,000)
2023041403244	B	USDMXN	09/20/2023	38,000,000	18.62	(707,560,000)
2023041403303	S	USDMXN	09/20/2023	(30,000,000)	18.63	558,830,370
2023070603010	B	USDMXN	09/20/2023	20,000,000	17.32	(346,406,980)
2023070603185	S	USDMXN	09/20/2023	(20,000,000)	17.43	348,600,000
2023080203333	B	USDMXN	09/20/2023	20,000,000	17.14	(342,730,000)
2023080403383	B	USDMXN	09/20/2023	20,000,000	17.19	(343,800,000)
2023080903106	B	USDMXN	09/20/2023	20,000,000	17.22	(344,450,000)
2023091803072	S	USDMXN	09/20/2023	(923,891)	17.14	15,831,885
2023091803184	S	USDMXN	09/20/2023	(29,000,000)	17.12	496,543,800
2023091903005	B	USDMXN	09/20/2023	926,010	17.10	(15,839,226)
2023092003015	B	USDMXN	09/20/2023	2,000,000	17.03	(34,051,545)
2023092003396	B	USDMXN	09/20/2023	20,000,000	17.02	(340,300,000)
2023091903566	B	USDMXN	09/21/2023	30,000,000	17.08	(512,310,000)
2023091903006	S	USDMXN	09/21/2023	(926,010)	17.11	15,841,807
2023092003008	S	USDMXN	09/21/2023	(73,990)	17.03	1,260,090
2023092003012	S	USDMXN	09/21/2023	(18,000,000)	17.03	306,540,000
2022122003421	B	USDMXN	09/22/2023	34,833,998	20.81	(725,000,000)
2022122003412	S	USDMXN	09/22/2023	(34,793,876)	20.84	725,000,000
2023092003009	B	USDMXN	09/22/2023	73,990	17.03	(1,260,303)
2023092003013	B	USDMXN	09/22/2023	18,000,000	17.03	(306,590,850)
2023092003016	S	USDMXN	09/22/2023	(2,000,000)	17.03	34,062,200
2023092003397	S	USDMXN	09/22/2023	(20,000,000)	17.02	340,410,000
2023092103009	B	USDMXN	09/22/2023	32,300,000	17.16	(554,332,600)
2023092103113	B	USDMXN	09/22/2023	850,000	17.18	(14,603,737)
2023092103487	B	USDMXN	09/22/2023	32,282,350	17.16	(554,029,683)
2023092103490	B	USDMXN	09/22/2023	10,000	17.15	(171,540)
2023092103006	S	USDMXN	09/22/2023	(114,112)	17.19	1,961,320
2023092103034	S	USDMXN	09/22/2023	(32,300,000)	17.21	555,864,185
2023092103118	S	USDMXN	09/22/2023	(16,000,000)	17.18	274,880,000
2023060203532	B	USDMXN	09/25/2023	20,038,000	17.92	(359,011,470)
2023060203562	S	USDMXN	09/25/2023	(20,038,000)	17.80	356,720,484
2023070403030	S	USDMXN	09/25/2023	(20,425,000)	17.30	353,321,863
2023071203043	B	USDMXN	09/25/2023	17,450,000	17.06	(297,609,750)
2023071203041	S	USDMXN	09/25/2023	(17,450,000)	17.23	300,602,425
2023082303503	S	USDMXN	09/25/2023	(40,000,000)	16.90	676,108,000
2023092103007	B	USDMXN	09/25/2023	114,112	17.20	(1,962,300)
2023092103119	B	USDMXN	09/25/2023	16,000,000	17.19	(275,013,600)
2023092103114	S	USDMXN	09/25/2023	(850,000)	17.19	14,610,650

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2023092103491	S	USDMXN	09/25/2023	(10,000)	17.16	171,621
2023092203035	B	USDMXN	09/25/2023	320,888	17.11	(5,489,855)
2023092203408	B	USDMXN	09/25/2023	55,000,000	17.16	(943,965,000)
2023092503194	B	USDMXN	09/25/2023	48,545,164	17.38	(843,472,221)
2023092503158	S	USDMXN	09/25/2023	(48,433,662)	17.42	843,472,221
2023092503220	S	USDMXN	09/25/2023	(111,502)	17.37	1,937,180
2023092203482	B	USDMXN	09/26/2023	15,000,000	17.17	(257,550,000)
2023092203036	S	USDMXN	09/26/2023	(320,888)	17.11	5,490,718
2023092203409	S	USDMXN	09/26/2023	(55,000,000)	17.17	944,116,250
2023092503002	B	USDMXN	09/26/2023	320,888	17.35	(5,567,019)
2023092503083	B	USDMXN	09/26/2023	60,000,000	17.35	(1,041,000,000)
2023072503275	BON	USDMXN	09/27/2023	20,000,000	17.13	(342,564,000)
2023072503570	S	USDMXN	09/27/2023	(30,000,000)	17.11	513,210,000
2023092503159	B	USDMXN	09/27/2023	48,418,092	17.42	(843,472,221)
2023092503221	B	USDMXN	09/27/2023	111,502	17.38	(1,937,848)
2023092503003	S	USDMXN	09/27/2023	(320,888)	17.35	5,567,892
2023092503084	S	USDMXN	09/27/2023	(60,000,000)	17.35	1,041,169,500
2023092503195	S	USDMXN	09/27/2023	(48,529,383)	17.38	843,472,221
2023092503300	SON	USDMXN	09/27/2023	(20,000,000)	17.13	342,564,000
2023092503301	SO	USDMXN	09/27/2023	0	17.41	5,646,000
2023092603003	B	USDMXN	09/27/2023	320,677	17.40	(5,579,032)
2023092603123	B	USDMXN	09/27/2023	90,000,000	17.43	(1,568,250,000)
2023072603581	S	USDMXN	09/28/2023	(15,000,000)	17.04	255,615,000
2023092603260	B	USDMXN	09/28/2023	30,000,000	17.47	(524,190,000)
2023092603004	S	USDMXN	09/28/2023	(320,677)	17.40	5,579,905
2023092603124	S	USDMXN	09/28/2023	(90,000,000)	17.43	1,568,504,250
2023092703011	B	USDMXN	09/28/2023	320,677	17.60	(5,644,750)
2023092703153	B	USDMXN	09/28/2023	50,000,000	17.65	(882,500,000)
2023062803575	B	USDMXN	09/29/2023	20,000,000	17.38	(347,510,000)
2023082803351	BON	USDMXN	09/29/2023	20,000,000	16.81	(336,180,000)
2023082903655	B	USDMXN	09/29/2023	15,000,000	16.87	(252,978,000)
2023092103035	B	USDMXN	09/29/2023	32,300,000	17.23	(556,516,526)
2023092103010	S	USDMXN	09/29/2023	(32,300,000)	17.18	554,978,600
2023092103488	S	USDMXN	09/29/2023	(32,244,773)	17.18	554,029,683
2023092703087	B	USDMXN	09/29/2023	10,000,000	17.66	(176,645,000)
2023092703012	S	USDMXN	09/29/2023	(320,677)	17.61	5,645,644
2023092703135	SON	USDMXN	09/29/2023	(20,000,000)	16.81	336,180,000
2023092703136	SO	USDMXN	09/29/2023	0	17.66	17,110,000
2023092703154	S	USDMXN	09/29/2023	(50,000,000)	17.65	882,641,250
2023092703541	S	USDMXN	09/29/2023	(30,000,000)	17.70	531,000,000
2023092703546	S	USDMXN	09/29/2023	(10,000,000)	17.70	177,000,000
2023092803003	B	USDMXN	09/29/2023	541,075	17.67	(9,559,234)
2023092903671	B	USDMXN	09/29/2023	43,947,986	17.43	(765,881,551)
2023092903563	S	USDMXN	09/29/2023	(44,003,536)	17.41	765,881,551

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2097636	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097638	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097640	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097642	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097644	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097646	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097648	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2097650	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2098308	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2098312	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2098332	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2098336	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2098528	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2098532	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2098806	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098809	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098812	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098815	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098822	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098826	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098830	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098834	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098842	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098846	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098850	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098854	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098861	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098864	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098867	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2098870	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2099379	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099382	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099385	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099388	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099391	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099394	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099409	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099412	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099415	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099418	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099421	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099424	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099441	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099445	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099449	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099453	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099457	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099461	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099481	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099485	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099489	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099493	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099497	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099501	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2099537	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099541	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099545	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099573	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099577	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099581	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2099593	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099597	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099601	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099617	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099621	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099625	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2099705	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2099709	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2099713	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2099741	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2099745	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2099749	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100142	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100145	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100148	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100151	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100154	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100172	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100175	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100178	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100181	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100184	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2100205	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100209	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100213	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100229	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100233	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100237	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100322	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100326	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100330	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100358	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100362	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100366	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2100640	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100644	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100648	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100660	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100664	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100668	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100768	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100772	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100792	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100796	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2100816	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100820	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100840	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2100844	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2101253	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101255	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101256	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101257	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101259	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101260	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101261	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101263	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101264	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101297	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101299	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101300	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101301	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101303	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101304	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101305	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101307	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2101308	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,985
2101430	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101432	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101446	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101448	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2101518	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2101522	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2101542	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2101546	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2101566	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2101570	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2101590	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2101594	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101618	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2101622	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2101646	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2101650	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2101670	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2101674	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2101694	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2101698	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2101996	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102000	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102004	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102036	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102040	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102044	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2102078	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102082	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102086	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102174	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,281
2102249	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,281
2102268	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102272	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102292	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102296	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2102443	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102446	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102449	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102452	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102455	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102458	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102461	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102464	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102467	FX	20/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102470	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102473	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102476	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102479	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102482	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102485	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102488	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102491	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102494	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102497	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102500	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102503	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102509	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102512	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102515	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102518	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102521	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102524	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102527	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102530	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102533	FX	20/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102536	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102539	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102542	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102545	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102548	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102551	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102554	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102557	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102560	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102563	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102566	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102569	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2102584	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102587	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102590	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102593	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102596	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102599	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102602	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102605	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102608	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102611	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102614	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102617	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102620	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102674	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102677	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102680	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102683	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102686	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102689	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102692	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102695	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102698	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102701	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102704	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102707	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2102710	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2103204	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,000,000
2103207	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,000,000
2103430	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103432	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103433	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103435	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103436	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103438	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103439	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103441	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103442	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103444	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103445	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103447	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103448	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103450	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103451	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103453	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103454	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103456	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103457	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103459	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103460	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103462	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103463	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103465	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103466	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103468	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103574	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103576	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103577	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103579	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103580	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103582	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103583	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103585	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103586	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103588	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103589	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103591	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103592	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103594	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103595	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103597	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103598	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103600	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103601	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2103603	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103604	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103606	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103607	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103609	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103610	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2103612	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104013	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104015	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104016	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104017	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104019	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104020	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104021	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104023	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104024	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104061	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104063	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104064	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104065	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104067	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104068	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104069	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104071	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104072	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200
2104196	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2104200	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2104260	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2104264	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2104268	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104271	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104274	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104298	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104301	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104304	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104389	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104393	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104437	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104441	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104741	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104745	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104749	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104777	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104781	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2104785	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2104815	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104818	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104821	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104824	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104827	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104830	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104851	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104854	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104857	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104860	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104863	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104866	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2104868	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104870	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104871	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104873	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2104917	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104921	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104925	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104929	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104933	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104937	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104941	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104945	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104949	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104953	FX	01/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104957	FX	11/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104961	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2104965	FX	25/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105093	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105097	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105101	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105105	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105109	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105113	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105117	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105121	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105125	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105129	FX	01/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105133	FX	11/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105137	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105141	FX	25/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2105251	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105255	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105259	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105287	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105291	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105295	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105337	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105339	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105340	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105342	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105347	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105350	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105353	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105356	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105359	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105362	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105365	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105368	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105371	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105377	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105380	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105383	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105386	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105389	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105392	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105395	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105398	FX	21/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105401	FX	28/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2105624	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105627	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105630	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105633	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105636	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105639	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105642	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105645	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105648	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105663	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105666	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105669	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105672	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105675	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105678	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105681	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105684	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105687	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105701	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105703	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105704	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105706	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2105839	FX	14/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,500,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105879	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105881	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105882	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105884	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105885	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105887	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105888	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105890	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105891	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105893	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105894	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105896	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105897	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105899	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105900	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105902	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105903	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105905	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105906	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105908	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105909	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105911	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105912	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105914	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105915	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2105917	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106179	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106181	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106182	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106184	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106185	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106187	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106188	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106190	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106191	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106193	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106194	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106196	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106197	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106199	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106200	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106202	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106203	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106205	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106206	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106208	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106209	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106211	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106212	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106214	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106215	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106217	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106291	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106294	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106297	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106300	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106303	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106306	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106309	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106312	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106405	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2106408	FX	06/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2106417	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106420	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106423	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106426	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106429	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106432	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106435	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106438	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106441	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106444	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106447	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106450	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106453	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106456	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106547	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106549	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106551	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2106553	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106557	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106559	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106561	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106563	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106565	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106567	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2106571	FX	05/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106573	FX	02/08/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106575	FX	30/08/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106577	FX	05/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106579	FX	02/08/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106581	FX	30/08/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2106591	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106595	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106599	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106627	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106631	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106635	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2106663	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	750,000
2106665	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	750,000
2106667	FX	12/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	750,000
2106669	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	750,000
2106691	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2106694	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2106697	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2106699	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2106703	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2106705	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2106725	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106729	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106733	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106737	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106757	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106761	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106765	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106769	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2106777	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106781	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106785	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106801	FX	13/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106805	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106809	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2106863	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106867	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106871	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106875	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2106911	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	142,500
2106915	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	142,500
2106919	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	142,500
2106923	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	142,500
2106959	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2106963	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2106967	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2106971	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2107007	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,500
2107011	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,500
2107015	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,500
2107019	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,500



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107055	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	46,000
2107059	FX	17/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	46,000
2107063	FX	24/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	46,000
2107067	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	46,000
2107071	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107074	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107077	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107080	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107083	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107086	FX	11/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107089	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107092	FX	25/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107110	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107113	FX	11/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107116	FX	18/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107119	FX	25/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107152	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107155	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107173	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107176	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2107179	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107182	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107185	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107188	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107191	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107194	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107206	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107209	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107212	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107215	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107218	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107221	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107269	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107272	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107275	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107278	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107281	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107284	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107287	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107290	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107293	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107296	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107299	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107302	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107305	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107308	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107311	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107314	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107321	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107325	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107329	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107345	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107349	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107353	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107365	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107367	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107369	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107371	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107373	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107375	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107377	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107379	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107383	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107385	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107387	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107389	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107391	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107393	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107395	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107397	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107407	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107409	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107411	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107419	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107421	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107423	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107540	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107542	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107543	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107544	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107546	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107547	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107548	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107550	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107551	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107552	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107554	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107555	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107556	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107558	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107559	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107560	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107562	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107563	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107564	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107566	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107567	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107568	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107570	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107571	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107588	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107590	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107591	FX	03/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107592	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107594	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107595	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107596	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107598	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107599	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107600	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107602	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107603	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107604	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107606	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107607	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107608	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107610	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107611	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107612	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107614	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107615	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107616	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107618	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2107619	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,676
2107695	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107699	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107702	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107719	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107723	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107726	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2107739	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107742	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107745	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107754	FX	31/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107757	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107760	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107769	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	600,000
2107771	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	600,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107775	FX	07/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	600,000
2107777	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	600,000
2107781	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107783	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107785	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107787	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107789	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107791	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107793	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107795	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	800,000
2107805	FX	31/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,200,000
2107807	FX	01/09/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,200,000
2107811	FX	31/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,200,000
2107813	FX	01/09/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,200,000
2107816	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107821	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107826	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107831	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107841	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2107859	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	333,333
2107860	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	333,333
2107864	FX	05/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	333,333
2107865	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	333,333
2107891	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107896	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107901	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107906	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107911	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107916	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107921	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107926	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2107931	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2107936	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2107941	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	810,000
2107951	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	810,000
2107962	FX	07/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107968	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107980	FX	07/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2107986	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2108211	FX	19/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108215	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108270	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108272	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108273	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108275	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108278	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108282	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108286	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108288	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108289	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108290	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108294	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108298	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108300	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108301	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108302	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108304	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108305	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108306	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108310	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108312	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108313	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108330	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108332	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108333	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108335	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108338	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108342	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108346	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108348	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108349	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108350	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108354	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108358	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108360	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108361	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108362	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108364	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108365	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108366	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108370	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108372	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108373	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,509
2108391	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108394	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108398	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108402	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108404	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108405	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,499
2108406	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108411	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108414	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108416	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108417	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,488
2108418	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108420	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108421	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,478
2108422	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108426	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108428	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108429	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,890
2108447	FX	18/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108450	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108454	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108458	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108460	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108461	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,499
2108462	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108467	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108470	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108472	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108473	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,488
2108474	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108476	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108477	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,478
2108478	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108482	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108484	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108485	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,890
2108502	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108504	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108506	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108508	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108510	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108512	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108514	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108516	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108520	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,000
2108550	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108552	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108554	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108556	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108558	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108560	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108562	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108564	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108568	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	36,000
2108574	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108576	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108578	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108580	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108582	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108584	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108586	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108588	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108592	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000
2108768	FX	27/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108772	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108776	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2108788	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	450,000
2108796	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	450,000
2108807	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108814	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108834	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108841	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2108865	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108867	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108869	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108873	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108875	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108895	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108897	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108899	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108903	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108905	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2108925	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108927	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108929	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108973	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108975	FX	30/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2108977	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2109518	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109520	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109548	FX	13/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109550	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2109578	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109602	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109686	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2109710	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2097635	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097637	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097639	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097641	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097643	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097645	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097647	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2097649	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2098307	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098309	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098310	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,631
2098311	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098313	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098314	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,631
2098331	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098333	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098334	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,631
2098335	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098337	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2098338	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,631
2098527	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2098529	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2098530	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,973
2098531	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2098533	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2098534	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,973
2098805	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098807	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2098808	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098810	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098811	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098813	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098814	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098816	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098821	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098823	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098824	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098825	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098827	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098828	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098829	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098831	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098832	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098833	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098835	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098836	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098841	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098843	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098844	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098845	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098847	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098848	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098849	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098851	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098852	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098853	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098855	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098856	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,819
2098860	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098862	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098863	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098865	FX	03/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098866	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098868	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098869	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2098871	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2099378	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099380	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099381	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099383	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099384	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099386	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099387	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099389	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099390	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099392	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099393	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099395	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099408	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099410	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099411	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099413	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099414	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099416	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099417	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099419	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099420	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099422	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099423	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099425	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099440	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099442	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099443	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099444	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099446	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099447	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099448	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2099450	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099451	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099452	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099454	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099455	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099456	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099458	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099459	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099460	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099462	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099463	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099480	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099482	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099483	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099484	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099486	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099487	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099488	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099490	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099491	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099492	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099494	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099495	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099496	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099498	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099499	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099500	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099502	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2099503	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,638
2099536	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099538	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099539	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099540	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099542	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099543	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099544	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099546	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099547	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099572	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099574	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099575	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099576	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099578	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099579	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099580	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099582	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2099583	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,971
2099592	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099594	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099595	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099596	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099598	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099599	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099600	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099602	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099603	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099616	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099618	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099619	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099620	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099622	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099623	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099624	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099626	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2099627	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,845
2099704	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099706	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099707	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099708	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2099710	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099711	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099712	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099714	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099715	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099740	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099742	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099743	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099744	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099746	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099747	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2099748	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099750	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2099751	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,226
2100141	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100143	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100144	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100146	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100147	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100149	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100150	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100152	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100153	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100155	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100171	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100173	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100174	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100176	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100177	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100179	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100180	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100182	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100183	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100185	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2100204	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100206	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100207	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100208	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100210	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100211	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100212	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100214	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100215	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100228	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100230	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100231	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100232	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100234	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100235	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100236	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100238	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100239	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,188
2100321	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100323	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100324	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100325	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100327	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100328	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100329	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100331	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100332	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100357	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100359	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100360	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100361	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100363	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100364	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100365	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2100367	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2100368	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,222
2100639	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100641	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100642	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100643	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100645	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100646	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100647	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100649	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100650	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100659	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100661	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100662	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100663	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100665	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100666	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100667	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100669	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100670	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,622
2100767	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100769	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100770	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100771	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100773	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100774	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100791	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100793	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100794	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100795	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100797	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2100798	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	17,561
2100815	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100817	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100818	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100819	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100821	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100822	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100839	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100841	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100842	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2100843	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100845	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2100846	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,679
2101254	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101258	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101262	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101298	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101302	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101306	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101429	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101431	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101445	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101447	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2101517	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101519	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101520	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101521	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101523	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101524	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101541	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101543	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101544	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101545	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101547	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2101548	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,619
2101565	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101567	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101568	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101569	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2101571	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101572	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101589	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101591	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101592	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101593	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101595	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2101596	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,655
2101617	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101619	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101620	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101621	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101623	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101624	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101645	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101647	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101648	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101649	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101651	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2101652	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,584
2101669	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101671	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101672	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101673	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101675	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101676	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101693	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101695	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101696	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101697	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101699	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2101700	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,964
2101995	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101997	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2101998	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2101999	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102001	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102002	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102003	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102005	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102006	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102035	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102037	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102038	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102039	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102041	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102042	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102043	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102045	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2102046	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,772
2102077	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102079	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102080	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102081	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102083	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102084	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102085	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102087	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102088	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2102173	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102175	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102248	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102250	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,281
2102267	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102269	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102270	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,683
2102271	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102273	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2102274	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,683







Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2102706	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102708	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102709	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2102711	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2103203	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,000,000
2103205	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,000,000
2103206	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,000,000
2103208	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,000,000
2103431	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103434	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103437	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103440	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103443	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103446	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103449	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103452	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103455	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103458	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103461	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103464	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103467	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103575	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103578	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103581	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103584	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103587	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103590	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103593	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103596	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103599	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103602	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103605	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103608	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2103611	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104014	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104018	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104022	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104062	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104066	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104070	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104195	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104197	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104198	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104199	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104201	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104202	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104259	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104261	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104262	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104263	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104265	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2104266	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,944
2104267	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104269	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104270	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104272	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104273	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104275	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104297	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104299	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104300	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104302	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104303	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104305	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104388	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104390	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104391	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104392	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104394	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104395	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104436	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104438	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104439	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104440	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104442	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104443	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,077
2104740	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104742	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104743	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104744	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104746	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104747	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104748	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104750	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104751	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104776	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104778	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104779	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104780	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104782	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2104783	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,895
2104784	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104786	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2104787	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,947
2104814	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104816	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104817	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104819	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104820	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104822	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104823	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104825	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104826	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104828	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104829	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104831	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104850	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104852	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104853	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104855	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104856	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104858	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104859	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104861	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104862	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104864	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104865	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104867	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2104869	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104872	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2104916	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104918	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104919	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104920	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104922	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104923	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104924	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104926	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104927	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104928	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104930	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104931	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104932	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104934	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104935	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104936	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104938	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104939	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2104940	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104942	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104943	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104944	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104946	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104947	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104948	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104950	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104951	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104952	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104954	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104955	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104956	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104958	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104959	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104960	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104962	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104963	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2104964	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104966	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2104967	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105092	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105094	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105095	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105096	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105098	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105099	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105100	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105102	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105103	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105104	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105106	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105107	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105108	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105110	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105111	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105112	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105114	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105115	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105116	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105118	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105119	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105120	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105122	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105123	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105124	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105126	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105127	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105128	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105130	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105131	FX	01/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105132	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105134	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105135	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105136	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105138	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105139	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105140	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105142	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2105143	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,075
2105250	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105252	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105253	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105254	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105256	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105257	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105258	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105260	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105261	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105286	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105288	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105289	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105290	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105292	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105293	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105294	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105296	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105297	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,882
2105338	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105341	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105346	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105348	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105349	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105351	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105352	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105354	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105355	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105357	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105358	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105360	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105361	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105363	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105364	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105366	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105367	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105369	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105370	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105372	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105376	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105378	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105379	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105381	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105382	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105384	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105385	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105387	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105388	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105390	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105391	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105393	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105394	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105396	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105397	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105399	FX	21/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105400	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105402	FX	28/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2105623	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105625	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105626	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105628	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105629	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105631	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105632	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105634	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105635	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105637	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105638	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105640	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105641	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105643	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105644	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105646	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105647	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105649	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105662	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105664	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105665	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105667	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2105668	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105670	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105671	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105673	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105674	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105676	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105677	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105679	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105680	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105682	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105683	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105685	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105686	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105688	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105702	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105705	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2105838	FX	14/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,500,000
2105880	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105883	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105886	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105889	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105892	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105895	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105898	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105901	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105904	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105907	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105910	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105913	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2105916	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106180	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106183	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106186	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106189	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106192	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106195	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106198	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106201	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106204	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106207	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106210	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106213	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106216	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106290	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106292	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106293	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106295	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106296	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106298	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106299	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106301	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106302	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106304	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106305	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106307	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106308	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106310	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106311	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106313	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106380	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106383	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106386	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106389	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106404	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106406	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106407	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106409	FX	06/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106416	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106418	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106419	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106421	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106422	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106424	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106425	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106427	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106428	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106430	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106431	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106433	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106434	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106436	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106437	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106439	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106440	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106442	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106443	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106445	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106446	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106448	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106449	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106451	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106452	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106454	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106455	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106457	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106458	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,900,000
2106461	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,900,000
2106546	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106548	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106550	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2106552	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106556	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106558	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106560	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106562	FX	05/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106564	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106566	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2106570	FX	05/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106572	FX	02/08/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106574	FX	30/08/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106576	FX	05/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106578	FX	02/08/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106580	FX	30/08/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2106590	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106592	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106593	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106594	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106596	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106597	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106598	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106600	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106601	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106626	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106628	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106629	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106630	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106632	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106633	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106634	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106636	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2106637	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,630
2106662	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	750,000
2106664	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	750,000
2106666	FX	12/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	750,000
2106668	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	750,000
2106690	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106692	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106693	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106695	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2106696	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106698	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106700	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106701	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106702	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106704	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106706	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106707	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2106724	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106726	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106727	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,868
2106728	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106730	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106731	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,189
2106732	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106734	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106735	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,453
2106736	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106738	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106739	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,703
2106756	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106758	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106759	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,868
2106760	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106762	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106763	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,189
2106764	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106766	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106767	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,453
2106768	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106770	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2106771	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,703
2106776	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106778	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106779	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106780	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106782	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106783	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106784	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106786	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106787	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106800	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106802	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106803	FX	13/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106804	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106806	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106807	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106808	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106810	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2106811	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	16,216
2106862	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106864	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106865	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	856
2106866	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106868	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106869	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	856
2106870	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106872	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106873	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	856
2106874	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106876	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2106877	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	856
2106910	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106912	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106913	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106914	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106916	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106917	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2106918	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106920	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106921	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106922	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106924	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	142,500
2106925	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,516
2106958	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106960	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106961	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106962	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106964	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106965	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106966	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106968	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106969	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2106970	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106972	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2106973	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,789
2107006	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107008	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107009	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107010	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107012	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107013	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107014	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107016	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107017	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107018	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107020	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,500
2107021	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	269
2107054	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107056	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107057	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107058	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107060	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107061	FX	17/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107062	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107064	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107065	FX	24/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107066	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107068	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,000
2107069	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,458
2107070	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107072	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107073	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107075	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107076	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107078	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107079	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107081	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107082	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107084	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107085	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107087	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107088	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107090	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107091	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107093	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107109	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107111	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107112	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107114	FX	11/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107115	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107117	FX	18/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107118	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107120	FX	25/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107151	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107153	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107154	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107156	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107172	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107174	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107175	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107177	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2107178	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107180	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107181	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107183	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107184	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107186	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107187	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107189	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107190	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107192	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107193	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107195	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107205	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107207	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107208	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107210	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107211	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107213	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107214	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107216	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107217	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107219	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107220	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107222	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107268	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107270	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107271	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107273	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107274	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107276	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107277	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107279	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107280	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107282	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107283	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107285	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107286	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107288	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107289	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107291	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107292	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107294	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107295	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107297	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107298	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107300	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107301	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107303	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107304	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107306	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107307	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107309	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107310	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107312	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107313	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107315	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107320	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107322	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107323	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107324	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107326	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107327	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107328	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107330	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107331	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107344	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107346	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107347	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107348	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107350	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107351	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107352	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107354	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107355	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,348
2107364	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107366	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107368	FX	25/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107370	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107372	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107374	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107376	FX	22/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107378	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107382	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107384	FX	18/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107386	FX	25/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107388	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107390	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107392	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107394	FX	22/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107396	FX	29/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107406	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107408	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107410	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107418	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107420	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107422	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107541	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107545	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107549	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107553	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107557	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107561	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107565	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107569	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107589	FX	03/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107593	FX	11/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107597	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107601	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107605	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107609	FX	08/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107613	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107617	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2107694	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107696	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107697	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,432
2107698	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107700	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107701	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,757
2107703	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107704	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107705	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,811
2107718	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107720	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107721	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,432
2107722	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107724	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107725	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,757
2107727	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107728	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2107729	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,811
2107738	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107740	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107741	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107743	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107744	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107746	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107753	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107755	FX	31/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107756	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107758	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107759	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107761	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107768	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107770	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107772	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107773	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107774	FX	07/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107776	FX	04/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107778	FX	08/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107779	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	600,000
2107780	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107782	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107784	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107786	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107788	FX	14/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107790	FX	21/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107792	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107794	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	800,000
2107802	FX	07/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107803	FX	07/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107804	FX	31/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107806	FX	01/09/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107808	FX	07/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107809	FX	07/07/2023	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107810	FX	31/07/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107812	FX	01/09/2023	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,200,000
2107814	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,325
2107815	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107817	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107818	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107819	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,325
2107820	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107822	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107823	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107824	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,325
2107825	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107827	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107828	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107829	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,325
2107830	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107832	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107833	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107839	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,302
2107840	FX	10/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107842	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107843	FX	10/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107850	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107851	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107852	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107853	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107854	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107855	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,500,000
2107890	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107892	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107893	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107894	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107895	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107897	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107898	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107899	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107900	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107902	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2107903	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107904	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107905	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107907	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107908	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107909	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107910	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107912	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107913	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107914	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107915	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107917	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107918	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107919	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107920	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107922	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107923	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107924	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107925	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107927	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107928	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2107929	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,790
2107930	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107932	FX	15/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107933	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107934	FX	15/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	19,162
2107935	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107937	FX	12/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107938	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2107939	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	19,162
2107940	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107942	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107943	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107944	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107945	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107946	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107947	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107948	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107949	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107950	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107952	FX	26/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107953	FX	26/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107954	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107955	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107956	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107957	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107958	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107959	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	810,000
2107960	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107961	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107963	FX	07/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107964	FX	14/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107965	FX	14/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107966	FX	21/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107967	FX	21/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107969	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107978	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107979	FX	31/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107981	FX	07/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107982	FX	14/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107983	FX	14/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107984	FX	21/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107985	FX	21/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2107987	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2108210	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108212	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108213	FX	19/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,973
2108214	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108216	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108217	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	46,973
2108246	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108247	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108248	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108249	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108252	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108253	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108254	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108255	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108258	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108259	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108260	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108261	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108264	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108265	FX	23/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108266	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108267	FX	20/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2108271	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108274	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108276	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108277	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108279	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108280	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108281	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108283	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108284	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108285	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108287	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108291	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108292	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108293	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108295	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108296	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108297	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108299	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108303	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108307	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108308	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108309	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108311	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108331	FX	11/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108334	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108336	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108337	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108339	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108340	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108341	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108343	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108344	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108345	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108347	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108351	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108352	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108353	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108355	FX	29/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108356	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108357	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108359	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108363	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108367	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108368	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108369	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,509
2108371	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108390	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108392	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108393	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665
2108395	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108396	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108397	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108399	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108400	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108401	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665
2108403	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108407	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108408	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108409	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,499
2108410	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108412	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108413	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,488
2108415	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108419	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108423	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108424	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108425	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,046
2108427	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108446	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108448	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108449	FX	18/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665
2108451	FX	25/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108452	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108453	FX	25/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665
2108455	FX	01/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108456	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108457	FX	01/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,665
2108459	FX	08/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108463	FX	22/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108464	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108465	FX	22/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,499
2108466	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108468	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108469	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,488
2108471	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108475	FX	12/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108479	FX	19/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108480	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108481	FX	19/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	4,046
2108483	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108503	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108505	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108507	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108509	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108511	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108513	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108515	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108517	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108518	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108519	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108521	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108522	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108523	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108524	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108525	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,000
2108551	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108553	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108555	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108557	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108559	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108561	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108563	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108565	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108566	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108567	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108569	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108570	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108571	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108572	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108573	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2108575	FX	14/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000



Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108577	FX	21/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108579	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108581	FX	04/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108583	FX	11/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108585	FX	18/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108587	FX	25/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108589	FX	31/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108590	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108591	FX	08/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108593	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108594	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108595	FX	22/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108596	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108597	FX	29/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000
2108767	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108769	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108770	FX	27/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2108771	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108773	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108774	FX	29/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2108775	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108777	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2108778	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,641
2108787	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108789	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108790	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,891
2108795	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108797	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108798	FX	05/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,891
2108803	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108805	FX	05/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	450,000
2108808	FX	28/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108809	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108810	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108811	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108812	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108813	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108815	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108816	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108817	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108818	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108819	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108820	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108821	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108822	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108823	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108824	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108825	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108826	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108827	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108828	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108829	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108830	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108831	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108832	FX	17/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108833	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108835	FX	28/07/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108836	FX	28/07/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108837	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108838	FX	02/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108839	FX	02/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108840	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108842	FX	03/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108843	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108844	FX	07/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108845	FX	07/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108846	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108847	FX	09/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108848	FX	09/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108849	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108850	FX	10/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108851	FX	10/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108852	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108853	FX	14/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108854	FX	14/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108855	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108856	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108857	FX	16/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108858	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108859	FX	17/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108860	FX	17/08/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2108866	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108868	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108870	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108871	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108872	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108874	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108876	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108877	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108878	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108896	FX	16/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108898	FX	23/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108900	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108901	FX	06/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108902	FX	06/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108904	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108906	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108907	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108908	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2108926	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108928	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108930	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108931	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108932	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108976	FX	30/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108978	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108979	FX	28/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108980	FX	28/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109021	FX	11/08/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109082	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109083	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109084	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109085	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109092	FX	15/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109093	FX	15/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109094	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109095	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,300,000
2109519	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109521	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109522	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109523	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109549	FX	13/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109551	FX	20/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109552	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109553	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2109579	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109580	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109581	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109603	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109604	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109605	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,079
2109626	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109627	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109628	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109644	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109645	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109646	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109662	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2109663	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109674	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109675	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109687	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109688	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109689	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109711	FX	27/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109712	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109713	FX	27/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,907
2109734	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109735	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109736	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109770	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109771	FX	26/09/2023	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2109772	FX	26/09/2023	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

## Liquidados anticipadamente

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide	RcvSide	Option	Booking Point
E84350	20/07/2023	Unwound	17,500,000	mxn			17,500,000	418196
E84351	20/07/2023	Unwound	17,500,000	mxn			17,500,000	418196
MNF454	10/11/2023	Unwound		usd		6,000,000		484237
MNF512	01/11/2024	Unwound		usd		12,000,000		484237
MRP316	13/12/2024	Unwound		mxn		192,442,634		484237
P17220	24/09/2025	Unwound		usd			1,270,964	417998
P17230	24/09/2025	Unwound		usd			1,270,964	26492
P17235	01/07/2024	Unwound		mxn			31,727,161	417998
P17236	01/07/2024	Unwound		mxn			31,727,161	417998
P17239	30/06/2024	Unwound		mxn			175,000,000	417998
P17240	30/06/2024	Unwound		mxn			175,000,000	417998
P17278	05/03/2026	Unwound		mxn			700,000,000	417998
P17279	05/03/2026	Unwound		mxn			700,000,000	417998
P18116	24/09/2025	Unwound		usd			1,270,964	417998
P18129	24/09/2025	Unwound		usd			1,270,964	26492
SDS172	22/10/2025	Unwound	446,400,000	mxn	446,400,000	446,400,000		418307
SDS188	22/10/2025	Unwound	446,400,000	mxn	446,400,000	446,400,000		418307
SDS371	01/11/2024	Unwound	12,000,000	usd	12,000,000	12,000,000		406503
SDS380	01/11/2024	Unwound	12,000,000	usd	12,000,000	12,000,000		406503
SDS394	01/11/2024	Unwound	12,000,000	usd	12,000,000	12,000,000		484237
SDS603	06/11/2023	Unwound	65,000,000	mxn	65,000,000	65,000,000		418307
SDS995	10/11/2023	Unwound	6,000,000	usd	6,000,000	6,000,000		406503
SDS996	10/11/2023	Unwound	6,000,000	usd	6,000,000	6,000,000		406503
SDT004	10/11/2023	Unwound	6,000,000	usd	6,000,000	6,000,000		484237
SDU399	17/12/2025	Unwound	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SDU401	17/12/2025	Unwound	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SDU523	17/12/2025	Unwound	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SDU529	17/12/2025	Unwound	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000		418307
SFU513	13/12/2024	Unwound	192,442,634	mxn	192,442,634	192,442,634		406503
SFU515	13/12/2024	Unwound	192,442,634	mxn	192,442,634	192,442,634		406503
SFU619	13/12/2024	Unwound	192,442,634	mxn	192,442,634	192,442,634		484237
SGA539	25/02/2027	Unwound	11,815,000	usd	11,815,000	11,815,000		406503
SGB965	25/02/2027	Unwound	5,437,000	usd	5,437,000	5,437,000		406503
SHB947	31/08/2025	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000		418307
SJC161	10/08/2027	Unwound	33,894,172	mxn	33,894,172	33,894,172		418307

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

Producto	Fecha de evento	Contraparte /Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
21/05/7659	06/07/2023	Cliente 1	MXN	154,000	No envió los fondos
P18495	10/07/2023	Cliente 2	MXN	55,806	No envió los fondos
SJD571	17/07/2023	Cliente 3	USD	3,994	No envió los fondos
P17279	17/07/2023	Cliente 4	MXN	15,834,626	No envió los fondos
SDT419	17/07/2023	Cliente 5	MXN	105,075	Devolución de fondos automáticamente por SPEI
SDX146	17/07/2023	Cliente 6	MXN	122,341	Devolución de fondos automáticamente por SPEI
SDV692	17/07/2023	Cliente 7	MXN	122,575	Devolución de fondos automáticamente por SPEI
SDU352	17/07/2023	Cliente 8	MXN	202,347	Devolución de fondos automáticamente por SPEI
SAK055	28/07/2023	Cliente 9	MXN	(820,677)	Cliente tiene incumplimientos
SDS043	28/07/2023	Cliente 10	MXN	838,899	Problemas con otro banco por el pago
SDX258	28/07/2023	Cliente 11	MXN	782,056	Problemas con otro banco por el pago
SDX283	28/07/2023	Cliente 12	MXN	781,278	Problemas con otro banco por el pago
P18042	28/07/2023	Cliente 13	MXN	576,037	Problemas con otro banco por el pago
SHZ530	28/07/2023	Cliente 14	MXN	543,667	Problemas con otro banco por el pago
SDT350	28/07/2023	Cliente 15	MXN	509,853	Problemas con otro banco por el pago
SDU882	28/07/2023	Cliente 16	MXN	375,939	Problemas con otro banco por el pago
SHS404	28/07/2023	Cliente 17	MXN	302,167	Problemas con otro banco por el pago
SIN668	28/07/2023	Cliente 18	MXN	193,861	Problemas con otro banco por el pago
SHL621	28/07/2023	Cliente 19	MXN	161,194	Problemas con otro banco por el pago
SDU373	28/07/2023	Cliente 20	MXN	125,358	Problemas con otro banco por el pago
SHZ524	28/07/2023	Cliente 21	MXN	114,431	Problemas con otro banco por el pago
SID611	28/07/2023	Cliente 22	MXN	83,300	Problemas con otro banco por el pago
P18819	28/07/2023	Cliente 23	MXN	3,709	Problemas con otro banco por el pago
SX6539	31/07/2023	Cliente 24	MXN	(1,352,668)	Cliente tiene cuanta congelada
2023072703201	31/07/2023	Cliente 25	MXN	342,140,000	Problemas con su plataforma de liquidación
17/09/7673	01/08/2023	Cliente 26	USD	200,000	No fondeo su cuenta
E85173	18/08/2023	Cliente 27	MXN	114,375	No envió los fondos
SAK055	28/08/2023	Cliente 28	MXN	(850,292)	Cliente tiene incumplimientos
SX6539	29/08/2023	Cliente 29	MXN	(1,222,796)	Cliente tiene cuanta congelada
	05/09/2023	Cliente 30	USD	7,114	No envió los fondos
202309053319	14/09/2023	Cliente 31	USD	3,000,000	Retraso en envío de fondos
SAK055	28/09/2023	Cliente 32	MXN	(842,132)	Cliente tiene incumplimientos
SX6539	29/09/2023	Cliente 33	MXN	(1,294,418)	Cliente tiene cuanta congelada

## Resumen de Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	2,600,021,855	Compra	Divisas	Divisas	88,352,313,193	90,406,610,941	2,563,081,267	36,940,588	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	2,749,776,388	Venta	Divisas	Divisas	(87,568,803,012)	(90,378,763,025)	2,705,631,799	44,144,589	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,083,770,000	Compra	Acción	Acción	152,643,314	85,612,687	-	1,083,770,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	794,910,000	Venta	Acción	Acción	(143,932,914)	(77,981,568)	-	794,910,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	8,060,051,696	Compra	Divisas	Divisas	204,507,433	284,440,961	6,330,326,176	1,729,725,521	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	7,153,800,896	Venta	Divisas	Divisas	(186,500,272)	(216,998,351)	5,424,075,376	1,729,725,521	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	3,256,225,000	Compra	Índice	Índice	108,996,316	42,677,352	-	3,256,225,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	678,380,000	Venta	Índice	Índice	(31,767,055)	(11,975,187)	-	678,380,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	40,341,711,509	Compra	Tasas	Tasas	1,040,951,144	1,094,168,776	2,878,438,981	33,345,240,556	4,118,031,972	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	39,733,805,106	Venta	Tasas	Tasas	(1,015,538,379)	(1,065,488,019)	2,878,438,981	32,888,906,059	3,966,460,065	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	144,430,000	Compra	Acción NE	Acción NE	6,468,960	5,769,284	-	144,430,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	144,430,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(15,179,361)	(13,400,403)	-	144,430,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,562,270,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(77,216,125)	(30,699,225)	-	2,562,270,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,205,281,973	Compra	Divisas NE	Divisas NE	316,187	44,871,616	-	1,205,281,973	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,205,281,973	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(1,150,715)	(110,772,242)	-	1,205,281,973	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	7,712,512,170	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	690,952,991	578,049,154	-	5,399,394,166	2,313,118,004	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	4,621,920,647	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	52,180,688	43,606,947	3,485,580,000	600,196,329	536,144,317	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	68,557,975,171	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIE MXN	814,216,556	3,126,894,911	-	45,717,778,500	22,840,196,671	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,958,420,000	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	639,528,183	677,204,251	3,958,420,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	106,902,500	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	139,561,118	142,677,142	-	106,902,500	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	64,606,384,115	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	1,936,269,343	2,988,939,774	773,883,877	35,281,157,877	28,551,342,362	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	359,614,637,484	CCIRS / IRS	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIE MXN	FIJA MXN / TASA DE INTERES TIE MXN	6,550,249,965	12,748,228,351	78,779,809,122	175,184,181,171	105,650,647,190	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	67,496,628,880	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(813,410,977)	(2,570,312,693)	751,724,146	38,135,782,162	28,609,122,572	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	364,957,663,585	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIE MXN / FIJA	(7,735,343,172)	(13,365,565,664)	79,380,583,291	171,210,810,553	114,366,269,740	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
10000000000			<b>A C T I V O</b>	803,211,649,996	715,928,395,607
100200001001			<b>Efectivo y equivalentes de efectivo</b>	58,749,807,423	36,184,758,771
100400001001			<b>Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)</b>	1,548,618,782	911,362,826
100600001001			<b>INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS</b>	165,334,422,864	142,903,303,129
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	74,832,124,655	69,731,568,054
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	85,655,159,961	68,498,530,207
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	4,847,138,248	4,673,204,868
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	4,847,662,963	4,673,720,488
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-524,715	-515,620
101000001001			<b>Deudores por reporte</b>	2,694,236,519	803,342,068
101200001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	0	0
101400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	48,471,629,015	39,914,790,763
	101400102001		Con fines de negociación	34,975,956,945	34,106,149,152
	101400102002		Con fines de cobertura	13,495,672,070	5,808,641,611
101600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS</b>	-1,252,235,797	-1,573,239,132
	101800104001		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1</b>	474,259,984,853	448,503,593,270
	101800105001		Créditos comerciales	238,757,736,034	235,595,605,566
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	198,926,329,324	207,372,606,705
		101800107002	Entidades financieras	24,931,179,139	15,403,231,264
		101800107003	Entidades gubernamentales	14,900,227,571	12,819,767,597
	101800105002		Créditos de consumo	33,650,540,514	32,978,046,682
	101800105003		Créditos a la vivienda	201,851,708,305	179,929,941,022
		101800507023	Media y residencial	196,782,443,679	174,214,514,735
		101800507024	De interés social	4,253,800	4,931,909
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	5,065,010,826	5,710,494,378
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2</b>	5,427,414,877	3,856,672,359
	101800205005		Créditos comerciales	1,429,102,071	516,948,432
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	1,429,102,071	474,375,155
		101800506008	Entidades financieras	0	42,573,277
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	773,725,909	630,370,972
	101800205007		Créditos a la vivienda	3,224,586,897	2,709,352,955
		101800706018	Media y residencial	3,082,138,768	2,605,821,937
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	142,448,129	103,531,018
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		<b>Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3</b>	19,790,905,375	18,102,477,590
	101800305008		Créditos comerciales	9,363,459,192	9,489,653,078
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	9,307,092,732	9,338,134,556
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	91,479,525
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	60,038,997
	101800305009		Créditos de consumo	843,578,591	872,884,383
	101800305010		Créditos a la vivienda	9,583,867,592	7,739,940,129
		101801006034	Media y residencial	9,166,253,137	7,466,683,269
		101801006035	De interés social	9,276,308	11,044,165
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	408,338,147	262,212,695
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		<b>Cartera de crédito valuada a valor razonable</b>	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
		101801306051	De interés social	0	0
		101801306052	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	0	0
		101801306053	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801306054	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	131800103001		Cartera de crédito	499,478,305,105	470,462,743,219
	131800103002		Partidas diferidas	2,898,781,209	0
	101800103003		<b>ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS</b>	-15,793,353,804	-15,529,890,551
	131800102001		<b>Cartera de crédito (neto)</b>	486,583,732,510	454,932,852,668
	131800102002		<b>Derechos de cobro adquiridos (neto)</b>	0	0
131800001001			<b>Total de cartera de crédito (neto)</b>	486,583,732,510	454,932,852,668
102000001001			<b>Activos virtuales</b>	0	0
102200001001			<b>BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
132400001001			<b>Otras cuentas por cobrar (neto)</b>	20,020,459,069	18,975,547,120
132600001001			<b>Bienes adjudicados (neto)</b>	508,028,575	227,433,243
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	13,941,494	14,879,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	2,341,942,861	5,058,342,298
133400001001			<b>Propiedades, mobiliario y equipo (neto)</b>	4,998,163,967	4,245,355,923
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,558,591,262	2,658,374,007
103800001001			<b>INVERSIONES PERMANENTES</b>	54,187,783	52,546,670
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	6,055,236,011	5,991,440,714
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,530,887,658	4,627,305,045
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			<b>P A S I V O</b>	722,087,501,144	638,439,216,491
200200001001			<b>CAPTACIÓN TRADICIONAL</b>	530,579,304,785	446,817,419,264
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	269,967,441,042	230,036,267,845
	200200102002		Depósitos a plazo	248,675,460,664	193,765,204,381
		200200203003	Del público en general	207,458,589,061	191,459,357,786
		200200203004	Mercado de dinero	41,216,871,603	2,305,846,595
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	10,677,211,141	22,032,836,018
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,259,191,938	983,111,020
200400001001			<b>PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS</b>	30,450,536,792	44,083,768,438
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	21,617,705,212	24,175,738,140
	200400102003		De largo plazo	8,832,831,580	19,908,030,298
230600001001			<b>VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR</b>	8,614,245,665	5,222,118,777
200800001001			<b>ACREEDORES POR REPORTO</b>	60,089,470,621	57,145,954,286
201000001001			<b>PRÉSTAMO DE VALORES</b>	51,112	40,471
201200001001			<b>COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA</b>	1,029,960,454	2,434,728,146
	201200102001		Reportos	0	501,035,889
	201200102002		Préstamo de valores	1,029,960,454	1,933,692,257
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			<b>Instrumentos financieros derivados</b>	43,857,070,736	36,783,542,609
	201400102001		Con fines de negociación	34,786,196,061	33,872,733,157
	201400102002		Con fines de cobertura	9,070,874,675	2,910,809,452
201600001001			<b>AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS</b>	0	3,745,792
201800001001			<b>OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN</b>	0	0
202000001001			<b>Pasivo por arrendamiento</b>	2,690,839,439	2,774,987,272
202200001001			<b>Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal</b>	0	0
202400001001			<b>OTRAS CUENTAS POR PAGAR</b>	27,509,094,622	24,579,718,576
	202400102001		Acreeedores por liquidación de operaciones	13,510,013,675	9,686,359,977
	202400102002		Acreeedores por cuentas de margen	2,302,255,158	2,196,320,938
	202400102003		Acreeedores por colaterales recibidos en efectivo	5,867,290,415	5,607,577,536
	202400102004		Contribuciones por pagar	422,833,992	421,156,992
	202400102005		Acreeedores diversos y otras cuentas por pagar	5,406,701,382	6,668,303,133
202600001001			Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	0	0
202800001001			Pasivos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
203000001001			Instrumentos financieros que califican como pasivo	9,101,670,737	9,099,006,105
	203000102001		<b>OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN</b>	9,101,670,737	9,099,006,105
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			<b>Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo</b>	0	0
203400001001			<b>Pasivo por impuestos a la utilidad</b>	677,174,411	1,893,742,725
203600001001			<b>Pasivo por beneficios a los empleados</b>	6,420,664,751	6,141,628,689
203800001001			<b>Créditos diferidos y cobros anticipados</b>	1,067,417,019	1,458,815,341
400000000000			<b>CAPITAL CONTABLE</b>	81,124,148,852	77,489,179,116
440200001001			<b>Participación controladora</b>	81,122,773,916	77,487,977,670
	400200102001		<b>CAPITAL CONTRIBUIDO</b>	13,468,335,561	12,906,542,339
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,155,059,263
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		<b>CAPITAL GANADO</b>	67,654,438,355	64,581,435,331
		400200203010	Reservas de capital	8,949,346,887	7,839,163,707
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	58,288,818,747	56,301,340,357
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	49,837,386,812	47,119,043,196
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	8,451,431,935	9,182,297,161
	400200203013		Otros resultados integrales	255,794,311	278,571,261
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-762,964,559	-594,420,160
		400201304007	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0
		400201304008	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	1,476,297,642	989,428,878
		400201304009	Incremento por actualización de la valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0
		400201304010	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304011	Incremento por actualización de Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
		400201304012	Remediación de beneficios definidos a los empleados	-457,538,772	-116,437,457
		400201304013	Incremento por actualización de la remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0
		400201304014	Efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304015	Incremento por actualización del efecto acumulado por conversión	0	0
		400201304016	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
		400201304017	Incremento por actualización del resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	400200203014		Participación en ORI de otras entidades	-1,838,884	42,712
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			<b>PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA</b>	1,374,936	1,201,446
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	135,120	82,811
	440400102002		Otra participación no controladora	1,239,816	1,118,635
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			<b>CUENTAS DE ORDEN</b>	3,333,998,363,616	2,963,461,814,868
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	257,625,741,043	270,905,826,569
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	450,990,946,600	438,411,503,589
	700800102001		Fideicomisos	421,919,956,989	409,129,840,374
	700800102002		Mandatos	29,070,989,611	29,281,663,215
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	683,331,050,929	560,597,824,002
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	10,218,531,872	12,776,287,971
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,029,960,454	2,434,611,347
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,646,909,460	1,202,924,782
702000001001			Otras cuentas de registro	1,929,155,223,258	1,677,132,836,608

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03

AÑO: 2023

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

CONSOLIDADO

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

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	57,993,532,782	40,320,583,068
600400101002	Gastos por intereses	38,100,639,672	21,500,053,473
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	<b>MARGEN FINANCIERO</b>	19,892,893,110	18,820,529,595
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	1,005,879,246	-266,833,037
330000000002	<b>MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS</b>	18,887,013,864	19,087,362,632
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	3,602,122,350	3,661,024,155
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	334,915,856	465,890,113
501400301007	Resultado por intermediación	1,552,496,756	1,214,534,590
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	763,744,038	402,229,530
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	12,810,325,676	12,394,026,581
330000000003	<b>RESULTADO DE LA OPERACIÓN</b>	11,660,135,476	11,505,234,213
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	168,135,720	58,658,436
330000000004	<b>RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD</b>	11,828,271,196	11,563,892,649
602400501012	Impuestos a la utilidad	3,376,704,141	2,381,512,677
330000000005	<b>RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS</b>	8,451,567,055	9,182,379,972
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	<b>RESULTADO NETO</b>	8,451,567,055	9,182,379,972
502800701014	Otros Resultados Integrales	242,284,381	137,625,659
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-406,553,500	-483,382,267
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	624,308,722	610,138,102
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	24,529,159	10,869,824
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	265,189	42,712
330000000007	<b>RESULTADO INTEGRAL</b>	8,694,116,625	9,320,048,343
543200601016	<b>Resultado neto atribuible a:</b>	8,451,567,055	9,182,379,972
543201602158	Participación controladora	8,451,431,935	9,182,297,161
543201602159	Participación no controladora	135,120	82,811
543400701017	<b>Resultado integral atribuible a:</b>	8,694,116,625	9,320,048,343
543401702160	Participación controladora	8,694,116,625	9,320,048,343
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	<b>UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA</b>	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE  
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		<b>Actividades de operación</b>		
851000102001		<b>Resultado antes de impuestos a la utilidad</b>	11,828,271,196	11,563,892,649
851000102002		<b>Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:</b>	-2,134,270,874	47,234,668
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	802,109,702	757,468,348
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	606,204,223	508,617,880
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	-20,623,438	-55,818,382
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-168,135,720	-58,658,436
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-3,353,825,641	-1,104,374,742
	851000203006	Operaciones discontinuadas	0	0
	851000203007	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	0	0
851000102003		Ajustes por partidas asociadas con actividades de financiamiento	1,383,514,549	-18,820,529,595
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	2,029,425,124
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	1,383,514,549	727,444,899
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	-21,577,399,618
851000102004		<b>Cambios en partidas de operación</b>	-10,558,620,982	-33,606,818,520
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	-19,067,408,738	-4,323,776,430
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	659,274,600	-1,470,401,178
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	-35,357,918,906	-14,996,101,588
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	530,256,489	12,644,311,783
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-4,824,784,203	-16,722,161,378
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-6,331,917,525	-33,628,827,517
	851000403008	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	851000403009	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	851000403010	Cambio en activos virtuales	0	0
	851000403011	Cambio en otras cuentas por cobrar (neto)	-4,585,871,213	-5,009,991,587
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-242,699,647	-110,904,053
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	618,503,704	1,726,777,631
	851000403014	Cambio en captación tradicional	45,113,650,985	4,762,302,821
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	4,328,565,021	-499,731,004
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-9,784	3,349
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-2,935,363,971	-322,929,096
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	9,072,976,921	15,635,607,586
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	44,755,822	44,755,822
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	213,808,707	-49,732,687
	851000403021	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	851000403022	Cambio en activos/pasivos por beneficios a los empleados	809,604,359	1,054,149,375
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	6,724,316,181	7,706,403,040
	851000403024	Cambio en otras provisiones	0	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-5,328,359,784	-46,573,409
851000001001		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de operación</b>	518,893,889	-40,816,220,798
		<b>Actividades de inversión</b>		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-590,222,466	-341,279,712
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	17,241,826	12,943,176
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	-11,920
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	166,903,920	57,687,998
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-549,208,822	-546,473,684
	851000202013	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	851000202014	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	851000202015	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

**CONSOLIDADO  
Impresión Final**

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
			IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	666,696
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	<b>Flujos netos de efectivo de actividades de inversión</b>	<b>-955,285,542</b>	<b>-816,467,446</b>
		<b>Actividades de financiamiento</b>		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	-2,029,425,124
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-461,264,176	0
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-2,849,994,662	0
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-1,383,514,549	-727,444,899
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	-17,766,769
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	40,320,583,068
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	-18,725,416,681
851000001003		<b>Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento</b>	<b>-4,694,773,387</b>	<b>18,820,529,595</b>
	851000000000	<b>Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>-5,131,165,040</b>	<b>-22,812,158,649</b>
	851200000000	<b>Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
	851400000000	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo</b>	<b>63,880,972,463</b>	<b>58,996,917,420</b>
	100200001001	<b>Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo</b>	<b>58,749,807,423</b>	<b>36,184,758,771</b>

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

TRIMESTRE: 03

AÑO: 2023

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

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE  
 CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2023 Y 2022

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Participación en ORI de otras entidades			
<b>Saldo al inicio del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
<b>Ajustes retrospectivos por cambios contables</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Ajustes retrospectivos por correcciones de errores</b>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<b>Saldo ajustado</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	8,001,481,001	53,797,569,992	-356,411,059	851,988,920	0	-482,067,931	0	0	-2,104,073	75,278,792,411	1,239,816	75,280,032,227
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	0	0	0	0	0	0	-2,850,000,000	0	-2,850,000,000
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																
Reservas de capital	0	0	0	0	1,110,183,180	-1,110,183,180	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
RESULTADO INTEGRAL																
Resultado neto	0	0	0	0	0	8,451,431,935	0	0	0	0	0	0	0	8,451,431,935	135,120	8,451,567,055
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	-406,553,500	624,308,722	0	24,529,159	0	0	0	242,284,381	0	242,284,381
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	-406,553,500	0	0	0	0	0	0	-406,553,500	0	-406,553,500
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	624,308,722	0	0	0	0	0	624,308,722	0	624,308,722
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remediación de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	24,529,159	0	0	0	24,529,159	0	24,529,159
Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Participación en ORI de otras entidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	265,189	265,189	0	0	265,189
Total	0	0	0	0	0	8,451,431,935	-406,553,500	624,308,722	0	24,529,159	0	0	265,189	8,693,981,505	135,120	8,694,116,625
<b>Saldo al final del periodo</b>	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	58,288,818,747	-762,964,559	1,476,297,642	0	-457,538,772	0	0	-1,838,884	81,122,773,916	1,374,936	81,124,148,852



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 1 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## Información Financiera

SCOTIABANK INVERLAT

## Indicadores Financieros

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

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)10.1%15.9%13.2%  
14.8%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.0%1.6%1.3%1.5%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos  
productivos promedio)2.8%3.7%3.4%3.3%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total  
promedio)2.4%2.3%2.2%2.1%

Índice de Morosidad

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

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

(Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del  
trimestre/Saldo de la  
cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre.)90.6%87.8%  
82.2%79.8%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito19.78%21.01%21.94%22.60%1).

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional)15.50%16.12%16.59%17.07%1).

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos)45.5%44.0%50.6%49.0%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

La utilidad neta al cierre del tercer trimestre alcanza \$2,936 millones, un incremento de \$416 millones o 17% respecto al trimestre anterior, debido a una disminución en gastos de administración y una menor tasa de impuestos producto de una mayor inflación, compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias. Respecto al mismo periodo del año anterior la utilidad neta incremento \$65 millones, principalmente por menores requerimientos de reservas crediticias y mayores ingresos no financieros; compensados parcialmente por mayores impuestos a la utilidad debido a los movimientos de inflación en el periodo.

La utilidad neta acumulada al cierre de septiembre 2023 se ubicó en \$8,451 millones; una disminución de \$731 millones u 8% respecto al mismo periodo del año pasado. En el periodo, el PTPP creció 13%, el cual fue contrarrestado por mayores requerimientos de reservas crediticias, producto del beneficio en T1 2022 de la implementación de IFRS 9, así como mayores impuestos a la utilidad debido a los movimientos de inflación.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 2 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

3 meses 9 meses

Scotiabank- Información Financiera

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%30 sep

202230 sep

2023A/A

Δ%

Ingresos por intereses 15,146 19,618 19,984 32% 40,320 57,994 44%

Gastos por intereses (8,471) (13,118) (13,250) 56% (21,500) (38,101) 77%

Margen Financiero 6,675 6,500 6,734 1% 18,820 19,893 6%

Comisiones 1,170 1,024 1,044 -11% 3,195 3,267 2%

Resultado por Intermediación 372 560 430 16% 1,215 1,553 28%

Otros ingresos/egresos de la operación 89 208 273 > +100% 402 763 90%

Ingresos no Financieros 1,631 1,792 1,747 7% 4,812 5,583 16%

Total Ingresos 8,306 8,292 8,481 2% 23,632 25,476 8%

Gastos de Administración y Promoción (4,050) (4,280) (4,096) 1% (12,394) (12,810) 3%

PTPP 1). 4,256 4,012 4,385 3% 11,238 12,666 13%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (772) (287) (574) -26% 267 (1,006) > -100%

Resultado de la Operación 3,484 3,725 3,811 9% 11,505 11,660 1%

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

Controladora 1 89 - -100% 59 168 > +100%

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 3,485 3,814 3,811 9% 11,564 11,828 2%

Impuestos a la Utilidad (614) (1,294) (875) 43% (2,382) (3,377) 42%

Resultado Neto 2,871 2,520 2,936 2% 9,182 8,451 -8%

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender (326) 30 (489) 50% (483) (407) -16%

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 52 (165) 831 > +100% 610 624 2%

Remediación de beneficios definidos a los empleados 1 4 20 > +100% 11 25 > +100%

Resultado Integral 2,598 2,389 3,298 27% 9,320 8,693 -7%

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

## Margen Financiero

El margen financiero fue de \$6,734 millones al cierre del tercer trimestre de 2023, un incremento de \$59 millones o 1% respecto al mismo trimestre del año anterior, principalmente por mayores ingresos en la cartera comercial e hipotecaria, así como en inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de clientes.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$234 millones o 4%; debido a mayores volúmenes de cartera hipotecaria y un día más de operación, compensados con mayor gasto de intereses por incremento en depósitos de exigibilidad inmediata.

El margen financiero acumulado al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$19,893 millones, un incremento anual de \$1,073 millones o 6%, respecto al mismo periodo de 2022, El crecimiento fue impulsado por mayores ingresos provenientes de cartera

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 3 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

corporativa e hipotecaria; compensados parcialmente por mayores intereses pagados resultantes del cambio en la mezcla en depósitos (mayores volúmenes en depósitos del público en general), y al incremento en la tasa de referencia.

**Ingresos no Financieros**

El total de ingresos no financieros fue de \$1,747 millones en el tercer trimestre de 2023, un incremento de \$116 millones o 7% respecto al mismo periodo del año anterior, explicada por mayores ingresos provenientes de cartera comercial y seguros (ambos en otros ingresos / egresos de la operación).

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron una disminución de \$45 millones o 3%, debido a menores ingresos por mercados cambiarios e instrumentos financieros (ambos en intermediación), compensados parcialmente por mayores ingresos / egresos de la operación y comisiones.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$5,583 millones, un crecimiento anual de \$771 millones o 16%, La variación se debió principalmente a mayores ingresos provenientes de instrumentos financieros derivados (en intermediación) y menores quebrantos (en otros ingresos / egresos de la operación).

3 meses 9 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas)

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%30 sep

202230 sep

2023A/A

Δ%

Aceptaciones por Cuenta de Terceros	1	1	-	-100%	1	2	100%
-------------------------------------	---	---	---	-------	---	---	------

Actividades Fiduciarias	58	53	53	-9%	176	166	-6%
-------------------------	----	----	----	-----	-----	-----	-----

Apertura de Cuenta	5	5	6	20%	13	17	31%
--------------------	---	---	---	-----	----	----	-----

Cartas de Crédito sin Refinanciamiento	59	61	34	-42%	166	170	2%
--	----	----	----	------	-----	-----	----

Cheques Certificados	1	-	1	0%	2	2	0%
----------------------	---	---	---	----	---	---	----

Cheques de caja	-	1	-	0%	1	1	0%
-----------------	---	---	---	----	---	---	----

Compraventa de instrumentos financieros	-	3	(1)	>-100%	1	2	100%
---	---	---	-----	--------	---	---	------

Manejo de Cuenta	97	82	83	-14%	269	248	-8%
------------------	----	----	----	------	-----	-----	-----

Operaciones de Crédito	476	378	403	-15%	1,258	1,181	-6%
------------------------	-----	-----	-----	------	-------	-------	-----

Otras Comisiones y Tarifas	399	369	395	-1%	1,090	1,259	16%
----------------------------	-----	-----	-----	-----	-------	-------	-----

Servicios de Banca Electrónica	47	45	45	-4%	136	141	4%
--------------------------------	----	----	----	-----	-----	-----	----

Transferencia de Fondos	27	26	25	-7%	82	78	-5%
-------------------------	----	----	----	-----	----	----	-----

<b>Total de Comisiones y Tarifas (netas)</b>	<b>1,170</b>	<b>1,024</b>	<b>1,044</b>	<b>-11%</b>	<b>3,195</b>	<b>3,267</b>	<b>2%</b>
--	--------------	--------------	--------------	-------------	--------------	--------------	-----------

3 meses 9 meses

Scotiabank-

Otros Ingresos/Egresos de la operación

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 4 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

Δ%30 sep  
202230 sep  
2023A/A  
Δ%  
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas(51) (23) 9 > -100%(82) 21  
> -100%  
Aportaciones al IPAB(505) (542) (551) 9%(1,499) (1,626) 8%  
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 60 9 8 -87% 192 52 -73%  
Donativos(9) - - -100%(9) - -100%  
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados 17 30 18 6% 39 54  
38%  
Ingresos por adquisición de Cartera de Crédito - - - 0% 1 - -100%  
Ingresos por Arrendamiento 3 19 11 > +100% 14 33 > +100%  
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 39 51 53 36%  
100 150 50%  
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 603 719 782 30% 2,184 2,263  
4%  
Quebrantos(81) (66) (73) -10%(557) (211) -62%  
Recuperaciones 2 11 3 50% 8 14 75%  
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo 11 - 13 18% 11 13 18%  
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 89 208 273 > +100% 402 763 90%

## Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

3 meses9 meses

Scotiabank-

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

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%30 sep

202230 sep

2023A/A

Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(772) (287) (574) -26%267(1,006) > -100%

En el tercer trimestre de 2023, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$574 millones, una disminución de \$198 millones o 26% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a menores requerimientos en la cartera comercial; compensados parcialmente por menores reservas adicionales y mayores requerimientos en la cartera automotriz.

Por el contrario, respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra un incremento de \$287 millones, debido principalmente a mayores requerimientos en la cartera comercial y tarjeta de crédito.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de septiembre 2023 ascendió a \$1,006 millones, un incremento de \$1,273 millones respecto al acumulado del año anterior, debido a mayores requerimientos de reservas crediticias, producto del beneficio en T1 2022 de la implementación de IFRS 9.

Gastos de Administración y Promoción

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 5 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

3 meses9 meses

Scotiabank-

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

30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%30 sep

202230 sep

2023A/A

Δ%

Gastos de Personal (1,696) (2,001) (1,799) 6% (5,871) (6,167) 5%

Gastos de Operación (2,354) (2,279) (2,297) -2% (6,523) (6,643) 2%

Total de Gastos de Administración y Promoción (4,050) (4,280) (4,096) 1% (12,394) (12,810) 3%

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,096 millones en el tercer trimestre, un incremento de \$46 millones o 1% respecto al mismo periodo del año anterior, debido principalmente a un incremento de \$103 millones o 6% en gastos de personal por salarios y PTU; compensados parcialmente por una disminución de \$57 millones en gastos de operación por menores amortizaciones y gastos legales.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$184 millones o 4% por una disminución de los gastos de personal de \$202 millones o 10%.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendieron a \$12,810 millones, un incremento anual de \$416 millones o 3%. Los gastos de personal mostraron un incremento de \$296 millones o 5%, debido principalmente a salarios. Por su parte, los gastos de operación mostraron un incremento anual de \$120 millones o 2%, debido a mayores gastos por amortizaciones y depreciaciones; compensados con menores gastos generales.

## Impuestos a la Utilidad

3 meses9 meses

Scotiabank-Impuestos - Impuestos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%30 sep

202230 sep

2023A/A

Δ%

Impuesto a la Utilidad Causado (813) (979) (1,103) 36% (2,242) (3,044) 36%

Impuesto a la Utilidad Diferido 199 (315) 228 15% (140) (333) > +100%

Total de Impuestos a la Utilidad (614) (1,294) (875) 43% (2,382) (3,377) 42%

En el tercer trimestre de 2023, se registró un impuesto neto a cargo de \$875 millones, un incremento de \$261 millones o 43% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por la disminución de la inflación.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto disminuyó \$419 millones o 32%, en su mayoría por el incremento de la inflación trimestre contra trimestre.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 6 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Los impuestos netos acumulados al cierre de septiembre 2023 ascendieron a \$3,377 millones, un incremento anual de \$995 millones o 42%, debido a la disminución de la inflación del ejercicio.

## Balance General

Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 219,145 266,608 275,547 26%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2452,361 466,023 479,687 6%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 318,102 19,262 19,791 9%

Partidas diferidas 2,861 2,899 > +100%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,530) (15,837) (15,793) 2%

Otros Activos 41,850 37,076 41,081 -2%

Total Activo 715,928 775,993 803,212 12%

Depósitos 446,817 508,629 530,579 19%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 44,084 34,690 30,451 -31%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,099 9,054 9,102 0%

Otros Pasivos 138,439 145,795 151,957 10%

Capital 77,489 77,825 81,123 5%

Total Pasivo y Capital 715,928 775,993 803,212 12%

Al 30 de septiembre de 2023, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$803,212 millones, un incremento de \$87,284 millones u 12% respecto al cierre de septiembre de 2022. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes de cartera de crédito, en efectivo y equivalentes de efectivo (depósitos en Banxico), inversiones en instrumentos financieros (gubernamental) y en instrumentos financieros derivados.

Los activos totales incrementaron \$27,219 o 4% millones respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes de cartera de crédito e inversiones en instrumentos financieros (gubernamental).

El total del pasivo registró \$722,089 millones al 30 de septiembre de 2023, un incremento de \$83,650 millones o 13% respecto al año pasado. Este incremento fue resultado principalmente de mayores volúmenes en depósitos.

Respecto al cierre del trimestre anterior, el pasivo total incrementó \$23,921 millones o 3%, principalmente por mayores volúmenes en depósitos.

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

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



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 7 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ %

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 33,608 33,368 34,424 2%

Créditos a la Vivienda 182,640 198,261 205,076 12%

Total Préstamos de Menudeo 216,248 231,629 239,500 11%

Actividad Empresarial o Comercial 207,847 201,226 200,356 -4%

Entidades Financieras 15,446 15,909 24,931 61%

Entidades Gubernamentales 12,820 17,259 14,900 16%

Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 236,113 234,394 240,187

2%

Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 452,361 466,023 479,687 6%

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de septiembre de 2023 alcanzó \$239,500 millones, un incremento anual de \$23,252 millones u 11% y \$7,871 o 3% millones respecto al trimestre anterior. Los incrementos anual y trimestral fueron impulsados principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de septiembre de 2023 se ubicó en \$240,187 millones, un incremento de \$4,074 millones o 2% respecto al año pasado y de \$5,793 millones o 2% respecto al trimestre anterior. El incremento año contra año fue impulsado por mayores créditos a entidades financieras y gubernamentales; compensados parcialmente por cartera de actividad empresarial o comercial. Así mismo, el incremento trimestral se debe a mayores créditos a entidades financieras; compensados parcialmente por menores créditos gubernamentales.

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

3 meses

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

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 18,102 19,262 19,791 9%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,530) (15,837) (15,793) 2%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 2,572 3,425 3,998 55%

Índice de morosidad 3.85% 3.97% 3.96% 11 pb

Al 30 de septiembre de 2023 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$19,791 millones, un incremento anual de \$1,689 millones o 9% y un incremento trimestral de \$529 millones o 3%.

En esta misma fecha, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$15,793 millones, un incremento anual de \$263 millones o 2% y una disminución de \$44 millones respecto del trimestre anterior. La estimación preventiva para riesgos crediticios representa el 3.2% de la cartera total, una disminución de 14pb respecto al año anterior y de 10pb respecto al trimestre anterior.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 79.8% al 30 de septiembre de 2023, una disminución de 600pb respecto del año anterior y de 200pb respecto del trimestre anterior.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 8 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

El índice de morosidad al 30 de septiembre de 2023 fue de 4.0%, un incremento de 11pb respecto del año anterior y una disminución de 1pb respecto al trimestre pasado.

## Depósitos

Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023A/A

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 230,036 257,433 269,967 17%

Público en General 191,459 204,187 207,459 8%

Mercado de Dinero 2,306 42,770 41,217 > +100%

Total Depósitos a Plazo 193,765 246,957 248,676 28%

Títulos de Crédito Emitidos 22,033 3,007 10,677 -52%

Cuenta global de captación sin movimientos 983 1,232 1,259 28%

Total de Depósitos 446,817 508,629 530,579 19%

El total de depósitos registró \$530,579 millones al 30 de septiembre de 2023, un incremento anual de \$83,762 millones o 19%, debido principalmente a mayores depósitos a plazo, así como de vista y ahorro. Respecto al trimestre anterior, el incremento fue de \$21,950 millones o 4%, debido a mayores depósitos a la vista y ahorro, así como en títulos de crédito emitidos.

## Obligaciones Subordinadas en Circulación

Al 30 de septiembre de 2023, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,102 millones, sin cambios significativos respecto al año pasado y al trimestre anterior.

## Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

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

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

Instrumentos financieros negociables	73,005	1,803	24	-	-	74,832
--------------------------------------	--------	-------	----	---	---	--------

Sin restricción:	-	-	19	-	-	19
------------------	---	---	----	---	---	----

Restringidos:	73,005	1,803	5	-	-	74,813
---------------	--------	-------	---	---	---	--------

En operaciones de reporto	63,655	1,803	-	-	-	65,458
---------------------------	--------	-------	---	---	---	--------

Préstamos de valores	1,112	-	-	-	-	1,112
----------------------	-------	---	---	---	---	-------

Otros	8,238	-	5	-	-	8,243
-------	-------	---	---	---	---	-------

Instrumentos financieros para cobrar o vender	62,217	20,958	-	-	2,480	85,655
---	--------	--------	---	---	-------	--------

Sin restricción:	60,763	20,958	-	-	2,480	84,201
------------------	--------	--------	---	---	-------	--------

Restringidos:	1,454	-	-	-	-	1,454
---------------	-------	---	---	---	---	-------

En operaciones de reporto	115	-	-	-	-	115
---------------------------	-----	---	---	---	---	-----

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

Otros	1,339	-	-	-	-	1,339
-------	-------	---	---	---	---	-------

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	4,847	-	-	-	-	4,847
--	-------	---	---	---	---	-------

Sin restricción	4,847	-	-	-	-	4,847
-----------------	-------	---	---	---	---	-------

Total	140,069	22,761	242,480	165,334	-	-
-------	---------	--------	---------	---------	---	---

Scotiabank

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 9 / 92  
 CONSOLIDADO  
 Impresión Final

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

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

EmisorTítulosTasaPlazoImporte

I-BANSAN-2327114, 913, 844, 52111.15%314, 904

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

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

Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOpcionesOperaciones EstructuradasSwapsPaquetes de Instrumentos DerivadosTotal activoTotal Pasivo

PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición

ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva

Negociación 2,262 2,234 - - 1,471 1,332 334 287 30,909 30,933 - - 34,976 34,786

Cobertura - - - - - - - - 13,496 9,071 - - 13,496 9,071

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas

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

Con fines de:Contratos AdelantadosFuturosOperaciones EstructuradasOpcionesSwapsPaquetes de Instrumentos Derivados

PosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosiciónPosición

ActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasivaActivaPasiva

Con fines de negociación

Posición USD2,5562,720-----

Posición EUR4444-----

Posición CHF-----

Posición GBP-----

Posición CAD-----

Divisas CAD-----

Divisas USD----6969458406----

Divisas EUR----33----

Divisas MXN-----3030----

Acciones MXN----1441441,084795----

Índices MXN-----2,5623,256678----

Tasa de interés

Pesos-----27,82127,213376,691375,328--

Dólares-----7187184,7424,203--

Euros-----

Pesos Colombianos-----177,500---

Con fines de cobertura

Tasa de interés

Pesos -----68,5583,500--

Dólares -----557486--

Euros -----

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)PesosDólaresUdisTotal

Actividad empresarial o comercial 155,400 43,527 - 198,927

Créditos a entidades financieras 24,595 336 - 24,931

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 10 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Créditos a entidades gubernamentales	11,408	3,492	-	14,900
Créditos al consumo	33,650	-	-	33,650
Créditos a la vivienda	201,793	13	46	201,852
<b>Total</b>	<b>426,846</b>	<b>47,368</b>	<b>46</b>	<b>474,260</b>

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

Actividad empresarial o comercial	1,429	-	-	1,429
Créditos al consumo	774	-	-	774
Créditos a la vivienda	3,220	1	3	3,224
<b>Total</b>	<b>5,423</b>	<b>1</b>	<b>3</b>	<b>5,427</b>

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

Actividad empresarial o comercial	7,906	1,401	-	9,307
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	844	-	-	844
Créditos a la vivienda	9,550	28	6	9,584
<b>Total</b>	<b>18,356</b>	<b>1,429</b>	<b>6</b>	<b>19,791</b>

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

Saldo al 30 de junio de 2023	19,262
Reestructuras	75
Recuperaciones	-486
Castigos y quitas	-675
Traspasos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y	31,589
Fluctuación Tipo Cambio	26
<b>Saldo al 30 de septiembre de 2023</b>	<b>19,791</b>

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

Saldo al 30 de junio de 2023	15,837
Más: Creación de reservas	32
Calificación	594
Menos: Adjudicaciones y otros	12
Castigos y quitas	686
Comercial	11
Hipotecario	132
Consumo	543
Desliz cambiario (28)	
<b>Saldo al 30 de septiembre de 2023</b>	<b>15,793</b>

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

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
121,155	29.85%	
210,099	14.25%	
37,791	10.99%	
<b>Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos</b>	<b>39,045</b>	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 11 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Scotiabank- Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito 30 sep

202230 jun

202330 sep

2023

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Metropolitano 60.0% 64.2% 66.0%

Noroeste - Centro 11.0% 10.4% 9.9%

Norte 14.6% 12.9% 12.3%

Bajío 8.6% 7.1% 6.7%

Sur 5.8% 5.4% 5.1%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Metropolitano 44.9% 53.4% 54.3%

Noroeste - Centro 17.0% 15.9% 15.8%

Norte 7.3% 5.8% 5.7%

Bajío 15.1% 12.1% 12.2%

Sur 15.7% 12.8% 12.0%

Scotiabank-Calificación de la Cartera Crediticia

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

Grado de Riesgo

Importe Cartera Crediticia Reservas Preventivas Necesarias

Cartera Comercial Consumo Cartera de Vivienda Total Reservas Preventivas

No revolventes Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes

Exceptuada calificada

Riesgo A1 432,670 893 97 478 310 1,778

Riesgo A2 57,006 538 27 205 15 785

Riesgo B1 8,306 75 46 61 16 198

Riesgo B2 6,826 15 51 33 57 156

Riesgo B3 3,585 13 24 35 41 113

Riesgo C1 2,725 6 40 65 52 163

Riesgo C2 3,729 85 32 91 221 429

Riesgo D 8,256 698 56 292 1,411 2,457

Riesgo E 11,696 6,119 602 256 1,888 8,865

Total 534,799 8,442 975 1,516 4,011 14,944

Exceso 849

Reservas Constituidas 15,793

NOTAS:

1). Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas, son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 30 de septiembre de 2023.

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

La institución de crédito utiliza metodología de la CNBV para créditos a cargo personas

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 12 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	
3		
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		
37		
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos		5
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		804
Total	\$	849

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

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

TítulosImporteVencimiento

B4 27070111,209,6861,75701-jul-27

BV 2707016-01-jul-27

Total11,209,6921,757

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)ISRPTU

Futuros castigos de crédito4,738 1,055

Pagos anticipados(1,147) (255)

Comisiones cobradas por anticipado471104

Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo713 157

Plan de pensiones1,027 228



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCIÓN DE BANCA MÚLTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

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

PAGINA 13 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Provisiones y otros 908 157  
Otros (655) (53)  
Efecto Neto en Diferido 6,055 1,393

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

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

Vencimiento Préstamos Financiamiento Total

Banca

Múltiple Banco de

México Banca de Desarrollo Fondos de Fomento Otros Organismos

Pesos

Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	10,933	2,769	-	13,702
Largo	-	-	4,500	3,836	-	8,336
Total	-	-	15,433	6,605	-	22,038

Tasa Promedio 0.00% 0.00% 12.89% 10.89% 0.00%

Otros

Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	7,454	-	25	437	-	7,916
Largo	-	-	497	-	497	-
Total	7,454	-	25	934	-	8,413

Tasa Promedio 5.97% 0.00% 6.66% 5.81% 0.00%

Total Préstamos Interbancarios 7,454 - 15,458 7,539 - 30,451

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 2023.

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

202230 jun

202330 sep

2023

Depósitos a la Vista 54.4% 51.2% 52.2%

Metropolitano 24.3% 24.8% 25.6%

Noroeste - Centro 11.2% 9.1% 8.8%

Norte 7.3% 6.9% 7.5%

Bajío 5.9% 4.8% 4.8%

Sur 5.7% 5.6% 5.5%

Depósitos Ventanilla 45.1% 40.3% 39.9%

Metropolitano 18.1% 16.3% 16.5%

Noroeste - Centro 6.1% 4.0% 4.4%

Norte 8.3% 7.3% 6.6%

Bajío 6.6% 6.6% 6.3%

Sur 6.0% 6.1% 6.1%

Total de Captación del Público 99.5% 91.5% 92.1%

Fondeo Profesional 0.5% 8.5% 7.9%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 14 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

## Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023) PesosDólares

Depósitos a la vista (incluye ahorro) 5.84% 2.98%

Depósitos a plazo 10.17% 0.00%

## Scotiabank-Resultados por Intermediación

(millones de pesos) 30 sep

2023

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable (1,160)

Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros (12)

Resultado por valuación de divisas (1,218)

Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados 3,087

Resultado por compraventa de divisas 858

Costos de transacción (2)

Total 1,553

## Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de septiembre de 2023, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

### Cuarta\*

Clave de Pizarra SCOTIAB 23

Monto de la Emisión \$7,125 millones

Fecha de Emisión y Colocación 18 agosto

2023

Plazo de Vigencia de la Emisión 927 días, aprox.

2.5 años

Garantía Quirografaria

Tasa de interés TIIE 28+0.04

Pago de Intereses Cada 28 días durante la vigencia de la emisión

Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA (mex) / "mxAAA"

Amortización del principal Un sólo pago al vencimiento

\* Programa autorizado por la CNBV en o de 2010

## Emisión de Obligaciones Subordinadas

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

Fecha Inicio Fecha Vencimiento ISIN Plazo Importe (\$) Tasa (%)

18-diciembre-1405-diciembre-24 MX0QSC1N00163,6402,093,000,000 7.4

28-junio-1809-junio-33 MX0QSC1N00245,4603,360,000,000 12.3

11-septiembre-18 Perpetua MX0QSC1N0032-3,455,000,000 11.3

Total de Obligaciones Subordinadas 8,908,000,000

## Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

A continuación, se detallan las emisiones de bonos bancarios estructurados con los que

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 15 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

cuenta Scotiabank actualmente:

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
99_SCOTIAB_4-21	120,000	24-mar-21	08-mar-24	1080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
99_SCOTIAB_5-21	4,772,100	29-abr-21	26-abr-24	1093	Index (IDBTVER)	477,210,000
99_SCOTIAB_6-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1093	Index (IDBTVER)	57,230,000
99_SCOTIAB_9-21	3,928,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	392,820,000
99_SCOTIAB_10-21	3,796,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	379,625,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_2-22	512,600	28-feb-22	27-feb-24	729	Invesco QQQ Series 1	51,260,000
99_SCOTIAB_4-22	571,500	12-may-22	10-nov-23	547	SPDR Gold Shares (GLD)	57,150,000
99_SCOTIAB_5-22	1,246,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	124,686,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_9-22	490,000	23-jun-22	22-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	49,000,000
99_SCOTIAB_10-22	720,100	30-jun-22	29-dic-23	547	Dólar - Peso (USDMXN)	72,010,000
99_SCOTIAB_11-22	5,791,750	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	579,175,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	803,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	80,380,000
99_SCOTIAB_1-23	120,200	03-mar-23	03-sep-24	550	iShares MSCI Emerging Markets ETF (EEM)	12,020,000
99_SCOTIAB_2-23	5,849,350	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	584,935,000
99_SCOTIAB_3-23	423,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	42,360,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2023						
						33,441,205,000

## CAPITALIZACIÓN

Scotiabank

Integración del Capital

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

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

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

1 Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468

2 Resultados de ejercicios anteriores 49,837

3 Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 17,819

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 81,125

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) -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 16 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

10  
conservadorImpuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras  
excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la  
utilidad diferidos a cargo)1,392

11Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo -

12Reservas pendientes de constituir -

13Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización -

14Pérdidas y ganancias ocasionadas por cambios en la calificación crediticia propia  
sobre los pasivos valuados a valor razonable No aplica

15Plan de pensiones por beneficios definidos -

16  
conservadorInversiones en acciones propias -

17  
conservadorInversiones recíprocas en el capital ordinario -

18  
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y  
aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones  
cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido  
(monto que excede el umbral del 10%) -

19  
conservadorInversiones significativas en acciones ordinarias de bancos, instituciones  
financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de  
las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital  
social emitido (monto que excede el umbral del 10%) -

20  
conservadorDerechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%) -

21Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales  
(monto que excede el umbral del 10%, neto de impuestos diferidos a cargo) -

22Monto que excede el umbral del 15% No aplica

23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en  
acciones comunes de instituciones financieras No aplica

24 del cual: Derechos de servicios hipotecarios No aplica

25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias  
temporales No aplica

26Ajustes regulatorios nacionales 9,129

A del cual: Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) -

B del cual: Inversiones en deuda subordinada -

C del cual: Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de  
posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras) -

D del cual: Inversiones en organismos multilaterales -

E del cual: Inversiones en empresas relacionadas -

F del cual: Inversiones en capital de riesgo -

G del cual: Inversiones en sociedades de inversión -

H del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia -

I del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones -

J del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados 8,580

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 548

27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a  
insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 17 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

deducciones -

28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1 10,521

29Capital común de nivel 1 (CET1) 70,603

Capital adicional de nivel 1: instrumentos

30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima 3,483

31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables 3,483

32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables No aplica

33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1 -

34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1) No aplica

35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual No aplica

36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios 3,483

Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios

37

conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1 No aplica

38

conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1 No aplica

39

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

40

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

41Ajustes regulatorios nacionales -

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

43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1 -

44Capital adicional de nivel 1 (AT1) 3,483

45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1) 74,087

Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima 3,904

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

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

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

50

conservadorReservas 804

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 18 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios 4,709  
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios  
52  
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2 No aplica  
53  
conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2 No aplica  
54  
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y  
aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones  
cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido  
(monto que excede el umbral del 10%) No aplica  
55  
conservadorInversiones significativas en el capital de bancos, instituciones  
financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las  
posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social  
emitido No aplica  
56Ajustes regulatorios nacionales -  
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2 -  
58Capital de nivel 2 (T2) 4,709  
59Capital total (TC = T1 + T2) 78,796  
60Activos ponderados por riesgo totales 461,662  
Razones de capital y suplementos  
61Capital Común de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)15.29%  
62Capital de Nivel 1  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.05%  
  
63Capital Total  
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)17.07%  
64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de  
capital común de nivel 1 más el colchón de conservación de capital, más el colchón  
contracíclico, más el colchón D-SIB; expresado como porcentaje de los activos  
ponderados por riesgo totales)18.39%  
65 del cual: Suplemento de conservación de capital2.50%  
66 del cual: Suplemento contracíclico bancario específico0.00%  
67 del cual: Suplemento de bancos de importancia sistémica local (D-SIB)0.60%  
68Capital común de Nivel 1 disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de  
los activos ponderados por riesgo totales)8.29%  
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)  
69Razón mínima nacional de CET1  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
70Razón mínima nacional de T1  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
71Razón mínima nacional de TC  
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3) No aplica  
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por  
riesgo)  
72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras No  
aplica  
73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras No aplica  
74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a  
cargo) No aplica  
75Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos  
de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -  
Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2  
76Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 19 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)  
804

77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada 4,101

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

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

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

80Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual No aplica

81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) No aplica

82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual -

83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual -

85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos) -

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

ReferenciaDescripción

1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6

de las presentes disposiciones.

2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto

acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo,

resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remedaciones por beneficios definidos

a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

4No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos

representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté

representado por títulos representativos o acciones.

5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este

concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.

6Suma de los conceptos 1 a 5.

7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.

8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

10\*Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 20 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

fiscales conforme a lo establecido en la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

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

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

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

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

14 No aplica.

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

16\*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:

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

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

17\*Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

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

---

---

tipo de entidad, no solo entidades financieras.

18\*Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

19\*Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

20\*Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.

21El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.

22No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.

23No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

24No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

25No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.

26Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.

A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 22 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

este concepto entrarán como negativos y viceversa.

B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

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

I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.

O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 23 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

28 Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.

29 Renglón 6 menos el renglón 28.

30 El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.

31 Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.

32 No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.

33 Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).

34 No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

35 No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

36 Suma de los renglones 30, 33 y 34.

37 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

38 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

39 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

40 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

41 Ajustes nacionales considerados:

Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

42 No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

43 Suma de los renglones 37 a 42.

44 Renglón 36, menos el renglón 43.

45 Renglón 29, más el renglón 44.

46 El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.

47 Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

48 No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

49 No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

50 Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.

51 Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.

52 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

53 conservador No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 24 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

nivel 1.

54 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

55 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

56Ajustes nacionales considerados:

Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

57Suma de los renglones 52 a 56.

58Renglón 51, menos renglón 57.

59Renglón 45, más renglón 58.

60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.

61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.

65Reportar 2.5%

66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción

III, del Artículo 2 Bis 5.

67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.

68Renglón 61 menos 7%.

69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.

73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.

76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 25 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

790.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

81No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.

82Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.

83Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.

84Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.

85Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General  
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general

Activo

BG1Efectivo y equivalentes de efectivo 62,254

BG2Cuentas de Margen 1,538

BG3Inversiones en instrumentos financieros 165,334

BG4Deudores por reporto 2,690

BG5Préstamo de valores -

BG6Instrumentos financieros derivados 48,472

BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(1,252)

BG8Total de cartera de crédito (neto) 486,584

BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización -

BG10Otras cuentas por cobrar (neto) 19,884

BG11Bienes adjudicados (neto) 508

BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto) 2,455

BG13Inversiones permanentes 3,946

BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta 14

BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto) 6,026

BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) 2,366

Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto) 1,737

Activos Intangibles (neto) 4,531

Pasivo

BG17Captación tradicional 530,684

BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos 30,451

Valores Asignados por liquidar 8,614

BG19Acreedores por reporto 65,590

BG20Préstamo de valores -

BG21Colaterales vendidos o dados en garantía 1,030

BG22Instrumentos financieros derivados 43,857

BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros -

BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización -

BG25Otras cuentas por pagar 26,681

BG26Obligaciones subordinadas en circulación -

BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad 663

BG28Créditos diferidos y cobros anticipados 1,067

Pasivos por arrendamiento 1,857

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 26 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Instrumentos Financieros que califican como pasivo 9,102  
Pasivos por Beneficio a los Empleados 6,369  
Capital contable  
BG29Capital contribuido 13,468  
BG30Capital ganado 67,654  
Cuentas de orden  
BG31Avales otorgados -  
BG32Activos y pasivos contingentes -  
BG33Compromisos crediticios 257,626  
BG34Bienes en fideicomisos o mandato 450,991  
BG35Agente financiero del gobierno federal -  
BG36Bienes en custodia o en administración 75,900  
BG37Colaterales recibidos por la entidad 10,214  
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad 1,030  
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto) -  
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de  
crédito etapa 3 1,647  
BG41Otras cuentas de registro 1,929,029

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 2023)

IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del  
Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del  
apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos  
regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto  
Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto  
regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia  
mencionada

ACTIVO

1Crédito mercantil8 -

2Otros Intangibles9 -

3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales

10 1,392 BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,392

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización13 -

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e  
ilimitado15 -

6Inversiones en acciones de la propia institución16 -

7Inversiones recíprocas en el capital ordinario17 -

8Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18 -

9Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no  
posea más del 10% del capital social emitido18

10Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución  
posea más del 10% del capital social emitido19 -

11Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución  
posea más del 10% del capital social emitido19

12Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales21 -

13Reservas reconocidas como capital complementario50 804 BG 8 Total de cartera de  
crédito (neto) \$804

14Inversiones en deuda subordinada26-B -

15Inversiones en organismos multilaterales26-D -

16Inversiones en empresas relacionadas26-E -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 27 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

18Inversiones en sociedades de inversión26-G -  
19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H -  
20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J 8,580 BG 16 Activos Intangibles \$4,531 más  
Gastos de Instalación \$4,049  
21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)26-L -  
22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N -  
23Inversiones en cámara de compensación26-P 548 BG 13 Inversiones Permanentes \$ 548

#### PASIVO

24Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil18 -  
25Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles9 -  
26Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado15 -  
27Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por  
beneficios definidos15  
28Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los  
anteriores21 -  
29Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R31 3,483 BG 26  
Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,483  
30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No  
Fundamental33 -  
31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S46 3,904 BG 26  
Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,904  
32Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital  
complementario47 -  
33Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos  
anticipados26-J -

#### CAPITAL CONTABLE

34Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q1 13,468 BG 29 Capital Social \$10,671  
más Prima en Venta de Acciones \$2,797  
35Resultado de ejercicios anteriores2 49,837 BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores  
\$49,837  
36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas  
registradas a valor razonable3 1,476 BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de  
Cobertura de Flujo de Efectivo \$1476  
37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores3 16,343 BG 30 Reservas  
de Capital \$9,112 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta  
(\$763) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$457) más Resultado  
Neto \$8,451  
38Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R31 -  
39Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S46 -  
40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de  
partidas no registradas a valor razonable3, 11 -  
41Efecto acumulado por conversión3, 26-A -  
42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A -

#### CUENTAS DE ORDEN

43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K -  
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL  
44Reservas pendientes de constituir12 -  
45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de  
bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C -  
46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I -  
47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M -  
48Derogado

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 28 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

3Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos fiscales.

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado.

6Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18

7Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.

8Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

9Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

10Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

11Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

12Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.

13Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

14Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

15Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

16Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

17Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 29 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

las presentes disposiciones.

18Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

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

20Cargos diferidos y pagos anticipados.

21La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.

23Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

24Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.

25Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).

26Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.

27Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.

28Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.

29Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

30Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental.

31Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

32Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.

33Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.

34Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.

35Resultado de ejercicios anteriores.

36Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.

37Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.

38Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

39Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.

41Efecto acumulado por conversión.

42Resultado por tenencia de activos no monetarios.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 30 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 2023)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo Importe de posiciones equivalentes Requerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal 57,954 4,636

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,045 84

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA's 3,195 256

Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -

Posiciones en UDI's, UMA's o con rendimiento referido al INPC 42 3

Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General - -

Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal 3,869 310

Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio 1,865 149

Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones 92 7

Posiciones en Mercancía - -

Requerimiento de capital por impacto Gamma 1 0

Requerimiento de capital por impacto Vega 24 2

Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo

Grupo I-A (ponderados al 0%) - -

Grupo I-A (ponderados al 10%) - -

Grupo I-A (ponderados al 20%) - -

Grupo I-B (ponderados al 2%) 51 4

Grupo I-B (ponderados al 4%) - -

Grupo II (ponderados al 0%) - -

Grupo II (ponderados al 10%) - -

Grupo II (ponderados al 20%) - -

Grupo II (ponderados al 50%) - -

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%) 849 68

Grupo III (ponderados al 11.5%) - -

Grupo III (ponderados al 20%) 4,341 347



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 31 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Grupo III (ponderados al 25%)	-	-
Grupo III (ponderados al 50%)	455	36
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	262	21
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	2,770	222
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	157	13
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	26	2
Grupo VI (ponderados al 20%)	3,548	284
Grupo VI (ponderados al 25%)	2,493	199
Grupo VI (ponderados al 30%)	9,491	759
Grupo VI (ponderados al 40%)	10,043	803
Grupo VI (ponderados al 50%)	36,822	2,946
Grupo VI (ponderados al 70%)	35	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	23,788	1,903
Grupo VI (ponderados al 85%)	5,726	458
Grupo VI (ponderados al 100%)	50,696	4,056
Grupo VI (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 11.5%)	134	11
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	18,378	1,470
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	10,090	807
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	120,609	9,649
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	85	7
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,641	131
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	496	40
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 32 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Grupo VIII (ponderados al 115%)	8,081	646
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,701	296
Grupo IX (ponderados al 100%)	31,585	2,527
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	33	3
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	2,173	174
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	20	2
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	14	1

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional  
Método empleado Activos ponderados por riesgo Requerimiento de capital  
Indicador de Negocio 44,982 3,599

## CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

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

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

1 Emisor Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

2 Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg N.A.

3 Marco legal Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.

Tratamiento regulatorio

4 Nivel de capital con transitoriedad N.A.

5 Nivel de capital sin transitoriedad Fundamental

6 Nivel del instrumento Institución de crédito sin consolidar subsidiarias

7 Tipo de Instrumento Acción series "F" y "B"

8 Monto reconocido en el capital regulatorio 13,468,335,561

9 Valor nominal del instrumento Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales

9A Moneda del instrumento Pesos mexicanos

10 Clasificación contable Capital

11 Fecha de emisión 13-ene-01

12 Plazo del instrumento Perpetuidad

13 Fecha de vencimiento Sin vencimiento

14 Cláusula de pago anticipado No

15 Primera fecha de pago anticipado N.A.

15A Eventos regulatorios o fiscales No

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 33 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

ReferenciaDescripción

- 1Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.  
2Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).  
3Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.  
4Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.  
5Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.  
6Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.  
7Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.  
8Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental;
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 34 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

9Valor nominal del título en pesos mexicanos.

9AMoneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217

10Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto.

11Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto.

12Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad.

13Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado.

14Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15AEspecificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.

15BEspecificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.

16Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

17Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.

18Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título

19Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.

20Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).

21Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".

22Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.

23Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

24Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

25Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.

26Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.

27Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.

28Tipo de acciones en las que se convierte el título.

29Emisor del instrumento en el que se convierte el título.

30Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.

31Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.

32Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.

33Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.

34Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.

35Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 35 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

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

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

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

JurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderadorJurisdicciónPonderador

Alemania-Francia-Reino Unido-

Arabia Saudita-Holanda-Rusia-

Argentina-Hong Kong-Singapur-

Australia-India-Sudáfrica-

Bélgica-Indonesia-Suecia-

Brasil-Italia-Suiza-

Canadá-Japón-Turquía-

China-Corea-Otras jurisdicciones diferentes a las anteriores-

España-Luxemburgo-

Estados Unidos-México-

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

ReferenciaRUBROSep-231)

TJun-231)

T-1Mar-23

T-2Dic-22

T-3

1Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 7,799 7,585 7,638 7,719

1aNo aplica

2Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo 461,662 456,829 459,745 475,011

3Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)1.63%1.63%1.63%1.63%

3aNo aplica

4Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-0 Bis de estas disposiciones 831,882 809,032 814,737 807,899

5"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)0.94%0.94%0.94%0.94%

5aNo aplica

6aComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNo

6bComo parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaría la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?NoNoNoNo

6cEn el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 36 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?

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

## Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

---

---

respectivos porcentajes de participación.

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos  
Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo de mercado

La administración del riesgo de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 38 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de septiembre de 2023 fue de \$16.5 millones y su promedio durante el tercer trimestre de 2023 fue de \$26.39 millones mismo que corresponde a un 0.034% del capital neto (\$77,963 millones a agosto 2023, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2023 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre
Septiembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	
Derivados	1,117,4511,099,476
Mercado de Dinero	65,14758,935
Tipo de cambio	
Cash	2,3562,968
Derivados	117,340111,360
Capitales	
Derivados	8,4427,992

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre
Septiembre 2023	Promedio
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	16.7222.98
Tipo de cambio	8.1710.22
Capitales	0.000.00
VaR Global	16.5026.39

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 2023 muestra una pérdida máxima de \$248.76 millones. Los escenarios hipotéticos que se utilizan para esta prueba están basados en 3 escenarios sistémicos relevantes: la crisis de 2008 para mercados emergentes, México 1994 por el denominado "Error de diciembre" y México 1997 por el efecto de la "crisis del rublo" y la crisis financiera asiática.

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

#### Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

---

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

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

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US\$) 72,51383,087  
Liquidity Buffer  
(bajo métrica CCL) 122,949116,211

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

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el tercer trimestre de 2023 de 154% y 109% respectivamente.

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

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 41 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Administración en sus respectivas sesiones.

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

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

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Valor Económico (+100 pbs) (1,181) (1,092)

Sensibilidad de Margen (-100 pbs) (424) (419)

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

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Instrumentos financieros para cobrar o vender 1) .85,65581,198

Derivados de Cobertura 85,96686,173

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

Baja de Calificación

Como medida conservadora y a manera de estar preparados para un posible aumento de requerimientos de liquidez como resultado de una posible baja en la calificación del Banco (esto asociado a que una baja en la calificación del Banco desencadenaría un aumento del colateral requerido en operaciones de derivados), el grupo de administración de riesgos realiza de manera periódica el impacto que tendría este escenario y las consecuencias en las medidas de liquidez y activos líquidos. El impacto de la baja en la calificación de la institución en 3 niveles para cierre de septiembre 2023 y el promedio del tercer trimestre del 2023 fueron \$3,033 millones y \$2,867 millones, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

La facultad para la autorización de créditos es responsabilidad del Consejo de Administración, quien delega esta función en los distintos niveles de resolución. Estos

---

---

niveles de resolución funcionan mediante facultades mancomunadas con lo cual no se permite que un solo funcionario autorice un crédito, es decir, al menos dos funcionarios deben autorizar un crédito. Los niveles de autorización se asignan de acuerdo a la clasificación del riesgo, monto del crédito, tipo de cliente y/o naturaleza de la Presentación de Crédito (tales como crédito nuevo, incremento del crédito o revisión anual).

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

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

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

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

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

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

La calificación de agencias calificadoras es utilizada por el Banco para el cálculo de

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 43 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

la Probabilidad de Incumplimiento en:

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

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

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

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

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

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

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

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

Al cierre del tercer trimestre de 2023, el Banco mantiene \$447 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

---

#### Información metodológica

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

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

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

#### Métricas Riesgo de Crédito<sup>1)</sup>.

(Cifras al 30 de septiembre 2023) Pérdida

Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.30% 3.05%

Consumo 3.83% 13.51%

Cartera Comercial 0.57% 3.94%

Total 0.68% 4.23%

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

#### Parámetros de Riesgo<sup>1)</sup>.

(Cifras a millones al 30 de septiembre 2023) EI<sup>2)</sup>. PISP

Hipotecas 205,076 1.59% 17.09%

Consumo 52,371 4.73% 72.16%

Cartera Comercial 282,519 1.48% 44.13%

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

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

#### Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

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

Políticas para asegurar las garantías reales y establecer reservas de crédito



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

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

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

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

#### Riesgo de crédito en instrumentos financieros

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

Al cierre de septiembre 2023 y en promedio durante el tercer trimestre de 2023, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.67% y 0.79% respectivamente.

#### Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

#### Riesgo Operacional

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

#### Metodología general

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

#### Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

#### Evaluación de riesgo operacional

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

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

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

#### Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

---

---

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

Además de estar sujeto a la metodología general de riesgos operacionales, el Banco cuenta con una metodología de estimación de pérdidas de riesgo legal, a través de la cual se estiman las probables pérdidas como consecuencia de un resultado adverso de sus juicios en proceso. Dicha metodología está basada en la experiencia de pérdidas de ejercicios anteriores, con las que, mediante un análisis estadístico de severidad y ocurrencia, se determina la probabilidad de pérdida de los asuntos legales en curso.

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de julio - septiembre 2023, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$77.4 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2023 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$40.3 millones, donde \$2.4 millones corresponden a riesgo operacional y \$37.9 millones a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

Las auditorías habituales realizadas por un departamento independiente y experimentado de Auditoría Interna de Tecnologías de la Información incluyen revisiones totales del diseño, implementación y explotación de los sistemas de control interno en todas las

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 48 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

áreas de negocio y apoyo, nuevos productos y sistemas y la confiabilidad e integridad de las operaciones de procesamiento de datos.

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: julio 2023 - septiembre 2023 (T3 2023)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T3 2023	Calculo Consolidado T3 2023
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
<b>ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES</b>		
1	Total de Activos Líquidos Computables No aplica	114,362.12 No aplica
<b>SALIDAS DE EFECTIVO</b>		
2	Financiamiento minorista no garantizado	164,728.92
3	Financiamiento estable	96,216.55
4	Financiamiento menos estable	68,512.37
5	Financiamiento mayorista no garantizado	245,689.41
6	Depósitos operacionales	126,569.67
7	Depósitos no operacionales	116,662.31
8	Deuda no garantizada	245,441.32
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica
10	Requerimientos adicionales:	239,825.35
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,383.04
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda---	
13	Líneas de crédito y liquidez	232,442.30
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	30.36
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,856.87
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica
<b>ENTRADAS DE EFECTIVO</b>		
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	4,363.29
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	43,136.88
19	Otras entradas de efectivo	16,692.59
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	64,192.76
Importe ajustado		
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ [1]	No aplica

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

91 días naturales

b) Las principales causas de los resultados del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 49 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(CCL) y la evolución de sus principales componentes.

Durante septiembre 2023, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$65,841 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$34,815 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por \$1,904 millones y \$3,033 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$11,798 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$15,093 millones y por operaciones de call money de \$10,638 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$14,904 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$122,356 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$72,655 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$40,475 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$6,831 millones y \$2,395 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del segundo trimestre 2023: 140% - promedio del tercer trimestre 2023: 154% El coeficiente de cobertura de liquidez creció 1400 pb respecto del segundo trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras decrecieron \$4,518 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN \$2,006 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un crecimiento de \$12,306 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco creció en \$4,632 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$2,351, millones.

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

Evolución de Activos Líquidos T3-2023 Julio Agosto Septiembre

Efectivo 6%6%6%

Reservas en el Banco Central 33%41%33%

Nivel 1 59%51%59%

Nivel 2<sup>a</sup> 2%2%2%

Nivel 2B 0%0%0%

Total de Activos Líquidos Ponderados 100%100%100%

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento Julio Agosto Septiembre

CAPTACION TRADICIONAL

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 50 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Depósitos de exigibilidad inmediata 49%47%48%  
Depósitos a plazo  
Del público en general 37%37%37%  
Mercado de dinero 8%8%7%  
Títulos de crédito emitidos 1%2%2%  
Cuenta global de captación sin movimientos 0%0%0%  
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS  
De exigibilidad inmediata 0%0%0%  
De corto plazo 3%4%4%  
De largo plazo 2%2%2%  
Total 100%100%100%

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

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

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

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

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

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

Exposición Potencial Futura (septiembre 2023)

(Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación 3,198

Sin contrato de compensación 8,479

Posibles llamadas de margen (septiembre 2023)

Colateral en Tránsito 21

Downgrade (septiembre 2023)

Baja calificación 3 niveles 3,033

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

---

Scotiabank-Exposición en Derivados  
(cifras en millones de pesos) Posición Cierre  
Factor de Riesgo  
Tasas de interés 1,117,451  
Tipo de cambio 117,340  
Capitales 8,442  
Total 1,243,233

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el tercer trimestre del 2023, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de -5% al cierre de septiembre del 2023 y en promedio durante tercer trimestre del 2023 fue de -6%.

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



## I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos Límite MM

Concepto

Concentración de Depósitos (MXN) 9,500 MXN

Concentración de Depósitos (USD) 175 USD

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

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

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

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

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

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

Descripción Promedio

---

T3 2023Septiembre 2023

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM) 31,32941,418  
Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM) 165,083175,211  
Horizonte de Supervivencia - Banco (días) 4243  
Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días) 4041  
Horizonte de Supervivencia - Grupo (días) 4243  
Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días) 4041

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

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

Los resultados al cierre de septiembre 2023 y el promedio del tercer trimestre de 2023 son:

Scotiabank Posición  
(Cierre) Posición (Promedio)  
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 72,51383,087  
Liquidity Buffer  
(bajo métrica CCL) 122,949116,211

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

## II. Información cualitativa

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

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

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

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

Dentro del Grupo Financiero existe una unidad encargada de la gestión de la liquidez,

---

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

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

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

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

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

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

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

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

- Medición, supervisión y pronóstico de compromisos que involucren flujos de efectivo para las principales monedas manejadas por el Banco (MXP+UDIs y USD).
- Procurar una distribución uniforme de los flujos de efectivo, minimizando las brechas de liquidez entre activos y pasivos, considerando el impacto potencial de renovaciones,

---

prepagos, retiros de depósitos, otorgamiento de crédito y el incumplimiento en pago de créditos.

- Mantener fuentes diversificadas de fondeo.
- Establecer programas de corresponsalías y préstamos interbancarios para ayudar a mantener el acceso a mercado.
- Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

e)Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 56 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el tercer trimestre de 2023, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del tercer trimestre 2023, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)  
Periodo Reportado: tercer trimestre del 2023

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos) Cifras Individuales Cifras Consolidadas  
Importe sin ponderar por plazo residual / Importe ponderado / Importe sin ponderar por plazo residual / Importe ponderado  
Sin vencimiento < 6 meses / De 6 meses a < 1 año / > 1 año / Sin vencimiento < 6 meses / De 6 meses a < 1 año / > 1 año

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE

1Capital:	83,549.450.000.000.0083,549.45	83,549.450.000.000.0083,549.45
2Capital fundamental y capital básico no fundamental.	83,549.450.000.000.0083,549.45	83,549.450.000.000.0083,549.45
3Otros instrumentos de capital.	0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00	0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00
4Depósitos minoristas:	0.00202,398.351,205.8446.80	187,777.850.00202,398.351,205.8446.80
5Depósitos estables.	0.0089,083.37662.0911.5185,269.700.0089,083.37662.0911.5185,269.70	0.0089,083.37662.0911.5185,269.700.0089,083.37662.0911.5185,269.70
6Depósitos menos estables.	0.00113,314.98543.7535.29102,508.150.00113,314.98543.7535.29	102,508.150.00113,314.98543.7535.29
7Financiamiento mayorista:	0.00362,906.9831,693.4517,029.57161,680.050.00362,906.98	31,693.4517,029.57161,680.050.00362,906.98
8Depósitos operacionales.	0.0022,290.780.000.0011,145.390.0022,290.780.000.0011,145.39	0.0022,290.780.000.0011,145.390.0022,290.780.000.0011,145.39
9Otro financiamiento mayorista.	0.00340,616.2131,693.4517,029.57150,534.660.00340,616.21	31,693.4517,029.57150,534.660.00340,616.21



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 58 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

109.03No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica109.03

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

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

•Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$179,416 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$135,127 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$88,512 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$15,232 millones y \$15,543 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$6,330 millones.

•Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$342,813 millones y por operaciones mercado de dinero de \$16,564 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$14,435 millones, deducciones de capital por \$10,521 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$7,508 millones.

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

Promedio del segundo trimestre del 2023: 107.67% - Promedio del tercer trimestre del 2023: 109.03% El coeficiente de financiamiento neto incrementó 136pb respecto al primer trimestre del 2023, esto debido principalmente a:

a. El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional incrementó en MXN 6,776 millones. El fondeo profesional incrementó en MXN 1,703 millones.

b. El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas disminuyeron \$5,835 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Julio	Agosto	Septiembre
Financiamiento Estable Disponible	433,228	437,236	440,159
Financiamiento Estable Requerido	398,873	400,665	402,496
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	108.61%	109.13%	109.36%

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

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

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

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

Posiciones en Acciones

Al cierre de septiembre de 2023 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$24 millones de pesos, con una minusvalía de \$(0.57) millones de pesos.

---



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 59 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	213,000	0.77	0.80	(0.03)	
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	18,000	1.65	1.67	(0.02)	
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	190,000	2.01	2.08	(0.07)	
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	400,000	5.98	6.62	(0.64)	
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	493,936	1.65	1.70	(0.05)	
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	479	0.06	0.07	(0.01)	
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	3,500	6.73	6.56	0.17	
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	24,000	2.20	2.12	0.08	
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	3,500	1.64	1.65	(0.01)	
Scotiabank	Pública	1I-MCHI-*	2,010	1.52	1.51	0.01	
Total			1,348,425.00	24.21	24.78	(0.57)	

Al cierre del tercer trimestre del año 2023, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$0.52 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	163,547	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	7,952	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	10,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	15,000	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	566,844	0.01	(0.09)	(0.08)
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	61,678	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	11,864	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	66,132	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	241,695	-	(0.38)	(0.38)
Scotiabank	Pública	1-ORBIA-*	2,726	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	89	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-EWZ-*	5,800	0.25	-	0.25
Scotiabank	Pública	1I-GDX-*	5,200	0.10	(0.02)	0.08
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	1,864	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	37	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	4,112	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	13,614	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1-NEMAK-A	120,000	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1A-C-*	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	1E-FRES-*	779	-	(0.04)	(0.04)
Scotiabank	Pública	1I-SHV-*	200	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IBTA-N	2,965	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1I-IB01-N	528	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	500	-	-	-
Scotiabank	Pública	1-ALFA-A	150,000	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1-ARA-*	209,426	-	(0.03)	(0.03)
Scotiabank	Pública	1-GCARSO-A1	38,188	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1-LIVEPOL-C-1	28,519	0.01	(0.08)	(0.07)
Scotiabank	Pública	1-TLEVISA-CPO	159,236	-	(0.18)	(0.18)
Scotiabank	Pública	1-ALPEK-A	193,072	-	(0.24)	(0.24)
Scotiabank	Pública	1-WALMEX-*	20,000	0.03	-	0.03

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 60 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

ScotiabankPública1-NEMAK-A 449,423 - (0.13) (0.13)  
ScotiabankPública1-AMX-B 260,000 0.05 - 0.05

ScotiabankPública1A-C-\* 9,209 0.11 (0.04) 0.07  
ScotiabankPública1E-FRES-\* 805 - (0.04) (0.04)  
ScotiabankPública1I-SHV-\* 1,900 0.04 - 0.04  
ScotiabankPública1I-IBTA-N 13,100 0.02 - 0.02  
ScotiabankPública1I-IB01-N 1,700 0.08 - 0.08  
Total 2,838,004 0.83 (1.35) (0.52)

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

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Sin cotización	EMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.	1,222	---			
Scotiabank	Sin cotización	BLADDEX COM8	8,095	---			
Total 9,317							

Al 30 de septiembre de 2023, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$7.39 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$ 5.43 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.96 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición
Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital		
Por Riesgo General de Mercado	24.44-24.44	22.23%	5.43
Por riesgo específico			
Canasta de acciones,	24.29-24.29	8.00%	1.94
Índices accionarios	0.15-0.15	4.00%	0.01
Requerimiento por riesgos específico	0.15-0.15	4.00%	0.01
Total Requerimiento de capital	7.39		

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-23 sep-23

- 1 Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 736,726 755,925
- 2 (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,527) (10,521)
- 3 Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 726,200 745,404
- 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) 7,944 9,981
- 5 Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 4,364 4,913
- 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 61 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

operaciones con instrumentos financieros derivados) (3,112) (2,479)  
 8(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)  
 9Importe nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos  
 10(Compensaciones realizadas al nominal efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)  
 11Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 9,195 12,415  
 Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores  
 12Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 130 2,690  
 13(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (130) (2,690)  
 14Exposición Riesgo de Contraparte por SFT 3 4  
 15Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros - -  
 16Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 3 4  
 Otras exposiciones fuera de balance  
 17Exposición fuera de balance (importe nominal bruto) 255,252 257,626  
 18(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (181,618) (183,567)  
 19Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 73,634 74,059  
 Capital y exposiciones totales  
 20Capital de Nivel 1 70,881 74,087  
 21Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 809,032 831,882  
 Coeficiente de apalancamiento  
 22Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 8.76% 8.91%

## TABLA II.1

### COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

Referencia DESCRIPCIÓN jun-23 sep-23  
 1 Activos totales 778,445 807,087  
 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 (643) (548)  
 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 (32,394) (36,056)  
 5 Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores (127) (2,686)  
 6 Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 73,634 74,059  
 7 Otros ajustes (9,884) (9,973)  
 8 Exposición del coeficiente de apalancamiento 809,032 831,882

## TABLA III.1

### CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

Referencia DESCRIPCIÓN jun-23 sep-23  
 1 Activos totales 778,445 807,087  
 2 Operaciones en instrumentos financieros derivados (41,589) (48,472)  
 3 Operaciones en reporto y préstamos de valores (130) (2,690)  
 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 736,726 755,925

## TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODOjun-23sep-23Variación

Capital Básico 1) 70,881 74,087 3,206

Activos Ajustados2) 809,032 831,882 22,850

Razón de Apalancamiento 3)8.76%8.91%15 pb

1).Reportado en la fila 20

2).Reportado en la fila 21 y

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

Cifras previas a la réplica de Banxico

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

El indicador se ubicó en 8.91%, 15pb superior respecto al trimestre anterior, por la mejora del capital nivel 1 de \$3,206 millones (+39 pbs) debido principalmente al resultado neto del periodo; compensada por el incremento en los activos ajustados (-24pb), principalmente por las partidas dentro del balance (netas) por \$19,204 millones (-22pb).

## TABLA I.2

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

## ReferenciaExplicación

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico

(menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.

2Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

a)Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

b)La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

c)El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

d)El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

e)El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 63 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

reemplazo de cada contraparte.

5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.

En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.

8No aplica.

9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:

a)Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

b)Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

c)Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

d)Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.

15Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.

Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.

16Suma de las líneas 12 a 15

17Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 64 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

18Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.

El monto se debe registrar con signo negativo.

19Suma de las líneas 17 y 18

20Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

## TABLA II.2

### NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

#### ReferenciaExplicación

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.

.El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo

5Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

6Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

## TABLA III.2

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

#### ReferenciaDescripción

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 65 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

## Agencias Calificadoras

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA (mex) F1+ (mex) Estable

Standard & Poor'ssmxAAAmxA-1+Estable

La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las 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



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 66 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

pagado de Scotiabank, mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta "Resultados Ejercicios Anteriores".

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

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

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

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

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

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

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

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 67 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

de \$0.3555655955272 por acción para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

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

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$91,319 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$62,254 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 2023, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

## I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

---

los siguientes:

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

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

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

PAGINA 70 / 92

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Subyacente\*FuturosOpcionesSwaps

MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (CurrencySwaps), Regular

---

Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (ForwardStarting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

2).(MR) Mercados reconocidos

3).(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 72 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

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 2023 y en promedio para el tercer trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 72,51383,087

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,949116,211

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name Underlying Product Currency Valuation Model Valuation Input Daily Pricing Source

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve



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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 73 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

VALMER

SurfaceBloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option(All Interest Rate)MXN,USD Cap/Floor Black'sInterest  
Rate CurveVALMER

SurfaceBloomberg/Reuters

IRS FuturesTIIE FondeoMXNPricePriceVALMER

Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER

OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread OptionMXN,CAD,USD,  
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with Target  
Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source

OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,

EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVVALMER

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVVALMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVVALMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVVALMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

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

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

PAGINA 74 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,  
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,  
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,  
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER

FX Rate

Surface

Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER  
Price

SurfaceBloomberg/Reuters

Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER  
Price

Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,  
BRL,CLP,COP,PEN,

AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

Instrumentos valuados a costo

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source

Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY PricePriceVALMER

Políticas Líneas de Crédito

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

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

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

- Necesidades de tesorería del Banco
- Relación de corresponsalía
- Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

- Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

- Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

1)Tesorería: Call Money

2)Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

---

- 
- 3) Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles
  - 4) Cambios: FOREX
  - 5) Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)
  - 6) Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos
  - 7) Metales

#### Sujetos de Crédito

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

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

#### Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

#### Idoneidad del Cliente

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

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

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

#### Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el

---

---

valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

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

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

Métodos y técnicas de Valuación:

##### Cálculo de Sensibilidades

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

##### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

##### Bonos de Tasa Flotante

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

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

##### Bonos Cupón Cero

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

##### Riesgo de Crédito

---

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

#### Sensibilidad del Pasivo

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

#### Derivados de Tasas de Interés

##### Swaps de Tasa de Interés

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

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

##### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

##### Futuros de Bono M

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

##### Futuros de CETE

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

#### Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

---

---

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

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

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

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

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

Durante el tercer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

---

su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

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

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

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

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,949,116,211

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

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

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

Parámetro Descripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j



Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

Scotiabank

(millones de pesos) Normal Escenario Posible Escenario Probable Escenario de Estrés  
Gap 30d Gap Acum 72,513 69,455 69,407 69,358

Cambios en el Gap respecto al escenario normal (3,058) (3,106) (3,155)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.

Exposición Delta: Se define como el monto nocional equivalente del subyacente (en cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de

---

delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas gamma1 y gamma5.

Gamma1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que gamma5 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

#### Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.

Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.

#### Dividend Risk

La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

El riesgo de dividendos no tiene una letra "griega" asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 82 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

## 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, 2023:

Scotiabank

0-3 Meses 3 - 12 Meses 1 - 3 Años 3 - 5 Años 5 - 10 Años 10 - 30 Años Total

Swaps (113,268.00) (50,839.00) 97,760.00 359,483.00 20,265.00 (18,899.00) 294,502.00

CCS 5.00 (17.00) (46.00) 94.00 214.00 (12.00) 238.00

Caps & Floors (300.00) 3,713.00 2,513.00 (352.00) 2.000.00 5,576.00

Binary Caps & Floors -----

TIIE Futures -----

Mbonds Futures -----

Total DERIVADOS (113,563.00) (47,143.00) 100,227.00 359,225.00 20,481.00 (18,911.00)

300,316.00

1). Cifras expresadas en pesos

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap & Floor el método para calcular las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

a) Bajo el escenario probable una pérdida de (190.87) Millones de pesos.

b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (381.74) Millones de pesos.

c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (918.98) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de -10%, -30% y -50% para escenarios a la baja y de 5%, 15% y 20% de escenarios al alza.

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock (+/-) P&L Stress 1

Shock (+/-) P&L Stress 2

Shock (+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIE

y Bono M - - 50.00 - 100.00 - 200.00 -

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps 0.30 28.27 50.00 (15.02) 100.00 (30.03) 200.00 (60.06)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.03) (0.97) 0.10 - 0.40 (0.01) 1.00 (0.03)

a FX % Forwards 87.26 1,568.56 0.10 (156.86) 0.20 (313.71) 0.50 (784.28)

a FX % Opciones Divisa - - 0.10 - 0.20 - 0.50 -

Total (171.88) (343.75) (844.37)

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 83 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

b. Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 30 de septiembre de 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo esta cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma  
Options AAPL.OQ---  
Options BNPUI5.INDX152,351.005,548.0038,930.00  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX92,417.002,306.0024,343.00  
Options META.OQ---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL244,768.007,854.0063,273.00

1). Cifras expresadas en pesos

## Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable -10%, poco probable -30% y muy poco probable -50% son los siguientes:

Escenarios a la baja(0.1) (0.3) (0.5)  
Options AAPL.OQ---  
Options BNPUI5.INDX(15,235.10) (45,705.30) (76,175.50)  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX(9,241.70) (27,725.10) (46,208.50)  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 84 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

TOTAL (24,476.80) (73,430.40) (122,384.00)

1).Cifras expresadas en pesos

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)

Options AAPL.OQ---

Options BNPUI5.INDX7,617.5522,852.6530,470.20

Options EEM.P---

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options FXI.P---

Options GLD.P---

Options GOOG.OQ---

Options ICLN.OQ---

Options MEXIBX.INDX4,620.8513,862.5518,483.4

Options MXSXAE.INDX---

Options HSCE.INDX---

Options MEXXLK.USM---

Options IBM.USM---

Options SBUX.USM---

Options IBM.USM---

TOTAL12,238.4036,715.2048,953.60

1). Cifras expresadas en pesos

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

ScotiabankMonto

Probable(24,476.80)

Poco Probable(73,430.40)

Muy poco Probable(122,384.00)

1).Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de septiembre de 2023 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteMonedaColateral RecibidoColateral Enviado

CLIENTE 1MXN366,000,000 (175,000,000)

CLIENTE 2MXN216,300,000 (54,000,000)

CLIENTE 3MXN21,600,000 (11,200,000)

CLIENTE 4MXN317,795,280 (224,100,000)

CLIENTE 5USD75,060,000 (41,200,000)

CLIENTE 6USD45,990,000 (17,250,000)

CLIENTE 7USD213,500,000 (335,900,000)

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 85 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

CLIENTE 8USD-	(830,000)
CLIENTE 9USD3,590,000 (6,830,000)	
CLIENTE 10USD43,500,000 (27,640,000)	
CLIENTE 11MXN41,100,000 (68,200,000)	
CLIENTE 12MXN414,300,000 (217,800,000)	
CLIENTE 13MXN454,800,000 (198,000,000)	
CLIENTE 14MXN322,500,000 (277,776,432)	
CLIENTE 15MXN2,000,000-	
CLIENTE 16USD8,300,000-	
CLIENTE 17USD120,000 (840,000)	
CLIENTE 18MXN-	(33,200,000)
CLIENTE 19USD21,520,000 (13,230,000)	
CLIENTE 20USD -	(1,300,000)
TOTAL 2,567,975,280 (1,704,296,432)	

1).Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 86 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 87 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 88 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 89 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 90 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 91 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**COMENTARIOS Y ANALISIS DE LA  
ADMINISTRACIÓN SOBRE LOS RESULTADOS  
DE OPERACIÓN Y SITUACIÓN FINANCIERA DE LA  
COMPAÑÍA**

PAGINA 92 / 92

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(1) Autorización y bases de presentación-

## Autorización

El 20 de octubre de 2023, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2022 adjuntos se someterán a la aprobación de los Accionistas.

## Bases de presentación

### a) Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 "Estructura de las normas de información financiera", considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A "Marco conceptual", así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad". Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 "Supletoriedad", y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable ,

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.

## b) Información financiera comparativa

El 13 de marzo de 2020 se publicó en el Diario Oficial de la Federación la resolución que modifica las Disposiciones, la cual establece que las instituciones de crédito reconozcan el efecto de los cambios contables que surgen de dicha resolución en utilidades retenidas, sin reformular los estados financieros de ejercicios anteriores al 1 de enero de 2022, y que los estados financieros básicos consolidados al y por el año terminado el 31 de diciembre de 2021, no se presenten.

## c) Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

## Juicios

La información sobre juicios realizados en la aplicación de políticas contables que tienen el efecto más importante sobre los importes reconocidos en los estados financieros consolidados se describe en las siguientes notas:

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).

-Nota 9 - Derivados: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.

-Nota 10 - Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).

-Nota 14 - Arrendamientos: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

## Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

La información sobre supuestos e incertidumbres de estimación que tienen un riesgo significativo de resultar en un ajuste material a los importes en libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las notas a continuación:

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

-Nota 3 - Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

-Nota 10 - Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.

-Nota 18 - Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.  
-Nota 20 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto, correspondiente a precios obtenidos exclusivamente con datos de entrada de Nivel 1.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios) que corresponde a precios obtenidos con datos de entrada nivel 2.

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo, para aquellos previos obtenidos con datos de entrada nivel 3.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 4 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

- I.Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.
- II.Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.
- III.Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones I y II referidas anteriormente.

El proveedor de precios contratado por el Banco que le proporciona los precios e insumos para la determinación de la valuación de los instrumentos financieros es Valuación Operativa y Referencias de Mercado, S. A. de C. V. (VALMER).

Durante el año terminado el 31 de diciembre de 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2022.

Al 31 de diciembre de 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

- Nota 7 - Inversión en instrumentos financieros; y
- Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

d) Moneda funcional y de informe

Los estados financieros consolidados antes mencionados se presentan en moneda de informe peso mexicano, que es igual a la moneda de registro y a su moneda funcional.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 5 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

## e) Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

## f) Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

Los estados financieros consolidados reconocen los activos y pasivos provenientes de operaciones de compraventa de divisas, inversiones en valores, préstamo de valores e instrumentos financieros derivados en la fecha en que la operación es concertada, independientemente de su fecha de liquidación.

## (2) Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan, excepto por lo que se indica en la nota 4 que incluye los cambios contables reconocidos durante el ejercicio.

### (a) Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

	Inflación
31 de diciembre de	UDIDel añoAcumulada
2022	7.58%19.50%
2021	7.61%14.16%
2020	6.23%11.31%

### (b) Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 6 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

de las entidades al 31 de diciembre de 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2022, se detallan a continuación:

Subsidiaria	Participación	Ubicación	Actividad
Inmobiliaria	99.99%	Ciudad de México	Administración de activo fijo
Scotia Servicios	99.99%	Ciudad de México	Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados	100%	Ciudad de México	Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder

#### (c) Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el periodo en que se originan.

#### (d) Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

#### (e) Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compra de divisas que no se consideren instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos; en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo. Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

## (f) Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, en las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

## (g) Inversiones en instrumentos financieros

### i. Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste,

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

## ii. Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como:

-Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

-Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

-Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

-Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

-Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

-Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 9 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Cuando se realice alguna reclasificación conforme a lo antes mencionado, el Banco deberá informar de este hecho por escrito a la Comisión dentro de los 10 días hábiles siguientes a su determinación, exponiendo detalladamente el cambio en el modelo de negocio que las justifique. Dicho cambio deberá estar autorizado por el Comité de Riesgos del Banco.

Durante el año terminado al 31 de diciembre de 2022, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados:

-el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

-las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados como se menciona en la hoja siguiente.

-el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

-las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio -

El Banco realiza una evaluación del objetivo del modelo de negocio en el que se mantiene un instrumento financiero a nivel del portafolio, ya que esto es lo que mejor refleja la manera en que se administra el negocio y se entrega la información a la Administración. La información considerada incluye lo que se muestra a continuación:

-las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

-cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

-los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

-cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

-la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en periodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras.

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son SPPI -

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal" se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

-eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

-términos que pudieran generar apalancamiento;

-términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

-términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

-características de pago anticipado y prórroga; y

-términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 11 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas -

Instrumentos financieros negociables (IFN) Posteriormente, y en cada fecha de reporte los títulos se valúan a valor razonable proporcionado por un proveedor de precios independiente; los efectos de valuación y los resultados por compraventa se reconocen en los resultados del ejercicio, dentro del rubro "Resultado por intermediación". Cuando los títulos son enajenados, el resultado por compraventa se determina del diferencial entre el precio de compra y el de venta, debiendo reclasificar el resultado por valuación que haya sido previamente reconocido en los resultados del ejercicio, al resultado por compra venta dentro de dicho rubro.

Los intereses devengados de los títulos de deuda se determinan conforme al método de interés efectivo y se reconocen en los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses".

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura. Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI) Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV) Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".

Inversiones en acciones a través de ORI Estos activos se miden posteriormente al valor razonable. Los dividendos se reconocen como ingresos en resultados a menos que el dividendo claramente represente una recuperación de parte del costo de la inversión. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otro resultado integral.

iii. Baja en cuentas

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una

---

---

transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

#### iv.Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el periodo en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del periodo, como una reversión de PCE previamente reconocida.

#### Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contraparte deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

#### (h)Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14

---

---

"Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros que se recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio.

(i) Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses".

(j) Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

-Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

-Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Operaciones con fines de negociación-

-Títulos Opcionales ("Warrants"):

Los títulos opcionales son documentos que se emiten en serie y se colocan entre el gran público inversionista, representan un derecho temporal adquirido por los tenedores a cambio del pago de una prima por la emisión en Acciones o Índices, por lo tanto, dicho derecho expira al término del plazo de vigencia, por lo que la tenencia de estos implica el reconocimiento de que el valor intrínseco y el precio de mercado del título opcional en el mercado secundario puedan variar en función del precio de mercado de los activos de referencia.

-Contratos adelantados ("forwards") y futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria. El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

-Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

-Swaps:

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se transforma activos denominados en moneda extranjera a nacional o viceversa. Los derivados pueden ser utilizados para cubrir flujos de caja o valor económico de diferentes activos y pasivos del Banco, existiendo políticas de control definidas para la designación y seguimiento continuo de la efectividad de tales coberturas.

Al inicio de las relaciones de cobertura designadas, el Banco documenta el objetivo y estrategia de gestión de riesgos para llevar a cabo la cobertura. El Banco también documenta la relación económica entre la partida cubierta y el instrumento de cobertura, fueron formalmente designados a exposiciones alojadas en el estado de situación financiera, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 16 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

-Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

-Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe descontinuar prospectivamente cuando deja de cumplir con los criterios para reconocer una relación de cobertura, esto incluye cuando el instrumento de cobertura se vende, expira, se rescinde o se ejerce, así como después de que se ha considerado o llevado a cabo cualquier reequilibrio en la relación de cobertura y la relación de cobertura resulta ser no efectiva o no cumple con el objetivo de la administración de riesgo del Banco.

Derivados implícitos-

El Banco mantiene derivados implícitos que no se utilizan para cubrir posiciones, sino como estrategia de negociación; dichos derivados se encuentran relacionados a estructuras y/o notas emitidas bajo las siguientes características.

Notas estructuradas (bonos bancarios): Se emiten instrumentos de captación en los que por medio de opciones implícitas, se puede ofrecer un rendimiento garantizado y/o se mejora la tasa de rendimiento del cliente (ver nota 16).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses".

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados financieros OTC por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados CDS a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

## (k) Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de "Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

La estimación de pérdidas crediticias esperadas correspondiente a los montos por cobrar antes mencionados, deberá determinarse de conformidad con lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros por cobrar".

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

## (l) Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de

---

---

crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, hipotecaria de vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación.

Créditos comerciales. Incluye los créditos mencionados a continuación:

- a) los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;
  - b) créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;
  - c) créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;
  - d) créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;
  - e) los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y
  - f) aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco
-



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 19 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

-El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

-El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten

---

---

con garantía de inmuebles.

#### Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte, se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

#### Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

#### Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3r.

#### Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

- a) La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito.
- b) Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos.
- c) Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en

---

---

que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

#### Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen a continuación:

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

- cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
- cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM, UMA o UDI);
- concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito;
- prórroga del plazo del crédito;
- modificación al esquema de pagos pactado, o
- ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por lo que da de baja el crédito original.

Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

- Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.
- Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los períodos consecutivos inmediatos anteriores.
- Para la cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, cuando presentan atrasos de hasta un mes o atrasos de hasta tres meses para cartera que cuenta con prórroga; en el caso de cartera de crédito ROA cuando presenta de tres a seis meses de atraso, siempre que cada uno de los pagos realizados durante dicho período representa al menos el 5% de la amortización pactada.
- En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3o).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

- Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.
  - En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
  - Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
  - Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.
-

---

Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

### Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

1. Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

2. Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

3. Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como se muestra a continuación:

a. Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

b. Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

c. Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

4. Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

5. Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

- a) los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
- b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
- c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho período representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago	contractual	Equivalencia
30 días	90 días	
Quincenal	2 quincenas	Más de 6 quincenas
Catorcenal	2 catorcenas	Más de 6 catorcenas
Decenal	3 decenas	Más de 9 decenas
Semanal	4 semanas	Más de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

- Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses
- Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en periodos consecutivos inmediatos anteriores.
- Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda. Cuando presentan atrasos de mayores a tres meses, en el caso de créditos ROA, si presentan tres a seis meses de atraso, si alguno de los pagos realizados durante dicho período no representa al menos el 5% de la amortización pactada, y para créditos ROA cuando presentan atrasos mayores a 6 meses.
- Cartera de crédito comercial, si presenta atrasos mayores o iguales a 90 días naturales o 3 meses calendario.

En el caso de adquisiciones de cartera de crédito, para la determinación de los días naturales de vencimiento, se consideran los incumplimientos que se hayan presentado desde su originación.

Los créditos que estando en Etapa 3 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 25 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
- b) se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen lo siguiente:

- a) el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración, y

- b) el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen siguiente:

- a) se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración
  - b) se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación o reestructuración debió haber sido cubierto, y
  - c) se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 26 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o renueva y hasta en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Se considera cumplido el requisito de los incisos a) de los dos párrafos anteriores, cuando habiéndose cubierto el interés devengado a la última fecha de corte, el plazo transcurrido entre dicha fecha y la reestructura o renovación no excede el menor entre la mitad del periodo de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovar por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección "Etapa 3" de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de "Etapa 3".

-Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.

-Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

-Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

-Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

-Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

- a) Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.
- b) Para créditos con periodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.
- c) En el caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los periodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de periodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a periodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

En los casos de los créditos adquiridos al INFONAVIT, el Banco está obligado a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando ocurra alguno de los siguientes supuestos:

- a) El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,
- b) Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

- a) El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;
  - b) Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y
  - c) La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.
-

---

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los periodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha hasta acreditar pago sostenido y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

En todo caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse de que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, deberá tener a disposición de la Comisión evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener es lo que se señala a continuación:

- a) probabilidad de incumplimiento intrínseca del acreditado,
- b) las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- c) la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- d) la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de "Ingresos por intereses", así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de "Gastos por intereses".

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

1. Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.
2. Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.
3. Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del periodo, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada periodo.

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 29 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

crédito pueden ser confiablemente estimados; sin embargo, en aquellos casos en que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, previa autorización del Comité de Crédito.

El Banco considera que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito son confiablemente estimados en la mayoría de las circunstancias, sin embargo, en aquellos casos en que no es posible estimarlos confiablemente, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales, documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, lo cual es autorizado por el comité de crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un periodo de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

(m) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

Con base al párrafo 3 del criterio A-4 "Aplicación Supletoria a los Criterios de Contabilidad" emitido por la Comisión, el Banco había adoptado la NIIF 15 "Ingresos provenientes de contratos con clientes" el cual incorpora el reconocimiento de ingresos derivados de programas de fidelización con clientes, y por lo tanto la IFRIC 13 "Programa de fidelidad de clientes" queda sin efecto. De acuerdo con la NIIF 15, una porción de los ingresos por cuota de intercambio se difiere en el momento en que se identifican las obligaciones de cumplir, es decir, de entregar los premios a los que los clientes tienen derecho y se amortizan contra resultados una vez que se satisface dicha obligación de cumplir.

(n) Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

(o) Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 30 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

a) El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).

b) Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determina conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales ordenadas por la Comisión, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

- a) origen de las estimaciones;
- b) metodología para su determinación;
- c) monto de estimaciones por constituir, y
- d) tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

I. Entidades federativas y municipios.

II. Proyectos con fuente de pago propia.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 31 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

III. Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

IV. Entidades Financieras.

V. Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

a) Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

b) Con Ingresos Netos o Ventas Netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA, ix) prórroga.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 32 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y (xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación:

Rangos de porcentaje de estimación preventiva

GradoConsumo

de riesgoNo RevolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial

DeADeADeADeA

A-10%2.0%0%3.0%0%0.50%0%0.90%

A-22.01%3.0%3.01%5.0%0.501%0.75%0.911.5%

B-13.01%4.0%5.01%6.5%0.7511.0%1.512.0%

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 33 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

B-24.01%5.0%6.51%8.0%1.0011.5%2.012.5%  
B-35.01%6.0%8.01%10.0%1.5012.0%2.515.0%  
C-16.01%8.0%10.01%15.0%2.0015.0%5.0110.0%  
C-28.01%15.0%15.01%35.0%5.00110.0%10.0115.5%  
D15.01%35.0%35.01%75.0%10.00140.0%15.5145.0%  
E35.01% 100%75.01%100%40.001100%45.01100%

Castigos y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3r.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

(p)Otras cuentas por cobrar, neto

Se integra de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias, partidas asociadas a

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 34 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro-

El Banco constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por las cuentas por cobrar conforme a lo que se muestra a continuación:

Origen de la cuenta por cobrar Criterio de reconocimiento de la estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro

Cuentas liquidadoras. Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar directamente relacionadas con la cartera de crédito, tales como gastos de juicio. Se aplica el mismo porcentaje de riesgo asignado para el crédito asociado para la constitución de la estimación.

Documentos de cobro inmediato no cobrados con 15 o más días naturales de haber sido registrados como "Otras cuentas por cobrar, neto". Se clasifican como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro. Se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

Préstamos a funcionarios y empleados, derechos de cobro y otras cuentas por cobrar diversas pactadas desde su origen. El Banco determina un grado de irrecuperabilidad con base en su experiencia de pérdidas crediticias pasadas, cambios actuales en el comportamiento de sus clientes y previsiones económicas futuras, para lo cual clasifica sus cuentas por cobrar por grado de atraso en pago y asigna diferentes montos de PCE a cada uno de los segmentos de sus cuentas por cobrar.

Amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas en 30 días naturales posteriores a su vencimiento. Se constituye una estimación por el importe total.

Otras cuentas por cobrar distintas a las anteriores de deudores no identificados con 60 días o más de haber sido registrados. Se constituye una estimación por el importe total.

No se reconoce estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro sobre los saldos de impuestos a favor ni por el Impuesto al Valor Agregado (IVA) acreditable.

(q) Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

---



---

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un período de tiempo a cambio de una contraprestación. El Banco evalúa si un contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado de manera implícita o explícita en un contrato.

Al comienzo o en la modificación de un contrato que contiene un componente de arrendamiento, el Banco asigna la contraprestación en el contrato a cada componente de arrendamiento o servicio sobre la base de sus precios independientes relativos.

El Banco reconoce un activo por derecho de uso y un pasivo por arrendamiento en la fecha de inicio del arrendamiento. El activo por derecho de uso se mide inicialmente al costo, que comprende el monto inicial del pasivo por arrendamiento ajustado por cualquier pago de arrendamiento realizado en o antes de la fecha de inicio, más los costos directos iniciales incurridos y una estimación de los costos para dismantelar o para restaurar el activo subyacente o el sitio en el que se encuentra, menos los incentivos de arrendamiento recibidos.

El activo por derecho de uso se deprecia posteriormente utilizando el método de línea recta desde la fecha de inicio hasta el final del plazo del arrendamiento, a menos que el arrendamiento transfiera la propiedad del activo subyacente al Banco al final del plazo del arrendamiento o el costo del activo por derecho de uso refleja que el Banco ejercerá una opción de compra. En ese caso, el activo por derecho de uso se depreciará a lo largo de la vida útil del activo subyacente, que se determina sobre la misma base que los de propiedades y equipo. Además, el activo por derecho de uso se reduce periódicamente por pérdidas por deterioro, si corresponde, y se ajusta por ciertas nuevas valuaciones del pasivo por arrendamiento como cambios en el monto de la renta por ajuste de inflación.

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

El Banco determina su tasa incremental de financiamiento obteniendo tasas de interés de varias fuentes de financiamiento externo y realiza ciertos ajustes para reflejar los términos del arrendamiento (como plazo del arrendamiento y moneda en que se encuentran denominados los pagos) y el tipo de activo arrendado.

Los pagos de arrendamiento incluidos en la valuación del pasivo por arrendamiento comprenden lo siguiente:

- pagos fijos, incluidos los pagos en sustancia fijos;
  - pagos de arrendamiento variables que dependen de un índice o una tasa, inicialmente valuados utilizando el índice o la tasa en la fecha de inicio;
  - importes que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; y
  - el precio de ejercicio bajo una opción de compra que el Banco está razonablemente seguro de ejercer, los pagos de arrendamiento en un período de renovación opcional si el Banco está razonablemente seguro de ejercer una opción de extensión y las sanciones por la terminación anticipada de un arrendamiento a menos que el Banco esté
-

---

razonablemente seguro de no terminar antes de tiempo.

El pasivo por arrendamiento se valúa al costo amortizado utilizando el método de interés efectivo. Se vuelve a valuar cuando hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa, si hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual, si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o si hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valuar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro "Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(r) Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

- a) al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o
- b) al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 37 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

## Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como "Otros ingresos (egresos) de la operación".

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como "Otros ingresos (egresos) de la operación". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra a continuación:

## Porcentaje de reserva

Meses transcurridos a partir de la adjudicación o dación en pago Bienes inmuebles Bienes muebles, derechos de cobro e inversiones en valores

Hasta 6 meses 0%0%

Más de 6 y hasta 12 10%

Más de 12 y hasta 18 20%

Más de 18 y hasta 24 45%

Más de 24 y hasta 30 60%

Más de 30 y hasta 36 100%

Más de 36 y hasta 42 100%

Más de 42 y hasta 48 100%

Más de 48 y hasta 54 100%

Más de 54 y hasta 60 100%

Más de 60 100%

Al momento de la venta de los bienes adjudicados, el diferencial entre el precio de venta y el valor en libros del bien adjudicado, neto de estimaciones, se reconoce directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

## Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

(s) Propiedades, mobiliario y equipo

Las propiedades, mobiliario y equipo son registrados a su costo de adquisición. Los saldos que provienen de adquisiciones realizadas hasta el 31 de diciembre 2007, se actualizaron mediante factores derivados del valor de la UDI de su fecha de adquisición hasta esa fecha, que fue cuando se suspendió el reconocimiento de la inflación en la información financiera de acuerdo a las NIF. Los componentes adquiridos en moneda extranjera se registran al tipo de cambio histórico, es decir, a aquellos vigentes en

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

la fecha de adquisición del bien.

La depreciación se calcula usando el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la Administración del Banco de los activos correspondientes.

El monto a depreciar de las propiedades, mobiliario y equipo se determina después de deducir a su costo de adquisición su valor residual y, en su caso menos las pérdidas por deterioro acumuladas. El Banco evalúa periódicamente el valor residual, para determinar el monto depreciable de dichas propiedades, mobiliario y equipo.

El Banco evalúa periódicamente los valores netos en libros de las propiedades, mobiliario y equipo, para determinar la existencia de indicios de que dichos valores exceden su monto recuperable. El monto recuperable es aquel que resulte mayor entre el precio neto de venta y el valor de uso. Si se determina que los valores netos en libros exceden su monto recuperable, el Banco reconoce el deterioro con cargo a los resultados del ejercicio para reducirlos a este último monto. Los gastos de mantenimiento y reparaciones menores se registran en los resultados cuando se incurren.

## (t) Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros consolidados a la misma fecha y por el mismo periodo que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

Las otras inversiones permanentes en donde no se tiene el control, control conjunto, ni influencia significativa son clasificadas como otras inversiones, las cuales se reconocen inicialmente y se mantienen valuadas a su costo de adquisición. En caso de que haya dividendos provenientes de dichas inversiones se reconocen en resultados en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación, neto", excepto si provienen de utilidades de periodos anteriores a la adquisición, en cuyo caso se disminuyen de la inversión permanente.

Al 31 de diciembre de 2022, no se reconocieron pérdidas por deterioro en las otras inversiones permanentes.

## (u) Activos de larga duración disponibles para su venta

Los activos de larga duración se clasifican como disponibles para su venta si cumplen todos los requisitos que se muestran a continuación:

- a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.
  - b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.
  - c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se
-

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 39 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

Los activos de larga duración disponibles para su venta que cumplan con los requisitos anteriores se valúan en la fecha de aprobación del plan de venta a su valor neto en libros o al precio neto de venta, el menor. En su caso, la pérdida por deterioro debe aplicarse a los resultados del ejercicio.

(v) Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

El impuesto a la utilidad diferidos y la PTU diferida se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad y PTU diferidos (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas, y en el caso de impuestos a la utilidad, por las pérdidas fiscales por amortizar y otros créditos fiscales por recuperar.

Los activos y pasivos por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad y PTU diferidos se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de "Otros activos", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Beneficios a empleados" en el estado de situación financiera consolidado.

El activo por impuesto a la utilidad y PTU diferidos se evalúan periódicamente creando, en su caso una reserva de valuación por aquellas diferencias temporales por las que pudiese existir una recuperación incierta.

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" en el estado consolidado de resultado integral.

(w) Otros activos

Principalmente se incluyen en este rubro los activos intangibles que corresponden a

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

software desarrollado internamente, cuyos costos incurridos en la fase de desarrollo se capitalizan y se amortizan en los resultados del ejercicio a partir de que dicho software está listo para funcionar, mediante el método de línea recta, con base en la vida útil estimada por la administración del Banco.

Ante la presencia de algún indicio de deterioro del valor de un activo, se determina la posible pérdida por deterioro, y en caso de que el valor de recuperación sea menor al valor neto en libros se reduce el valor del activo y se reconoce la pérdida por deterioro en los resultados del ejercicio.

(x) Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

a) Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una estimación de irrecuperabilidad por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

b) Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

c) Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

d) Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por pagar" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 41 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como un cargo o crédito diferido, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en proporción al vencimiento de los títulos.

(y) Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación reúnen las características establecidas por la NIF C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el principal del instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

(z) Préstamos interbancarios y de otros organismos

En este rubro se registran los préstamos directos de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento. Asimismo, incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

(aa) Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

(bb) Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (v) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las remediones se reconocen en resultados en el período en que se devengan.

Beneficios por terminación

Se reconoce un pasivo y un costo o gasto por beneficios por terminación cuando el Banco no tiene alternativa realista diferente que la de afrontar los pagos o no pueda retirar la oferta de esos beneficios, o cuando cumple con las condiciones para reconocer los costos de una reestructuración, lo que ocurra primero. Si no se espera que se liquiden dentro de los 12 meses posteriores al cierre del ejercicio anual, entonces se descuentan.

Beneficios post-empleo

Planes de contribución definida



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 43 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 20).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

El cálculo de las obligaciones por los planes de beneficios definidos se realiza anualmente por actuarios, utilizando el método de crédito unitario proyectado. Cuando el cálculo resulta en un posible activo para el Banco, el activo reconocido se limita al valor presente de los beneficios económicos disponibles en la forma de reembolsos futuros del plan o reducciones en las futuras aportaciones al mismo. Para calcular el valor presente de los beneficios económicos, se debe considerar cualquier requerimiento de financiamiento mínimo.

El costo laboral del servicio actual, el cual representa al costo del período de beneficios al personal jubilado por haber cumplido un año más de vida laboral con base en los planes de beneficios, se reconoce en los gastos de administración y promoción. El Banco determina el gasto (ingreso) por intereses neto sobre el pasivo (activo) neto por beneficios definidos del período, multiplicando la tasa de descuento utilizada para medir la obligación de beneficio definido por el pasivo (activo) neto definido al inicio del período anual sobre el que se informa, tomando en cuenta los cambios en el pasivo (activo) neto por beneficios definidos durante el período como consecuencia de estimaciones de las aportaciones y de los pagos de beneficios.

Las modificaciones a los planes que afectan el costo de servicios pasados, se reconocen en los resultados de forma inmediata en el año en el cual ocurra la modificación, sin posibilidad de diferimiento en años posteriores. Asimismo, los efectos por eventos de liquidación o reducción de obligaciones en el período, que reducen significativamente el costo de los servicios futuros y/o que reducen significativamente la población sujeta a los beneficios, respectivamente, se reconocen en los resultados del período.

Las remediones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

(cc)Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren en un período de 12 a 360 meses, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

(dd) Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

(ee) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

(ff)Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en tanto dichas eventualidades no se materialicen, respectivamente.

-Compromisos crediticios:

El saldo representa el importe de cartas de crédito otorgadas por el Banco que son consideradas como créditos comerciales irrevocables no dispuestos por los acreditados y líneas de crédito autorizadas no ejercidas.

Las partidas registradas en esta cuenta están sujetas a calificación.

-Bienes en fideicomiso o mandato:

El Banco registra en cuentas de orden las operaciones de Bienes o Fideicomisos acorde a lo siguiente:

- Las que se limita al reconocimiento del patrimonio fideicomitado (activos del contrato), es decir, el valor de los bienes recibidos en fideicomiso netos de los pasivos, llevándose en registros independientes los datos relacionados con la administración de cada fideicomiso.

- Las que por sus activos y pasivos resultan de las operaciones y cuyo reconocimiento y valuación se efectúa conforme a lo dispuesto en los criterios contables específicos aplicables al Banco.

Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el periodo en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio fideicomitado.

En ningún caso estos bienes estarán afectos a otras responsabilidades que las derivadas del fideicomiso mismo, o las que contra ellos corresponda a terceros de acuerdo con la Ley.

Cuando por la naturaleza de los fideicomisos establecidos en el Banco existan activos o pasivos a cargo o a favor de este, éstos se reconocen en el estado de situación financiera consolidado, según corresponda.

En el mandato se registra el valor declarado de los bienes objeto de los contratos de mandato celebrados por el Banco.

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 46 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

El reconocimiento de los ingresos por manejo de los fideicomisos se reconoce con base en lo devengado. Se suspende la acumulación de dichos ingresos, en el momento en que el adeudo por éstos presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, pudiendo volver a acumularse cuando el adeudo pendiente de pago sea liquidado en su totalidad.

En tanto los ingresos devengados por manejo de los fideicomisos se encuentren suspendidos de acumulación y no sean cobrados, el control de estos se lleva en cuentas de orden. En caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

-Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

-Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

-Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

-Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3, el monto de los intereses devengados no cobrados derivados de los créditos que se mantengan en cartera con riesgo de crédito Etapa 3.

-Otras cuentas de registro:

Al 31 de diciembre de 2022, las otras cuentas de registro presentan un saldo de \$1,669,462 que se integran principalmente por guardavalores por el Banco.

(gg)Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados. Los ingresos, utilidades o activos contingentes se reconocen hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 47 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

(3) Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2023

En diciembre de 2022 el CINIF emitió el documento llamado "Mejoras a las NIF 2023", que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes. Las principales mejoras no generaron cambios contables para el Banco.

ANEXO 1

Anexo - Desglose de créditos  
 Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
 Acumulado Actual  
 (Cifras en pesos)  
 Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]  
 Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]  
 Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]  
 Tipo de Crédito / Institución Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]  
 Desglose de créditos [partidas]  
 Bancarios [sinopsis]

TOTAL - - - - - - - - - - - - -  
 Con garantía (bancarios)

TOTAL - - - - - - - - - - - - -  
 Banca comercial  
 Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/05/2023 30/05/2024 5.41744 + 0.66 SPREAD / VARIABLE USD LIBOR 6M 2,190,256,057.40  
 Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 30/05/2023 29/02/2024 5.40389 + 0.56 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,752,317,657.20  
 Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 17/08/2023 17/05/2024 5.37976 + 0.50 SPREAD / VARIABLE USD TSOFR 3M 1,755,598,983.66  
 Scotiabank (Bahamas) Ltd (Caribbean Treasury Unit) (SCTL) Si 17/08/2023 16/02/2024 5.37976 + 0.39 SPREAD / VARIABLE USD TERM SOFR 1,755,359,350.04

TOTAL - - - - - - - - - - - - -  
 Otros bancarios

NACIONAL FINANCIERA S.N.C. No 20/03/2020 20/02/2024 11.509 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIE 28D EOM 2,525,701,270.83  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C. No 20/03/2020 20/03/2024 11.509 + 0.43 SPREAD / VARIABLE MXN TIE 28D EOM 2,525,701,270.83  
 NACIONAL FINANCIERA S.N.C. No 19/11/2019 19/11/2024 11.509 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN TIE 28D EOM 2,525,529,048.61

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 48 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/11/201919/09/202411.509 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN  
TIIE 28D EOM 2,525,529,048.61

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/11/201925/07/202411.509 + 0.35 SPREAD / VARIABLE MXN  
TIIE 28D EOM 2,525,529,048.61

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo14/12/201702/12/20278.48 + 0  
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,027,088,888.89

SOCIEDAD HIPOTECARIA FEDERAL SNC INT. BCA DE DESARROLLONo23/04/201814/04/20258.41 + 0  
SPREAD / FIJA MXN FIXED 1,039,013,055.56

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/12/201828/12/202311.6041  
Tasa Fija 3,203,094.42

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202105/07/20245.33 Tasa  
Fija 3,096,879.00

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/03/202026/03/20256.76 Tasa  
Fija 2,070,896.41

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/01/202105/01/202411.601  
Tasa Fija 560,839.12

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/06/202015/11/202311.6075  
Tasa Fija 153,174.78

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/04/202128/04/202611.6041  
Tasa Fija 1,389,930.63

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa  
Fija 126,128.50

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202021/07/20255.83 Tasa  
Fija 976,365.47

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/09/202109/09/202611.6012  
Tasa Fija 140,627,915.77

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/01/202126/01/202411.6041  
Tasa Fija 1,671,484.77

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202130/04/20245.87 Tasa  
Fija 107,263,459.38

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202021/08/20235.69 Tasa  
Fija 1,659.56

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202128/02/202511.5835  
Tasa Fija 2,021,848.44

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202107/04/202511.601  
Tasa Fija 9,376,277.02

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202008/01/202411.6 Tasa  
Fija 3,094,997.53

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/10/202006/09/202411.5972  
Tasa Fija 226,490.33

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202007/05/202511.601  
Tasa Fija 2,519,335.02

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/10/202114/09/20267.17 Tasa  
Fija 4,431,370.84

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54 Tasa  
Fija 11,410,331.77

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/07/202109/07/20267.04 Tasa  
Fija 2,774,509.95

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/10/202025/09/202411.6055  
Tasa Fija 863,747.74

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/202125/09/202411.6055  
Tasa Fija 1,568,409.91

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26 Tasa  
Fija 10,494,430.62

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202114/09/20266.57 Tasa  
Fija 8,392,084.27

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/07/202129/06/202611.6079	Tasa Fija 82,441,959.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201927/09/202411.609	Tasa Fija 2,625,991.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202115/07/202611.6075	Tasa Fija 243,747,512.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/02/202106/09/202411.5972	Tasa Fija 348,778.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/10/201928/06/202411.609	Tasa Fija 2,322,875.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202026/11/202411.599	Tasa Fija 968,830.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/05/202120/05/202611.6075	Tasa Fija 160,567,477.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202027/03/20255.66	Tasa Fija 3,262,691.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202130/06/202611.609	Tasa Fija 54,073,666.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/201917/10/202411.606	Tasa Fija 2,874,276.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/10/202030/10/202511.6079	Tasa Fija 60,137,984.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/05/202130/04/20266.28	Tasa Fija 6,903,800.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/202004/11/202511.606	Tasa Fija 48,759,502.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4	Tasa Fija 11,275,437.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202120/12/20287.4	Tasa Fija 30,299,355.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38	Tasa Fija 1,079,409.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/12/202107/12/20267.38	Tasa Fija 1,664,152.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/11/201913/10/202311.6075	Tasa Fija 28,542.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.6	Tasa Fija 135,553,810.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/11/202119/11/202512.6079	Tasa Fija 77,357,337.23
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/03/202107/02/202811.6	Tasa Fija 51,815,005.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39	Tasa Fija 35,222,726.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/10/202129/10/20267.39	Tasa Fija 35,222,726.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/04/202029/02/202411.609	Tasa Fija 128,685.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/11/202129/07/202611.5983	Tasa Fija 10,743,760.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202130/04/20266.28	Tasa Fija 6,501,637.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202029/12/202311.5977	Tasa Fija 107,865.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.6045	Tasa Fija 217,100.14

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 50 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/03/202031/05/202411.6045	Tasa Fija 310,124.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/11/201928/06/202411.609	Tasa Fija 24,259,723.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/12/202001/12/202311.607	Tasa Fija 336,557.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202031/05/202411.6012	Tasa Fija 264,855.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/12/202030/11/202311.609	Tasa Fija 1,436,854.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.605	Tasa Fija 123,875.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202006/09/202411.5972	Tasa Fija 143,205.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/201814/12/202311.605	Tasa Fija 449,095.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/03/202110/03/202511.6012	Tasa Fija 16,469,248.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 120,865,339.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 132,684,030.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201820/05/20258.26	Tasa Fija 3,469,144.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/05/202126/05/20266.14	Tasa Fija 149,460,681.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202006/03/20256.07	Tasa Fija 4,274,576.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/01/202225/09/202411.6055	Tasa Fija 2,516,905.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/202030/11/202311.609	Tasa Fija 1,436,854.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202020/06/202511.6065	Tasa Fija 3,510,155.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/12/202028/11/202511.609	Tasa Fija 9,396,848.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/12/202025/09/202411.6055	Tasa Fija 2,097,314.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.609	Tasa Fija 299,624,845.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202129/12/202311.609	Tasa Fija 40,977,331.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.71106	Tasa Fija 5,516,562.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/07/202131/12/202511.609	Tasa Fija 100,997,138.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.71106	Tasa Fija 1,057,568.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201920/11/202311.6075	Tasa Fija 1,045,361.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/06/202031/01/20256.71106	Tasa Fija 514,223.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/11/201931/10/202411.609	Tasa Fija 1,413,995.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20255.90106	Tasa Fija 503,049.54

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 51 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202031/01/20256.23106	Tasa Fija 456,129.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202026/06/202511.599	Tasa Fija 7,011,276.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/11/201926/11/202411.599	Tasa Fija 3,505,638.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/202019/12/202511.6037	Tasa Fija 58,186,948.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5995	Tasa Fija 17,722,812.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.6079	Tasa Fija 19,196,044.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5995	Tasa Fija 18,023,199.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202027/03/202511.5995	Tasa Fija 18,023,199.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/06/202115/05/202511.6075	Tasa Fija 837,632.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/201620/12/20237.54	Tasa Fija 4,134,353.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/10/201720/12/20237.62	Tasa Fija 3,821,241.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/12/201928/06/202411.609	Tasa Fija 13,862,699.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/07/202006/09/202411.5972	Tasa Fija 235,957.14
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202123/04/202611.6055	Tasa Fija 1,320,048.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/12/201928/06/202411.609	Tasa Fija 13,862,699.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/06/202110/06/202511.6012	Tasa Fija 3,188,214.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202129/07/202611.5983	Tasa Fija 10,206,572.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/12/201928/06/202411.609	Tasa Fija 5,513,326.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201917/10/202411.606	Tasa Fija 1,985,447.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/12/201928/06/202411.609	Tasa Fija 3,812,242.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202020/08/20255.77	Tasa Fija 15,357,909.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/08/202025/08/202511.6055	Tasa Fija 5,606,060.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/08/202026/08/202511.609	Tasa Fija 13,450,327.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/12/201929/11/202411.609	Tasa Fija 3,787,487.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/03/202131/03/202611.609	Tasa Fija 5,479,231.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/02/202130/01/202611.606	Tasa Fija 9,750,810.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202006/03/20255.51	Tasa Fija 2,807,702.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/04/202101/04/202611.6019	Tasa Fija 72,939,425.26

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 52 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/201929/01/202411.5983	Tasa Fija 111,673,211.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 1,345,845.42	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 1,731,847.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202019/09/202511.6037	Tasa Fija 4,012,893.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/01/202012/01/202411.6004	Tasa Fija 4,087,669.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/09/202016/04/20255.39 Tasa Fija 703,957.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202019/09/202511.6037	Tasa Fija 4,012,893.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/09/202024/09/202511.6055	Tasa Fija 15,719,653.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/01/202016/01/202511.606	Tasa Fija 19,042,437.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/09/202006/12/202411.5972	Tasa Fija 8,064,428.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/01/202026/01/202411.599	Tasa Fija 584,273.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 1,288,902.81	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/04/202131/03/20266.12 Tasa Fija 10,558,921.99	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/01/201829/12/202311.609	Tasa Fija 5,958,980.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/201829/12/202311.609	Tasa Fija 10,099,966.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/01/202017/10/202411.606	Tasa Fija 1,796,669.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202115/04/202511.6075	Tasa Fija 895,219.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/02/202026/11/202411.599	Tasa Fija 3,985,357.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/03/202006/09/202411.5972	Tasa Fija 288,817.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/02/201919/02/20246.19708	Tasa Fija 4,365,975.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/03/202010/01/20255.98601	Tasa Fija 6,771,426.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/04/202123/04/202611.6055	Tasa Fija 9,121,275.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/06/201931/05/202411.609	Tasa Fija 1,097,875.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/03/202028/06/202411.609	Tasa Fija 7,784,684.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/04/202031/03/202511.5983	Tasa Fija 56,536,349.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/04/202004/04/202511.5972	Tasa Fija 4,788,254.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/04/202014/11/202311.605	Tasa Fija 5,503,537.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.606	Tasa Fija 5,116,202.68

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 53 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/04/202016/04/202511.606	Tasa Fija 4,516,752.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202025/10/202411.5995	Tasa Fija 2,459,415.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8	Tasa Fija 1,039,648.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8	Tasa Fija 3,019,173.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/04/202027/03/20255.8	Tasa Fija 2,440,898.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/12/201829/12/202311.609	Tasa Fija 30,438,773.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/05/202115/04/202511.6075	Tasa Fija 2,188,314.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo28/06/201914/12/202311.605	Tasa Fija 682,484.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/201928/06/202411.609	Tasa Fija 43,631,737.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.609	Tasa Fija 2,779,696.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.609	Tasa Fija 2,339,537.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.609	Tasa Fija 510,609.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/07/201927/06/202411.609	Tasa Fija 9,015,107.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/201928/06/202411.609	Tasa Fija 4,100,102.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/201928/06/202411.609	Tasa Fija 4,643,810.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo27/09/201829/12/202311.609	Tasa Fija 5,554,981.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/201931/07/202411.609	Tasa Fija 370,332.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 150,773.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 3,483,395.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 3,639,368.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 1,039,819.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 1,039,819.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/201915/03/202411.6075	Tasa Fija 1,039,819.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/02/202229/01/20278.07	Tasa Fija 49,867,958.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02	Tasa Fija 64,873,102.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02	Tasa Fija 28,785,048.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/02/202229/01/20278.02	Tasa Fija 11,643,670.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02	Tasa Fija 6,852,655.39

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 54 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/02/202229/01/20278.02 Tasa Fija 58,020,447.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/02/202217/02/202711.606 Tasa Fija 38,223,733.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/02/202220/12/20287.4 Tasa Fija 25,900,725.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/03/202231/08/202512.7345 Tasa Fija 17,747,584.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/04/202217/04/202611.7555 Tasa Fija 9,712,911.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/06/202203/06/202711.776 Tasa Fija 15,132,480.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202206/06/202511.7272 Tasa Fija 42,005,995.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202205/07/202711.7719 Tasa Fija 19,329,620.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.94843 Tasa Fija 7,951,061.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/07/202228/07/20275.94843 Tasa Fija 7,183,854.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202215/02/202411.6575 Tasa Fija 446,747.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202228/08/202611.7579 Tasa Fija 25,008,673.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/09/202215/09/202611.7575 Tasa Fija 4,523,515.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7765 Tasa Fija 5,142,047.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7765 Tasa Fija 102,840,950.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/09/202222/09/202711.7765 Tasa Fija 131,979,219.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/10/202215/10/202711.776 Tasa Fija 136,605,540.66
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/11/202231/10/202311.609 Tasa Fija 2,019,993.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/11/202211/10/202711.7512 Tasa Fija 22,725,734.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/11/202223/10/20265.76972 Tasa Fija 67,040,888.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/12/202230/11/202311.609 Tasa Fija 12,624,957.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 5,722,829.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 54,006,912.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/12/202230/11/20279.38 Tasa Fija 19,737,376.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo20/12/202218/12/202611.7575 Tasa Fija 9,785,027.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/01/202323/01/202511.709 Tasa Fija 10,100,827.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/02/202313/02/202511.709 Tasa Fija 14,141,158.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/02/202314/02/202511.709 Tasa Fija 10,100,827.50

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 55 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/02/202321/05/202411.609	
Tasa Fija 10,099,966.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/02/202315/02/202411.6075	
Tasa Fija 4,020,635.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/02/202318/01/202411.606	
Tasa Fija 3,012,573.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/02/202312/01/202411.6055	
Tasa Fija 9,150,239.37	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/03/202322/05/202411.609	
Tasa Fija 14,139,952.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/03/202324/05/202411.609	
Tasa Fija 11,109,963.03	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/03/202317/05/202411.609	
Tasa Fija 10,099,966.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/03/202315/05/202411.609	
Tasa Fija 10,099,966.39	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/04/202302/10/202311.606	
Tasa Fija 1,765,232.88	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/04/202301/11/202311.607	
Tasa Fija 2,100,118.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202306/10/202311.5972	
Tasa Fija 1,764,093.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202331/03/20286.18106	
Tasa Fija 68,050,735.95	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/04/202305/10/202313.5582 Tasa Fija 2,927,104.45	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537 Tasa Fija 181,706.25	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/04/202305/10/202313.537 Tasa Fija 1,037,464.56	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/04/202305/10/202313.537 Tasa Fija 1,201,611.94	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537 Tasa Fija 21,926.29	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/04/202310/10/202313.537 Tasa Fija 10,252.87	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/04/202311/10/202311.609	
Tasa Fija 15,149,949.58	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/04/202306/10/202313.5294 Tasa Fija 1,082,863.97	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202313/10/202313.0402 Tasa Fija 12,969,845.54	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/04/202310/10/202313.5402 Tasa Fija 2,741.67	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202313/10/202313.5272 Tasa Fija 559,820.87	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202316/10/202313.5272 Tasa Fija 29,832.84	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202310/10/202313.5272 Tasa Fija 2,741.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/04/202310/10/202313.5272 Tasa Fija 5,691.95	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/04/202317/10/202313.5505 Tasa Fija 466,705.15	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202317/10/202313.5399 Tasa Fija 76,528.44	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/04/202317/10/202313.5399 Tasa Fija 10,230.93	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/04/202317/10/202313.5392 Tasa Fija 10,824.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202312/10/202313.5283 Tasa Fija 249,967.87	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/04/202320/10/202313.5283 Tasa Fija 334,026.34	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202323/10/202313.4599 Tasa Fija 71,033.30	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202323/10/202313.4599 Tasa Fija 81,549.64	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202312/10/202313.4599 Tasa Fija 2,397,242.65	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/04/202319/10/202313.4599 Tasa Fija 5,057,053.73	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861 Tasa Fija 135,610.96	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202312/10/202313.4861 Tasa Fija 8,306.31	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202312/10/202313.4861 Tasa Fija 652,090.31	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202323/10/202311.6051	
Tasa Fija 10,760,437.63	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861 Tasa Fija 44,604.16	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/04/202324/10/202313.4861 Tasa Fija 5,107.83	

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 56 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202317/10/202313.4858	Tasa Fija	6,605.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202324/10/202313.4858	Tasa Fija	87,336.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/05/202324/10/202313.4858	Tasa Fija	10,207.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/05/202327/10/202313.4809	Tasa Fija	5,540,951.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/05/202312/01/202411.6055	Tasa Fija	5,942,214.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202331/10/202313.4762	Tasa Fija	429,170.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/05/202331/10/202313.4762	Tasa Fija	126,527.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/05/202331/10/202311.609	Tasa Fija	2,043,669.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/05/202301/11/202311.607	Tasa Fija	2,042,164.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202309/10/202313.454	Tasa Fija	332,187.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/05/202326/10/202313.454	Tasa Fija	8,520,121.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202303/11/202311.606	Tasa Fija	1,738,777.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202310/05/202411.609	Tasa Fija	9,089,969.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/05/202313/05/202411.609	Tasa Fija	9,089,969.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202331/10/202313.4625	Tasa Fija	10,182.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/05/202331/10/202313.4625	Tasa Fija	20,913.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/05/202303/11/202313.4594	Tasa Fija	2,375,974.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/05/202307/11/202313.4599	Tasa Fija	280,599.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/05/202308/11/202311.609	Tasa Fija	100,999,663.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/05/202319/10/202313.4599	Tasa Fija	11,903.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/05/202326/10/202313.4599	Tasa Fija	1,156,676.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/05/202307/11/202313.4599	Tasa Fija	5,978.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202319/10/202313.4607	Tasa Fija	1,414,347.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/05/202326/10/202313.4607	Tasa Fija	1,102,137.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202307/11/202311.601	Tasa Fija	11,085,074.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202308/11/202311.6	Tasa Fija	15,111,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/05/202309/11/202311.6012	Tasa Fija	15,096,676.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202310/11/202311.6012	Tasa Fija	15,096,676.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202302/10/202313.4518	Tasa Fija	1,135,934.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No16/05/202304/10/202313.4518	Tasa Fija	149,848.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/05/202309/11/20235.55743	Tasa Fija	1,544,973.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202331/10/202313.4167	Tasa Fija	211,053.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/05/202304/10/202313.4167	Tasa Fija	45,159.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6004	Tasa Fija	5,029,001.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/12/202311.6004	Tasa Fija	8,046,401.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202310/11/202311.6012	Tasa Fija	6,169,818.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202310/11/202311.6012	Tasa Fija	1,861,923.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6004	Tasa Fija	5,029,001.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6004		

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 57 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 5,023,972.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6004  
Tasa Fija 5,029,001.00  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/05/202313/11/202311.6004  
Tasa Fija 5,029,001.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202319/10/202313.4196 Tasa Fija 142,627.30  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196 Tasa Fija 92,687.38  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196 Tasa Fija 459,705.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/05/202304/10/202313.4196 Tasa Fija 14,987.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202313/11/202311.6004  
Tasa Fija 8,297,851.65  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 5,022,373.29  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 5,027,400.69  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 5,027,400.69  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 5,027,400.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202314/11/202313.4158 Tasa Fija 93,385.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 3,326,340.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 1,706,087.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202304/10/202313.4158 Tasa Fija 59,954.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202304/10/202313.4158 Tasa Fija 43,915.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/05/202303/11/202313.4158 Tasa Fija 750,532.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 7,038,360.97  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.6075  
Tasa Fija 5,025,794.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.6075  
Tasa Fija 5,020,768.65  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.6075  
Tasa Fija 5,025,794.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202315/11/202311.6075  
Tasa Fija 5,025,794.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202309/11/20235.51933  
Tasa Fija 35,364,748.88  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/05/202318/10/202311.606  
Tasa Fija 5,020,955.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057 Tasa Fija 4,116.42  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057 Tasa Fija 84,089.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202304/10/202313.4057 Tasa Fija 64,036.54  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202314/11/202311.605  
Tasa Fija 15,082,202.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202313/10/202313.4057 Tasa Fija 41,905.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No22/05/202315/11/202313.4057 Tasa Fija 20,020,957.70  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.606  
Tasa Fija 5,020,955.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.606  
Tasa Fija 5,020,955.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.606  
Tasa Fija 5,020,955.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.606  
Tasa Fija 5,015,934.32  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/11/202313.4138 Tasa Fija 1,066,220.99  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202315/11/202311.6075

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 58 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Tasa Fija 15,077,383.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/05/202316/11/202311.606  
Tasa Fija 9,037,719.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202310/11/202313.4138 Tasa Fija 1,332,817.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202314/11/202313.4138 Tasa Fija 34,776.81  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/05/202302/10/202313.4138 Tasa Fija 785,013.17  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/05/202317/11/202311.606  
Tasa Fija 4,595,178.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202302/10/202313.4423 Tasa Fija 335,508.90  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202320/10/202311.6075  
Tasa Fija 3,512,413.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202320/12/202311.6075  
Tasa Fija 3,010,640.21  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202317/11/202313.4423 Tasa Fija 1,866,648.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202320/10/20235.50484  
Tasa Fija 8,728,592.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/05/202304/10/202313.4423 Tasa Fija 7,495.94  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202316/11/202311.609  
Tasa Fija 38,077,346.16  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/05/202320/10/20235.50484  
Tasa Fija 8,728,592.92  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202320/10/202311.6075  
Tasa Fija 3,512,413.58  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202320/10/20235.50484  
Tasa Fija 8,728,592.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/05/202317/10/202313.4254 Tasa Fija 116,556.85  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202321/12/202311.6037  
Tasa Fija 2,508,058.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202321/12/202311.6037  
Tasa Fija 3,009,669.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/05/202321/11/202311.6037  
Tasa Fija 1,805,801.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202321/11/202313.4151 Tasa Fija 283,511.30  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202323/10/202311.6055  
Tasa Fija 5,009,671.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202303/10/202313.4151 Tasa Fija 199,648.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202304/10/202313.4151 Tasa Fija 118,693.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202316/11/202313.4151 Tasa Fija 3,629,206.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/05/202309/11/202313.4151 Tasa Fija 1,682,634.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202321/11/202311.6037  
Tasa Fija 3,089,927.61  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/05/202321/11/202311.6037  
Tasa Fija 3,852,377.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo29/05/202314/05/202711.7575  
Tasa Fija 1,105,748.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202324/11/202313.4057 Tasa Fija 1,055,117.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/05/202306/11/202313.4057 Tasa Fija 1,188,995.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo30/05/202326/12/202311.599  
Tasa Fija 5,008,054.86  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/05/202314/12/202311.605  
Tasa Fija 7,038,360.97  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/202323/10/202311.6055  
Tasa Fija 5,009,671.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/05/202317/10/202313.4057 Tasa Fija 233,235.04  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/05/202327/11/202311.5995  
Tasa Fija 12,516,110.42

---



**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 59 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202321/11/202313.3878	Tasa Fija	122,990.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/06/202304/10/202313.3878	Tasa Fija	19,383.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/06/202331/05/20285.85106	Tasa Fija	15,782,704.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	338,536.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202316/11/202313.3822	Tasa Fija	1,926,003.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202323/11/202313.3822	Tasa Fija	1,428,572.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	13,177.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	1,673.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	23,652.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202324/10/202313.3822	Tasa Fija	58,653.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202309/11/202313.3822	Tasa Fija	224,126.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202328/11/202313.3822	Tasa Fija	315,191.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No02/06/202304/10/202313.3822	Tasa Fija	28,383.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/06/202325/05/20275.82972	Tasa Fija	61,846,540.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202328/11/202313.4059	Tasa Fija	88,106.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202304/10/202313.4059	Tasa Fija	46,712.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/06/202304/10/202313.4059	Tasa Fija	386,269.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	1,347,629.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	103,336.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/06/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	149,797.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202303/10/202312.76	Tasa Fija	187,376.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	15,666.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	36,703.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/06/202303/01/202411.606	Tasa Fija	4,034,818.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/06/202306/10/202312.76	Tasa Fija	61,765.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	19,852.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	19,152.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202327/12/202311.5995	Tasa Fija	3,003,866.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202304/01/202411.606	Tasa Fija	3,026,113.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202331/05/202411.609	Tasa Fija	37,873,530.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/06/202301/11/202311.607	Tasa Fija	10,096,725.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202306/10/202312.758	Tasa Fija	137,761.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	70,493.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	4,033.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	851,313.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202306/11/202313.3926	Tasa Fija	73,241.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202306/12/202311.5972	Tasa Fija	40,322,144.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202330/03/20285.82187	Tasa Fija	113,299,669.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202302/10/202312.758	Tasa Fija	236,438.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	392,999.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202302/10/202312.758	Tasa Fija	650,876.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202304/10/202312.758	Tasa Fija	40,013.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202301/12/202313.3926	Tasa Fija	1,612,528.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202305/12/202313.3926	Tasa Fija	55,087.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/06/202323/11/202313.3926	Tasa Fija	2,911,783.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/06/202323/10/202311.6055	Tasa Fija	14,027,079.50

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 60 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202306/10/202312.7652	Tasa Fija	11,686.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202302/10/202312.7652	Tasa Fija	1,451,115.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202324/11/202313.3717	Tasa Fija	51,325.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202323/11/202313.3717	Tasa Fija	18,699.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	6,263.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	73,407.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202304/10/202312.7652	Tasa Fija	44,296.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202301/12/202313.3717	Tasa Fija	1,114,348.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/06/202306/11/202313.3717	Tasa Fija	42,550.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/06/202306/12/202311.5972		Tasa Fija	2,201,417.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202302/10/202312.7726	Tasa Fija	89,132.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202302/10/202312.7726	Tasa Fija	14,662.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	182,869.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202330/10/202313.3731	Tasa Fija	2,590,866.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/11/202313.3731	Tasa Fija	549,329.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/10/202312.7726	Tasa Fija	435,961.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	12,773.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202306/11/202313.3731	Tasa Fija	5,694.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202303/10/202312.7726	Tasa Fija	424,897.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/06/202315/06/202711.7575		Tasa Fija	6,800,350.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/06/202304/10/202312.7726	Tasa Fija	1,326.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202304/10/202312.7663	Tasa Fija	38,990.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202311/10/202312.7663	Tasa Fija	1,557,980.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202304/10/202312.7663	Tasa Fija	148,193.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	615,779.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	4,964.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/06/202305/12/202313.3671	Tasa Fija	5,922.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	3,885.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	95,892.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202311/10/202312.7606	Tasa Fija	148,747.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	319,672.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	326,828.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202308/12/202313.384	Tasa Fija	363,443.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202306/11/202313.384	Tasa Fija	25,060.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202306/11/202313.384	Tasa Fija	5,125.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	186,240.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202309/11/202311.6012		Tasa Fija	10,064,451.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/06/202315/06/202811.7775		Tasa Fija	34,822,200.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/06/202313/10/202311.6004		Tasa Fija	1,005,800.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202306/10/202312.7553	Tasa Fija	507,754.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202310/10/202312.7553	Tasa Fija	90,087.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija	2,083,161.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija	239,019.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija	172,906.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija	50,806.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija	4,328.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202306/10/202312.7553	Tasa Fija	781,300.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija	38,328.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202302/10/202312.7553	Tasa Fija	201,928.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija	85,538.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202311/12/202313.3781	Tasa Fija	124,045.99

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 61 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202330/11/202313.3781	Tasa Fija	2,657,731.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202306/11/202313.3781	Tasa Fija	18,317.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202309/10/202312.7553	Tasa Fija	1,074,606.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija	42,750.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202304/10/202312.7553	Tasa Fija	57,731.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202311/12/202313.3781	Tasa Fija	100,516.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/06/202319/10/202313.3781	Tasa Fija	387,012.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/06/202310/11/202311.6012		Tasa Fija	10,064,451.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202313/10/202312.7646	Tasa Fija	187,555.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202302/10/202312.7646	Tasa Fija	73,368.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija	432,003.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202309/10/202312.7646	Tasa Fija	170,885.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija	159,287.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija	76,002.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija	14,299.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202304/10/202312.7646	Tasa Fija	646,889.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202313/11/202313.36	Tasa Fija	497,072.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No19/06/202306/11/202313.36	Tasa Fija	24,673.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/06/202315/01/202411.6075		Tasa Fija	2,045,498.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	1,173,854.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	373,297.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202313/10/202312.76	Tasa Fija	508,600.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	98,487.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202304/10/202312.76	Tasa Fija	102,011.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202309/10/202312.76	Tasa Fija	50,916.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202311/12/202313.3618	Tasa Fija	75,819.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No20/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	54,692.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202309/10/20236.68937	Tasa Fija	205,778.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612	Tasa Fija	303,903.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612	Tasa Fija	461,326.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	156,108.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	30,454.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202304/10/202312.7612	Tasa Fija	166,947.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	22,220.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202305/10/20235.53106		Tasa Fija	52,532,719.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202312/10/20235.55106		Tasa Fija	52,533,620.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202319/10/20235.55106		Tasa Fija	52,533,620.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202320/06/202511.7037		Tasa Fija	19,061,769.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202317/10/202312.7606	Tasa Fija	169,005.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	184,605.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202317/10/202312.7606	Tasa Fija	29,818.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202319/10/202312.7606	Tasa Fija	115,350.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	97,686.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202323/11/202313.3618	Tasa Fija	251,799.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202306/10/202312.7606	Tasa Fija	12,841.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202304/10/202312.7606	Tasa Fija	26,460.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202323/11/202313.3618	Tasa Fija	5,385.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202306/11/202313.3618	Tasa Fija	39,314.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/06/202315/12/202313.3618	Tasa Fija	1,452,482.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202318/12/202311.606			

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 62 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 5,020,955.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202319/12/202311.6055  
Tasa Fija 5,019,342.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202315/12/202311.6075  
Tasa Fija 5,025,794.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202324/11/202311.6055  
Tasa Fija 4,679,032.95  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202314/12/202311.605  
Tasa Fija 3,519,180.49  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202327/11/202311.5995  
Tasa Fija 4,005,155.33  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202313/12/202311.6004  
Tasa Fija 2,514,500.50  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202328/11/202311.6041  
Tasa Fija 2,502,417.52  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202311/12/202311.6012  
Tasa Fija 2,012,890.22  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202304/12/202311.606  
Tasa Fija 2,824,372.60  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202305/12/202311.6019  
Tasa Fija 3,529,327.03  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202308/12/202311.6 Tasa  
Fija 3,525,938.89  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/06/202311/12/202311.6012  
Tasa Fija 5,032,225.56  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/10/202312.7537 Tasa Fija 484,303.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344 Tasa Fija 399,917.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202323/11/202313.3344 Tasa Fija 3,041,179.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/10/202312.7537 Tasa Fija 485,289.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202313/11/202313.3344 Tasa Fija 207,408.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344 Tasa Fija 57,581.76  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/12/202313.3344 Tasa Fija 20,188.15  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202320/10/202311.6075  
Tasa Fija 5,017,733.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/06/202314/12/202311.605  
Tasa Fija 5,027,400.69  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202319/10/202312.7537 Tasa Fija 139,897.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537 Tasa Fija 427,224.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202304/10/202312.7537 Tasa Fija 1,575,951.35  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537 Tasa Fija 449,696.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202313/10/202312.7537 Tasa Fija 1,077,944.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202316/10/202312.7537 Tasa Fija 129,268.77  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No23/06/202315/12/202313.3344 Tasa Fija 492,337.77  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202324/10/202311.6055  
Tasa Fija 5,009,671.25  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202320/10/202312.755 Tasa Fija 356,079.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 451,304.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 440,127.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 29,730.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202304/10/202312.755 Tasa Fija 239,062.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202313/11/202313.3222 Tasa Fija 280,727.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202306/11/202313.3222 Tasa Fija 69,593.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 2,330,049.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/06/202316/10/202312.755 Tasa Fija 45,466.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/06/202318/12/202311.606  
Tasa Fija 5,020,955.28

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 63 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202320/12/202311.6075	
Tasa Fija 12,544,334.20	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202325/10/202311.6055	
Tasa Fija 5,009,671.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202319/12/202311.6055	
Tasa Fija 5,019,342.50	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525	Tasa Fija 44,493.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202324/11/202313.3005	Tasa Fija 1,240,276.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202322/12/202313.3005	Tasa Fija 631,635.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525	Tasa Fija 128,618.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202304/10/202312.7525	Tasa Fija 317,616.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/06/202306/11/202313.3005	Tasa Fija 279,161.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202321/12/202311.6037	
Tasa Fija 12,540,290.63	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202316/10/20236.72042	Tasa Fija 329,884.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202326/10/202311.599	
Tasa Fija 5,008,054.86	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202316/10/202312.7487	Tasa Fija 99,506.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487	Tasa Fija 253,222.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487	Tasa Fija 20,207.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487	Tasa Fija 52,806.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487	Tasa Fija 256,760.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/06/202304/10/202312.7487	Tasa Fija 1,048,851.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/06/202322/12/202311.6065	
Tasa Fija 15,043,524.38	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202321/12/202311.6037	
Tasa Fija 5,016,116.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202327/10/202311.5995	
Tasa Fija 5,006,444.17	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202313/10/202312.7506	Tasa Fija 21,379.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202324/10/202312.7506	Tasa Fija 444,153.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija 22,231.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija 11,993.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija 34,802.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202326/12/202311.599	
Tasa Fija 12,520,137.15	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija 48,289.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija 48,791.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202322/12/202313.2962	Tasa Fija 1,756,419.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202304/10/202312.7506	Tasa Fija 352,945.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/06/202306/11/202313.2962	Tasa Fija 332,655.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/06/202328/06/202411.609	
Tasa Fija 50,499,831.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202322/12/202311.6065	
Tasa Fija 5,014,508.13	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/06/202327/10/202311.5995	
Tasa Fija 1,001,288.83	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202323/11/202313.2925	Tasa Fija 17,997.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202310/11/202313.2925	Tasa Fija 171,820.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202306/11/202313.2925	Tasa Fija 56,433.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202323/10/202312.7477	Tasa Fija 1,537,926.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202327/10/202312.7477	Tasa Fija 86,363.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija 1,795,834.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija 31,641.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202304/10/202312.7477	Tasa Fija 365,938.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/06/202326/12/202313.2925	Tasa Fija 366,840.91

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 64 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No30/06/202306/11/202313.2925	Tasa Fija	3,990.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202323/10/202312.7576	Tasa Fija	138,297.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202304/10/202312.7576	Tasa Fija	723,614.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202301/11/202313.3368	Tasa Fija	29,388.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202330/11/202313.3368	Tasa Fija	1,001,789.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202307/12/202313.3368	Tasa Fija	2,163,082.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202306/11/202313.3368	Tasa Fija	19,642.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202306/11/202313.3368	Tasa Fija	62,862.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202323/10/202312.7576	Tasa Fija	155,083.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202323/10/202312.7576	Tasa Fija	186,378.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202304/10/202312.7576	Tasa Fija	161,539.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202304/10/202312.7576	Tasa Fija	105,907.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202322/12/202313.3368	Tasa Fija	622,368.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202304/10/202312.7576	Tasa Fija	18,849.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202323/10/202312.7576	Tasa Fija	44,717.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202326/12/202313.3368	Tasa Fija	112,966.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202306/11/202313.3368	Tasa Fija	17,102.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/07/202320/10/202312.7576	Tasa Fija	190,224.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/07/202331/10/202311.609		Tasa Fija	30,299,899.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202327/10/202312.7575	Tasa Fija	124,381.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202304/10/202312.7575	Tasa Fija	1,532,107.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202323/10/202312.7575	Tasa Fija	184,811.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202306/11/202313.327	Tasa Fija	43,558.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202326/12/202313.327	Tasa Fija	326,404.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202306/11/202313.327	Tasa Fija	15,393.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202313/10/202312.7575	Tasa Fija	318,378.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202326/10/202312.7575	Tasa Fija	162,288.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202304/10/202312.7575	Tasa Fija	359,459.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202304/10/202312.7575	Tasa Fija	183,784.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202304/10/202312.7575	Tasa Fija	105,914.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202313/10/202312.7575	Tasa Fija	1,066,817.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202306/11/202313.327	Tasa Fija	44,242.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202306/11/202313.327	Tasa Fija	10,262.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/07/202323/10/202312.7575	Tasa Fija	100,951.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/07/202315/03/202411.6075		Tasa Fija	3,015,476.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202303/10/202312.7537	Tasa Fija	10,722.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202302/10/202312.7537	Tasa Fija	464,028.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202304/10/202312.7537	Tasa Fija	144,685.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202313/11/202312.8453	Tasa Fija	15,118,188.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202325/10/202312.7537	Tasa Fija	48,631.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202304/12/202313.3453	Tasa Fija	1,788,191.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202304/10/202312.7537	Tasa Fija	105,919.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	639,610.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	160,782.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202323/10/202311.6055		Tasa Fija	13,025,145.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202331/01/20245.55106		Tasa Fija	26,266,810.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/07/202330/11/202311.609		Tasa Fija	30,299,899.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/07/202323/10/20236.78087	Tasa Fija	17,846.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/07/202327/10/202312.7585	Tasa Fija	681,661.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/07/202331/10/202312.7585	Tasa Fija	32,347.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/07/202311/12/202313.3453	Tasa Fija	1,253,686.51

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 65 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202312/10/202312.7585	Tasa Fija	25,612.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202303/11/202311.606		
Tasa Fija		605,222.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202304/10/202312.7585	Tasa Fija	80,184.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	36,248.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	30,537.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	9,692.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202325/10/202312.7585	Tasa Fija	1,028,447.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202304/10/202312.7585	Tasa Fija	53,831.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202306/11/202313.3453	Tasa Fija	110,021.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No06/07/202302/10/20236.46874	Tasa Fija	85,086.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/07/202306/07/202810.1	Tasa Fija	9,089,656.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202329/12/202313.3294	Tasa Fija	1,523,471.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294	Tasa Fija	233,220.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202306/11/202313.3294	Tasa Fija	1,975,137.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294	Tasa Fija	3,649.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202306/11/202313.3294	Tasa Fija	12,430.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202303/11/202311.606		
Tasa Fija		1,008,704.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202303/11/202311.606		
Tasa Fija		1,008,704.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202320/10/202312.76	Tasa Fija	86,138.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	409,724.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202306/11/202313.3294	Tasa Fija	436,602.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/07/202305/10/202311.6019		
Tasa Fija		453,770.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202330/10/202312.76	Tasa Fija	2,485,491.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	73,336.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202330/10/202312.76	Tasa Fija	1,501,480.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	132,414.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294	Tasa Fija	83,752.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202307/12/202313.3294	Tasa Fija	43,525.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202314/12/202313.3294	Tasa Fija	3,266,011.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202301/11/202312.76	Tasa Fija	76,106.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202305/10/202312.76	Tasa Fija	104,676.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/10/202312.76	Tasa Fija	172,131.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	151,675.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	6,243.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202304/10/202312.76	Tasa Fija	131,268.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294	Tasa Fija	29,119.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/07/202302/01/202413.3294	Tasa Fija	20,920.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202327/10/202312.7525	Tasa Fija	240,725.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202302/10/202312.7525	Tasa Fija	45,520.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202301/11/202312.7525	Tasa Fija	142,346.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202330/10/202312.7525	Tasa Fija	3,314,265.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202306/11/202312.7525	Tasa Fija	604,141.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202329/12/202313.3403	Tasa Fija	1,304,107.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202303/11/202312.7525	Tasa Fija	62,428.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202302/10/202312.7525	Tasa Fija	244,584.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202304/10/202312.7525	Tasa Fija	63,670.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202304/10/202312.7525	Tasa Fija	79,460.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202304/10/202312.7525	Tasa Fija	461.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202330/10/202312.7525	Tasa Fija	9,281.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202302/01/202413.3403	Tasa Fija	29,870.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/07/202303/11/202312.7525	Tasa Fija	638,208.45

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 66 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/07/202307/12/202311.609  
Tasa Fija 20,199,932.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202301/11/202312.745 Tasa Fija 34,391.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202306/11/202312.745 Tasa Fija 412,786.83  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202301/11/202312.745 Tasa Fija 788,833.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202306/11/202312.745 Tasa Fija 727,676.37  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202306/11/202312.745 Tasa Fija 38,162.09  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202304/10/202312.745 Tasa Fija 9,569.13  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/202309/10/202311.6012  
Tasa Fija 402,578.04  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202302/10/202312.745 Tasa Fija 194,768.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202306/11/202312.745 Tasa Fija 170,295.72  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202306/11/202312.745 Tasa Fija 894,010.36  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/07/202307/11/202311.609  
Tasa Fija 8,079,973.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202309/10/202312.745 Tasa Fija 205,312.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202323/10/202312.745 Tasa Fija 35,282.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/07/202304/10/202312.745 Tasa Fija 77,281.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202327/10/202312.7437 Tasa Fija 74,291.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202302/10/202312.7437 Tasa Fija 118,996.92  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202301/11/202312.7437 Tasa Fija 315,713.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202306/11/202312.7437 Tasa Fija 41,229.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202307/11/202312.7437 Tasa Fija 324,236.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202318/12/202313.33 Tasa Fija 580,040.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202330/10/202312.7437 Tasa Fija 196,118.87  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202306/11/202312.7437 Tasa Fija 1,226,593.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202306/11/202312.7437 Tasa Fija 125,953.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202304/12/202313.33 Tasa Fija 112,775.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202301/11/202312.7437 Tasa Fija 33,853.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/07/202302/01/202413.33 Tasa Fija 36,089.24  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202303/11/202312.74 Tasa Fija 60,723.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202330/10/202312.74 Tasa Fija 56,142.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202306/11/202312.74 Tasa Fija 221,412.13  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202319/12/202313.3366 Tasa Fija 242,892.55  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202327/10/202312.74 Tasa Fija 230,960.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202306/11/202312.74 Tasa Fija 28,488.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202305/01/202413.3366 Tasa Fija 946,571.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202311/10/202312.74 Tasa Fija 208,747.20  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202304/10/202312.74 Tasa Fija 256,154.26  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202328/12/202313.3366 Tasa Fija 10,711.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202304/12/202313.3366 Tasa Fija 156,818.96  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/07/202309/11/202311.6012  
Tasa Fija 1,006,445.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202327/10/202312.74 Tasa Fija 976,286.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No13/07/202304/10/202312.74 Tasa Fija 194,113.72  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202312/10/202311.6055  
Tasa Fija 452,756.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202303/11/202312.7375 Tasa Fija 303,646.51  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202301/11/202312.7375 Tasa Fija 7,525.33  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202310/11/202312.7375 Tasa Fija 88,444.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202306/11/202312.7375 Tasa Fija 263,479.70  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202306/11/202312.7375 Tasa Fija 113,609.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202303/11/202312.7375 Tasa Fija 222,627.36  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202323/10/202312.7375 Tasa Fija 478,008.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202304/01/202413.3115 Tasa Fija 737,994.37  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202309/11/202311.6012

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 67 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Tasa Fija 1,006,445.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202309/11/202311.6012  
Tasa Fija 1,006,445.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/07/202320/12/202311.6075  
Tasa Fija 2,007,093.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202306/11/202312.7375 Tasa Fija 3,764,231.71  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202310/11/202312.7375 Tasa Fija 4,111,807.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202301/11/202312.7375 Tasa Fija 6,142,713.44  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202307/12/202313.3115 Tasa Fija 2,893,739.98  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202304/12/202313.3115 Tasa Fija 49,628.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/07/202309/01/202413.3115 Tasa Fija 13,094.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202312/10/202312.7349 Tasa Fija 137,467.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202323/10/202312.7349 Tasa Fija 1,926,671.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 537,247.45  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202309/10/202312.7349 Tasa Fija 205,622.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 826,390.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202310/11/202312.7349 Tasa Fija 180,729.03  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202330/10/202312.7349 Tasa Fija 1,269,081.49  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 421,506.74  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202301/11/202312.7349 Tasa Fija 1,026,576.78  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 38,521.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202304/12/202313.3057 Tasa Fija 15,624.28  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202314/11/202311.609  
Tasa Fija 4,544,984.88  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202313/10/202312.7349 Tasa Fija 205,479.39  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 20,182.57  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 46,461.94  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202306/11/202312.7349 Tasa Fija 57,782.73  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/07/202312/01/202413.3057 Tasa Fija 1,521,781.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202306/07/202810.24 Tasa Fija 6,604,500.38  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202312/01/20245.46946  
Tasa Fija 87,390,602.40  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/07/202322/06/20275.61972  
Tasa Fija 43,304,149.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 57,235.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 1,486,743.15  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 93,930.66  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202304/12/202313.3147 Tasa Fija 15,494.18  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202310/11/202312.7424 Tasa Fija 242,241.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202309/10/202312.7424 Tasa Fija 878,322.68  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 84,184.65  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 225,669.53  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 96,307.30  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202304/12/202313.3147 Tasa Fija 54,420.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202304/12/202313.3147 Tasa Fija 11,281.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202316/10/202312.7424 Tasa Fija 204,816.50  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 64,986.67  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202302/01/202413.3147 Tasa Fija 11,385.47  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202309/10/202312.7424 Tasa Fija 29,661.00  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 20,472.37  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/07/202323/10/202311.6055  
Tasa Fija 7,013,539.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/07/202306/11/20236.79635 Tasa Fija 22,023.29  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/07/202306/11/202312.7424 Tasa Fija 236,863.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/07/202310/11/202312.7424 Tasa Fija 309,767.89

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 68 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/07/202308/11/202312.7424	Tasa Fija	561,511.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202317/10/202311.606	Tasa Fija	301,257.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202317/10/202311.606	Tasa Fija	200,838.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202316/06/202811.759	Tasa Fija	125,059,380.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202307/11/202312.7462	Tasa Fija	79,677.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202304/10/202312.7462	Tasa Fija	17,897.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202304/12/202313.3142	Tasa Fija	398,865.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202309/01/202413.3142	Tasa Fija	4,858.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	115,582.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/07/202317/11/202311.606	Tasa Fija	1,004,191.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	308,300.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	74,593.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202304/10/202312.7462	Tasa Fija	246,833.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	12,648.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202308/11/202312.7462	Tasa Fija	103,479.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	26,620.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	208,979.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202306/11/202312.7462	Tasa Fija	613,370.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202316/01/202413.3142	Tasa Fija	10,402,922.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/07/202316/01/202411.606	Tasa Fija	2,008,382.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/07/202315/02/202411.6075	Tasa Fija	2,045,498.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/07/202310/11/202312.7462	Tasa Fija	268,469.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202318/10/202312.7504	Tasa Fija	20,657.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202306/11/202312.7504	Tasa Fija	78,765.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202304/10/202312.7504	Tasa Fija	73,220.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201	Tasa Fija	501,234.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202304/12/202313.3201	Tasa Fija	440,080.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201	Tasa Fija	12,268.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202304/12/202313.3201	Tasa Fija	395,081.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202306/10/202312.7504	Tasa Fija	36,587.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202315/11/202312.7504	Tasa Fija	418,225.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202323/10/202312.7504	Tasa Fija	8,622.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202306/11/202312.7504	Tasa Fija	252,520.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202306/11/202312.7504	Tasa Fija	59,721.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/01/202413.3201	Tasa Fija	283,541.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202304/12/202313.3201	Tasa Fija	19,131.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202317/01/202411.606	Tasa Fija	2,008,382.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202313/11/202312.7504	Tasa Fija	377,707.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202309/01/202413.3201	Tasa Fija	213,524.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202311/01/202413.3201	Tasa Fija	2,061,597.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202319/10/202311.6055	Tasa Fija	401,547.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202313/10/202312.7504	Tasa Fija	425,733.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202313/11/202312.7504	Tasa Fija	51,472.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/07/202316/10/202312.7504	Tasa Fija	33,211.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202308/01/20245.53352	Tasa Fija	18,067,144.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/07/202318/01/202411.606	Tasa Fija	2,008,382.11

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 69 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202313/11/202312.7551	Tasa Fija	6,544,540.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202314/11/202312.7551	Tasa Fija	42,703.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202306/11/202312.7551	Tasa Fija	321,573.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202313/11/202312.7551	Tasa Fija	306,664.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202309/01/202413.3144	Tasa Fija	66,014.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202311/01/202413.3144	Tasa Fija	1,899,643.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202313/10/202312.7551	Tasa Fija	325,644.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202306/11/202312.7551	Tasa Fija	115,605.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202322/12/202313.3144	Tasa Fija	514,135.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202304/12/202313.3144	Tasa Fija	11,284.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202313/11/202312.7551	Tasa Fija	130,579.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202306/11/202312.7551	Tasa Fija	161,261.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202306/11/202312.7551	Tasa Fija	632,699.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202319/01/202413.3144	Tasa Fija	1,025,518.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/07/202306/11/202312.7551	Tasa Fija	23,283.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/202319/01/202411.6055		Tasa Fija	2,007,737.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202310/11/202312.7575	Tasa Fija	60,855.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202313/11/202312.7575	Tasa Fija	8,846.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202321/11/202312.7575	Tasa Fija	144,905.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	1,267,317.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	12,111.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202308/01/202413.3084	Tasa Fija	1,250,926.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202309/01/202413.3084	Tasa Fija	400,941.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202304/12/202313.3084	Tasa Fija	5,529.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202316/01/202413.3084	Tasa Fija	15,688.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202304/12/202313.3084	Tasa Fija	18,045.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202316/10/202312.7575	Tasa Fija	261,862.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	41,219.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	164,621.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202304/10/202312.7575	Tasa Fija	4,971.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	9,359.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/07/202306/11/202312.7575	Tasa Fija	599,027.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo25/07/202323/10/202311.6055		Tasa Fija	6,011,605.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202313/11/202312.7587	Tasa Fija	21,849.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202313/11/202312.7587	Tasa Fija	34,252.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202304/10/202312.7587	Tasa Fija	35,643.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202315/11/202312.7587	Tasa Fija	796,926.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202306/11/202312.7587	Tasa Fija	48,778.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202323/11/202311.609		Tasa Fija	2,524,991.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202304/10/202312.7587	Tasa Fija	19,045.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202315/11/202312.7587	Tasa Fija	790,651.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202307/11/202312.7587	Tasa Fija	135,522.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202306/11/202312.7587	Tasa Fija	38,539.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202304/12/202313.3054	Tasa Fija	101,572.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202316/01/202413.3054	Tasa Fija	272,215.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202313/11/202312.7587	Tasa Fija	36,045.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202306/11/202312.7587	Tasa Fija	65,014.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/07/202304/12/202313.3054	Tasa Fija	33,857.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202322/01/202411.6065		Tasa Fija	5,014,508.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo26/07/202329/06/202811.759		Tasa Fija	157,772,030.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No27/07/202317/11/202312.756	Tasa Fija	255,385.94

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 70 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	202,840.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202304/12/202313.3194 Tasa Fija	153,104.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/07/202323/01/202411.6055 Tasa Fija	5,009,671.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202303/11/202312.756 Tasa Fija	1,109,811.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202321/11/202312.756 Tasa Fija	66,086.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	37,501.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	100,410.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	926,266.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	1,203,100.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202304/10/202312.756 Tasa Fija	4,278.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202304/12/202313.3194 Tasa Fija	874,157.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	70,256.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	247,278.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	125,143.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/07/202324/11/202311.6055 Tasa Fija	1,001,934.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202313/10/202312.756 Tasa Fija	68,470.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	38,541.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202327/10/202312.7585 Tasa Fija	89,793.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202313/11/202312.7585 Tasa Fija	341,973.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202321/11/202312.7585 Tasa Fija	106,834.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija	361,600.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija	7,973.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202324/11/202311.6055 Tasa Fija	1,001,934.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202324/11/202311.6055 Tasa Fija	400,773.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202326/10/202311.599 Tasa Fija	400,644.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202324/01/202411.6055 Tasa Fija	5,009,671.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202317/11/202312.7585 Tasa Fija	138,545.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202304/10/202312.7585 Tasa Fija	30,921.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202306/11/202312.7585 Tasa Fija	38,951.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202304/12/202313.314 Tasa Fija	33,521.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202321/11/202312.7585 Tasa Fija	265,397.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202306/11/202312.7585 Tasa Fija	86,966.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202323/01/202413.314 Tasa Fija	52,942.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202318/01/202413.314 Tasa Fija	7,937,465.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202304/12/202313.314 Tasa Fija	28,310.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/07/202304/12/202313.314 Tasa Fija	3,611.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202313/11/20236.85283 Tasa Fija	55,272.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/07/202325/01/202411.6055 Tasa Fija	5,009,671.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202327/10/202312.756 Tasa Fija	388,326.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202323/10/202312.756 Tasa Fija	93,031.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202321/11/202312.756 Tasa Fija	5,470,683.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	1,233,595.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202323/10/202312.756 Tasa Fija	14,146.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	312,625.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202304/12/202313.3305 Tasa Fija	1,487,596.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202304/12/202313.3305 Tasa Fija	121,424.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202323/10/202312.756 Tasa Fija	5,755.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756 Tasa Fija	41,419.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/07/202321/11/202312.756 Tasa Fija	823,178.25

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 71 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756	Tasa Fija	71,508.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756	Tasa Fija	38,549.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202319/01/202413.3305	Tasa Fija	1,171,658.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202304/12/202313.3305	Tasa Fija	237,381.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202321/11/202312.756	Tasa Fija	102,228.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202306/11/202312.756	Tasa Fija	179,711.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202324/01/202413.3305	Tasa Fija	8,489,625.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202321/11/202312.756	Tasa Fija	229,718.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No31/07/202304/12/202313.3305	Tasa Fija	50,794.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202330/10/20236.57191	Tasa Fija	71,377.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202313/11/20236.848	Tasa Fija	59,463.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202324/11/202312.758	Tasa Fija	107,202.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202313/11/202312.758	Tasa Fija	66,665.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202304/10/202312.758	Tasa Fija	341,433.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202306/11/202312.758	Tasa Fija	99,465.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202311/10/202312.758	Tasa Fija	70,298.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202306/11/202312.758	Tasa Fija	65,035.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202304/12/202313.308	Tasa Fija	187,271.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202306/11/202312.758	Tasa Fija	14,260.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202306/11/202312.758	Tasa Fija	84,877.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202304/10/202312.758	Tasa Fija	751,689.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No01/08/202323/10/202312.758	Tasa Fija	168,533.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202326/01/202411.599		Tasa Fija	5,008,054.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202326/01/202411.599		Tasa Fija	2,003,221.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202327/02/202411.6041		Tasa Fija	1,151,112.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202321/11/20236.83313	Tasa Fija	571,288.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202321/11/202312.7555	Tasa Fija	112,562.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202304/10/202312.7555	Tasa Fija	524,794.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202322/11/202312.7555	Tasa Fija	1,350,736.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo02/08/202329/01/202411.5983		Tasa Fija	9,005,799.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202317/11/202312.7555	Tasa Fija	195,747.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202323/10/202312.7555	Tasa Fija	34,326.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202322/11/202312.7555	Tasa Fija	775,609.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202306/11/202312.7555	Tasa Fija	169,410.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202306/11/202312.7555	Tasa Fija	812,432.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202309/01/202413.3105	Tasa Fija	204,436.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202304/12/202313.3105	Tasa Fija	234,848.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202304/12/202313.3105	Tasa Fija	24,155.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No02/08/202304/12/202313.3105	Tasa Fija	115,670.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202323/10/202312.7552	Tasa Fija	161,205.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/10/202312.7552	Tasa Fija	195,075.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/10/202312.7552	Tasa Fija	285,067.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/10/202312.7552	Tasa Fija	128,379.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/12/202313.3053	Tasa Fija	35,761.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/08/202330/01/202411.6079		Tasa Fija	9,092,863.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202321/11/202312.7552	Tasa Fija	104,782.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/10/202312.7552	Tasa Fija	789,545.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202306/11/202312.7552	Tasa Fija	1,927,789.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202306/11/202312.7552	Tasa Fija	24,323.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202313/11/202312.7552	Tasa Fija	43,899.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/10/202312.7552	Tasa Fija	815,895.09

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03

AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 72 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202306/11/202312.7552	Tasa Fija	39,327.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202304/12/202313.3053	Tasa Fija	1,424,824.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202329/11/202312.7552	Tasa Fija	145,422.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202306/11/202312.7552	Tasa Fija	215,945.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202322/12/202313.3053	Tasa Fija	82,888.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No03/08/202323/01/202413.3053	Tasa Fija	95,174.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo03/08/202301/11/202311.607		Tasa Fija	50,483,625.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202331/01/202411.609		Tasa Fija	9,089,969.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202324/11/202312.7576	Tasa Fija	329,966.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/08/202301/11/202311.607		Tasa Fija	454,352.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	745,040.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202302/10/202312.655	Tasa Fija	113,732.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202310/11/202312.7576	Tasa Fija	1,688,521.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202329/11/202312.7576	Tasa Fija	225,425.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202316/10/202312.7576	Tasa Fija	184,029.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202328/11/202312.7576	Tasa Fija	67,754.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	131,658.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	210,083.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	202,411.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/10/202312.7576	Tasa Fija	16,036.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202330/01/202413.305	Tasa Fija	687,127.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	98,218.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202302/10/202312.655	Tasa Fija	1,231,425.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202323/11/202312.7576	Tasa Fija	379,282.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202327/11/202312.7576	Tasa Fija	2,171,640.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	1,454,864.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	73,464.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	29,298.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202303/10/202312.655	Tasa Fija	355.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202302/10/202312.655	Tasa Fija	1,393,430.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202327/11/202312.7576	Tasa Fija	492,673.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	107,427.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	663,246.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	14,662.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202306/11/202312.7576	Tasa Fija	646,263.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202304/12/202313.305	Tasa Fija	94,997.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202325/01/202413.305	Tasa Fija	13,595.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No04/08/202325/01/202413.305	Tasa Fija	7,371,588.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202320/10/20236.56985	Tasa Fija	5,889.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/202301/02/202411.607		Tasa Fija	9,087,052.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202302/10/202312.6525	Tasa Fija	557,771.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202304/10/202312.6525	Tasa Fija	146,507.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202302/10/202312.6525	Tasa Fija	44,159.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202304/10/202312.6525	Tasa Fija	269,508.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202301/12/202312.754	Tasa Fija	708,820.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202327/11/202312.754	Tasa Fija	4,147,551.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202306/11/202312.754	Tasa Fija	801,746.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202330/10/202312.754	Tasa Fija	47,205.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202306/11/202312.754	Tasa Fija	122,414.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202304/12/202312.754	Tasa Fija	352,536.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202330/10/202312.754	Tasa Fija	1,168,681.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/08/202304/12/202312.754	Tasa Fija	538,237.93

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 73 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/08/202327/11/202312.754 Tasa Fija 86,242.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/08/202303/11/202311.606
Tasa Fija 50,435,225.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202302/10/20236.57058 Tasa Fija 2,299,024.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/202306/11/202311.5972
Tasa Fija 453,624.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202304/10/202312.65 Tasa Fija 591,809.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202327/10/202312.746 Tasa Fija 27,303.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202310/11/202312.746 Tasa Fija 23,700.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202310/10/202312.746 Tasa Fija 126,664.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202304/10/202312.65 Tasa Fija 432,563.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202305/12/202312.746 Tasa Fija 177,135.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202304/12/202312.746 Tasa Fija 183,636.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202315/01/202413.3114 Tasa Fija 1,254,068.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/202302/02/202411.606
Tasa Fija 9,078,340.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202304/10/202312.65 Tasa Fija 140,515.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202306/11/202312.746 Tasa Fija 557,778.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202306/11/202312.746 Tasa Fija 60,163.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202305/01/202413.3114 Tasa Fija 50,156.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/08/202305/01/202413.3114 Tasa Fija 271,603.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/08/202323/10/202311.6055
Tasa Fija 5,009,671.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202320/10/20236.56743 Tasa Fija 1,018,032.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202327/11/20236.82755 Tasa Fija 574,675.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202302/10/202312.644 Tasa Fija 1,093,476.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/10/202312.644 Tasa Fija 1,051,629.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202301/12/202312.7405 Tasa Fija 291,950.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202331/10/202312.7405 Tasa Fija 11,228.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202330/10/202312.7405 Tasa Fija 176,490.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202306/11/202312.7405 Tasa Fija 43,215.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/12/202312.7405 Tasa Fija 455,390.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202312/01/202413.3317 Tasa Fija 247,769.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/12/202312.7405 Tasa Fija 10,748.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/12/202312.7405 Tasa Fija 386,254.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202306/11/202312.7405 Tasa Fija 24,893.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo09/08/202302/02/202411.606
Tasa Fija 9,078,340.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202305/12/202312.7405 Tasa Fija 230,106.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/12/202312.7405 Tasa Fija 1,483,899.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202304/12/202312.7405 Tasa Fija 40,499.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No09/08/202306/11/202312.7405 Tasa Fija 122,885.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202306/02/202411.5972
Tasa Fija 9,072,482.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202304/10/202312.6505 Tasa Fija 545,749.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202306/12/202312.7453 Tasa Fija 91,718.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202306/11/202312.7453 Tasa Fija 304,866.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202306/11/202312.7453 Tasa Fija 319,919.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202306/11/202312.7453 Tasa Fija 95,248.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202330/01/202413.3087 Tasa Fija 80,307.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202304/10/202312.6505 Tasa Fija 598,993.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202306/12/202312.7453 Tasa Fija 61,787.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202321/11/202312.7453 Tasa Fija 117,050.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202304/12/202312.7453 Tasa Fija 69,525.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202304/12/202312.7453 Tasa Fija 412,657.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No10/08/202304/12/202312.7453 Tasa Fija 328,997.41

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 74 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202305/01/202413.3087	Tasa Fija	57,083.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202327/10/202312.7453	Tasa Fija	71,090.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202306/11/202312.7453	Tasa Fija	122,455.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202329/12/202313.3087	Tasa Fija	57,187.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202304/10/202312.6505	Tasa Fija	174,991.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202304/10/202312.6505	Tasa Fija	134,373.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202306/11/202312.7453	Tasa Fija	73,070.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No10/08/202305/01/202413.3087	Tasa Fija	217,893.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo10/08/202307/03/202411.609		Tasa Fija	121,199,596.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202327/11/20236.82097	Tasa Fija	227,531.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202302/10/202312.644	Tasa Fija	8,511.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202302/10/202312.644	Tasa Fija	8,233.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/10/202312.644	Tasa Fija	7,480.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202327/10/202312.7401	Tasa Fija	512,578.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202330/10/202312.7401	Tasa Fija	658,512.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202306/11/202312.7401	Tasa Fija	282,975.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202305/01/202413.3086	Tasa Fija	882,880.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202308/12/202311.6		Tasa Fija	1,007,411.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202307/02/202411.601		Tasa Fija	9,069,606.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202306/10/202312.644	Tasa Fija	3,903.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202305/10/202312.644	Tasa Fija	283,687.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202324/11/202312.7401	Tasa Fija	987,847.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202307/12/202312.7401	Tasa Fija	105,524.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/12/202312.7401	Tasa Fija	657,461.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/12/202312.7401	Tasa Fija	107,347.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/12/202312.7401	Tasa Fija	88,253.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/08/202309/11/202311.6012		Tasa Fija	452,900.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/12/202312.7401	Tasa Fija	2,344,730.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202301/02/202413.3086	Tasa Fija	3,149,768.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202305/01/202413.3086	Tasa Fija	2,410,249.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202306/11/202312.7401	Tasa Fija	146,871.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202304/12/202312.7401	Tasa Fija	36,766.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No11/08/202301/02/202413.3086	Tasa Fija	2,808,810.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/08/202308/02/202411.6		Tasa Fija	9,066,700.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202309/10/202312.6475	Tasa Fija	355,834.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	379,400.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202309/10/202312.6475	Tasa Fija	386,753.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202301/12/202312.7425	Tasa Fija	328,600.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	1,194,517.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	1,183,357.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202306/11/202312.7425	Tasa Fija	7,890.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	873,778.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	379,163.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	527,653.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	22,387.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202303/10/202312.6475	Tasa Fija	91.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	185,825.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202309/10/202312.6475	Tasa Fija	54,791.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202301/12/202312.7425	Tasa Fija	669,380.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	488,768.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	885,727.24



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 75 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202306/11/202312.7425	Tasa Fija	1,190,482.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	545,005.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	64,211.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	611,152.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/08/202305/01/202413.3162	Tasa Fija	94,873.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/08/202310/11/202311.6012		Tasa Fija	20,128,902.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/08/202310/11/202311.6012		Tasa Fija	50,322,255.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202309/10/20236.56457	Tasa Fija	905,039.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202309/02/202411.6012		Tasa Fija	9,058,006.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202310/10/202312.635	Tasa Fija	170,514.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202303/10/202312.635	Tasa Fija	56,317.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202304/10/202312.635	Tasa Fija	43,269.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202306/11/202312.7362	Tasa Fija	126,218.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202313/12/202312.7362	Tasa Fija	132,669.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202304/12/202312.7362	Tasa Fija	278,522.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202304/12/202312.7362	Tasa Fija	528,776.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202313/11/202311.6004		Tasa Fija	452,610.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202328/11/202312.7362	Tasa Fija	13,974.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202306/11/202312.7362	Tasa Fija	867,920.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202304/12/202312.7362	Tasa Fija	155,400.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202305/01/202413.3313	Tasa Fija	328,513.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202323/10/202311.6055		Tasa Fija	5,009,671.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202306/02/202413.3313	Tasa Fija	17,171.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No15/08/202306/02/202413.3313	Tasa Fija	1,165,479.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/08/202312/03/20245.52106		Tasa Fija	43,776,891.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202330/10/202312.7355	Tasa Fija	22,564.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202313/12/202312.7355	Tasa Fija	310,523.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202306/11/202312.7355	Tasa Fija	85,431.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo16/08/202312/02/202411.6055		Tasa Fija	8,049,001.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202304/12/202312.7355	Tasa Fija	59,156.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202304/12/202312.7355	Tasa Fija	94,434.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202310/10/202312.635	Tasa Fija	90,833.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202304/12/202312.7355	Tasa Fija	651,550.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202304/12/202312.7355	Tasa Fija	367,465.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202304/12/202312.7355	Tasa Fija	9,919.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No16/08/202305/01/202413.3482	Tasa Fija	57,927.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202302/10/202312.65	Tasa Fija	779,023.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202308/12/202312.745	Tasa Fija	1,480,411.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202313/12/202312.745	Tasa Fija	1,045,193.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202313/12/202312.245	Tasa Fija	5,336,073.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202314/12/202312.745	Tasa Fija	2,031,862.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	1,979,625.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	13,167.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	9,920.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202305/01/202413.3535	Tasa Fija	22,855.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/10/202312.65	Tasa Fija	329,868.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202330/10/202312.745	Tasa Fija	91,755.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	824,409.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	595,739.91

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 76 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745 Tasa Fija	13,701.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745 Tasa Fija	87,438.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202304/12/202312.745 Tasa Fija	286,680.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No17/08/202312/01/202413.3535 Tasa Fija	110,299.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo17/08/202314/03/202411.605 Tasa Fija	6,032,880.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202316/11/202311.606 Tasa Fija	60,251,463.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202316/11/202311.606 Tasa Fija	20,083,821.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202316/11/202311.606 Tasa Fija	451,885.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202315/12/202311.6075 Tasa Fija	1,005,158.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202315/12/202311.6075 Tasa Fija	1,005,158.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/08/202315/12/202311.6075 Tasa Fija	1,005,158.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202310/10/202312.6425 Tasa Fija	109,534.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202302/10/202312.6425 Tasa Fija	339,566.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202317/11/202312.74 Tasa Fija	550,105.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202313/12/202312.74 Tasa Fija	211,752.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	182,195.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	412,104.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202305/01/202413.3526 Tasa Fija	53,947.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	18,341.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	18,718.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	577,682.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202304/12/202312.74 Tasa Fija	37,187.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202308/02/202413.3526 Tasa Fija	4,333,954.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202305/01/202413.3526 Tasa Fija	198,382.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202303/10/202312.6425 Tasa Fija	104,055.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202312/10/202312.6425 Tasa Fija	465,883.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202309/10/202312.6425 Tasa Fija	301,192.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202311/12/202312.74 Tasa Fija	4,279,175.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202310/11/202312.74 Tasa Fija	278,483.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/08/202308/02/202413.3526 Tasa Fija	3,931,287.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202327/11/20236.84112 Tasa Fija	73,331.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202316/10/202312.6425 Tasa Fija	622,815.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202304/10/202312.6425 Tasa Fija	30,000.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202316/10/202312.6425 Tasa Fija	2,502.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202316/10/202312.6425 Tasa Fija	636,214.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202315/12/202312.7425 Tasa Fija	1,188,204.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202311/12/202312.7425 Tasa Fija	1,545,864.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202304/12/202312.7425 Tasa Fija	2,087,777.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202313/11/202312.7425 Tasa Fija	399,345.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202311/12/202312.7425 Tasa Fija	169,726.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202306/11/202312.7425 Tasa Fija	10,746.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202305/01/202413.3589 Tasa Fija	179,722.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202304/10/202312.6425 Tasa Fija	163,592.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202311/12/202312.7425 Tasa Fija	15,984.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202309/10/202312.6425 Tasa Fija	1,856,118.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202309/10/202312.6425 Tasa Fija	22,887.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202313/11/202312.7425 Tasa Fija	420,817.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202302/10/202312.6425 Tasa Fija	6,130.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/08/202313/11/202312.7425 Tasa Fija	161,591.95

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 77 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202313/11/202312.7425	Tasa Fija	97,295.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	1,170,797.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	73,009.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	17,421.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202309/01/202413.3589	Tasa Fija	188,412.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/08/202305/01/202413.3589	Tasa Fija	28,579.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo21/08/202319/12/202311.6055		Tasa Fija	1,003,868.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202316/10/20236.58317	Tasa Fija	410,277.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202302/10/202312.6475	Tasa Fija	33,098.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	3,328.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202331/10/202312.74	Tasa Fija	1,641.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202311/12/202312.74	Tasa Fija	73,179.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202306/11/202312.74	Tasa Fija	404,094.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202312/02/202413.3635	Tasa Fija	624,267.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/08/202317/11/202311.606		Tasa Fija	502,095.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo22/08/202323/10/202311.6055		Tasa Fija	6,011,605.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/08/202304/12/202312.74	Tasa Fija	224,965.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/08/202301/07/202711.737		Tasa Fija	4,941,480.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202311/12/20236.82902	Tasa Fija	11,505.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo23/08/202321/12/202311.6037		Tasa Fija	1,003,223.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202313/10/202312.655	Tasa Fija	1,238,976.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202304/10/202312.655	Tasa Fija	99,818.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202310/11/202312.745	Tasa Fija	422,981.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202313/12/202312.745	Tasa Fija	332,936.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202313/11/202312.745	Tasa Fija	30,290.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202304/12/202312.745	Tasa Fija	155,100.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202305/01/202413.3814	Tasa Fija	131,059.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202305/01/202413.3814	Tasa Fija	88,991.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202316/10/202312.655	Tasa Fija	609,742.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No23/08/202304/10/202312.655	Tasa Fija	426,881.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202303/11/20236.58307	Tasa Fija	380,297.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202311/12/20236.8469	Tasa Fija	249,849.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202320/10/202312.6475	Tasa Fija	4,422.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202301/12/202312.7525	Tasa Fija	258,839.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202306/10/202312.6475	Tasa Fija	4,255.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	5,181.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	24,431.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	2,441.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/10/202312.6475	Tasa Fija	2,997.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202317/11/202312.7525	Tasa Fija	73,595.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202320/12/202312.7525	Tasa Fija	195,890.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202301/02/202413.3618	Tasa Fija	490,105.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	339,950.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202306/11/202312.7525	Tasa Fija	40,072.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	316,086.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202306/11/202312.7525	Tasa Fija	6,569.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202305/01/202413.3618	Tasa Fija	1,218,600.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202320/12/202312.7525	Tasa Fija	161,653.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No24/08/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	386,960.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo24/08/202323/10/202311.6055		Tasa Fija	8,015,474.00

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 78 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202310/10/202312.6475	Tasa Fija	50,355.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202302/10/202312.6475	Tasa Fija	91,678.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No24/08/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	404,581.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/08/202322/11/202311.6065	Tasa Fija	50,145,081.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202313/10/202312.644	Tasa Fija	7,857.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202309/10/202312.644	Tasa Fija	35,714.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202309/10/202312.644	Tasa Fija	9,813.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202323/10/202312.644	Tasa Fija	931,717.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202301/12/202312.7425	Tasa Fija	204,310.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202321/12/202312.7425	Tasa Fija	406,595.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202325/10/202312.7425	Tasa Fija	159,606.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	192,717.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	471,508.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202318/12/202312.7425	Tasa Fija	737,992.98
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202322/12/202311.6065	Tasa Fija	1,002,901.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202322/12/202311.6065	Tasa Fija	1,002,901.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202319/10/202312.644	Tasa Fija	283,551.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202326/10/202312.7425	Tasa Fija	429,513.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	246,517.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202315/02/202413.332	Tasa Fija	1,953,095.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	925,756.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202318/12/202312.7425	Tasa Fija	92,201.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202317/11/202312.7425	Tasa Fija	271,557.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202316/11/202312.7425	Tasa Fija	228,660.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	1,786,502.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202304/12/202312.7425	Tasa Fija	3,795.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202315/02/202413.332	Tasa Fija	3,186,111.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	33,056.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No25/08/202305/01/202413.332	Tasa Fija	121,676.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202323/10/202311.6055	Tasa Fija	8,015,474.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202325/08/20285.71972	Tasa Fija	86,021,339.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202316/10/20236.5879	Tasa Fija	1,967,551.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202323/10/202312.6562	Tasa Fija	227,901.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202322/12/202312.7512	Tasa Fija	207,754.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202318/12/202312.7512	Tasa Fija	3,085,063.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202304/12/202312.7512	Tasa Fija	105,869.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202304/12/202312.7512	Tasa Fija	85,226.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202305/01/202413.3669	Tasa Fija	1,321,748.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202304/10/202312.6562	Tasa Fija	175,586.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202318/12/202312.7512	Tasa Fija	269,079.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202304/12/202312.7512	Tasa Fija	76,977.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202323/01/202413.3669	Tasa Fija	126,070.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202326/12/202311.609	Tasa Fija	1,514,994.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202306/10/202312.6562	Tasa Fija	343,888.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202302/10/202312.6562	Tasa Fija	82,790.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202304/12/202312.7512	Tasa Fija	137,841.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202313/10/202312.6562	Tasa Fija	196,132.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/08/202301/12/202312.7512	Tasa Fija	23,682.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202324/11/202311.6055	Tasa Fija	50,096,712.50

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 79 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202323/02/20245.6079  
Tasa Fija 26,713,318.16  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202323/10/20236.60389 Tasa Fija 219,856.27  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202324/10/202312.6555 Tasa Fija 102,293.75  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202325/10/202312.6555 Tasa Fija 211,742.91  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202315/12/202312.7525 Tasa Fija 69,470.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202321/11/202312.7525 Tasa Fija 447,029.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202318/12/202312.7525 Tasa Fija 2,231.30  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202310/10/202312.6555 Tasa Fija 13,328.90  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202306/11/202312.7525 Tasa Fija 40,347.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202304/12/202312.7525 Tasa Fija 35,834.07  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202305/01/202413.349 Tasa Fija 787,682.23  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No29/08/202305/01/202413.349 Tasa Fija 780,602.93  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202323/02/202411.609  
Tasa Fija 5,049,983.19  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202323/02/202411.609  
Tasa Fija 8,584,971.43  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202318/12/20236.89279 Tasa Fija 93,812.99  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202320/10/202312.6579 Tasa Fija 25,263.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202304/10/202312.6579 Tasa Fija 45,372.10  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202321/11/202312.7562 Tasa Fija 9,438.28  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202304/12/202312.7562 Tasa Fija 321,674.12  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202304/12/202312.7562 Tasa Fija 49,170.22  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202304/12/202312.7562 Tasa Fija 5,573.85  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202304/12/202312.7562 Tasa Fija 7,025.14  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598 Tasa Fija 9,556.80  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598 Tasa Fija 14,999.19  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598 Tasa Fija 28,993.30  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202305/01/202413.3598 Tasa Fija 13,962.44  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202326/02/202411.609  
Tasa Fija 15,149,949.58  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202310/10/202312.6579 Tasa Fija 64,381.62  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202319/12/202312.7562 Tasa Fija 84,330.59  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202323/01/202413.3598 Tasa Fija 110,855.08  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No30/08/202326/02/202413.3598 Tasa Fija 1,001,756.53  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202323/10/202311.6055  
Tasa Fija 3,005,802.75  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202328/11/202311.6041  
Tasa Fija 450,435.15  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202326/02/202411.6079  
Tasa Fija 5,051,590.67  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202315/01/202511.6575  
Tasa Fija 894,067.11  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/07/202315/01/202411.6075  
Tasa Fija 8,276,822.68  
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/07/202315/01/202411.6075  
Tasa Fija 4,138,411.34  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202324/11/202312.7545 Tasa Fija 414,772.97  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202324/11/202312.7545 Tasa Fija 44,504.11  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202305/01/202413.3563 Tasa Fija 144,877.17  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202330/10/202312.659 Tasa Fija 17,377.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202327/12/202312.7545 Tasa Fija 149,196.40  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202318/12/202312.7545 Tasa Fija 142,107.06  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202318/01/202413.3563 Tasa Fija 241,111.31  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202330/10/202312.659 Tasa Fija 154,519.82  
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202304/10/202312.659 Tasa Fija 211,021.17

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 80 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202308/12/202312.7545	Tasa Fija	545,734.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202327/12/202312.7545	Tasa Fija	172,462.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202318/12/202312.7545	Tasa Fija	509,924.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202306/11/202312.7545	Tasa Fija	23,238.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No31/08/202305/01/202413.3563	Tasa Fija	206,380.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202327/02/202411.609	Tasa Fija	11,614,961.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo31/08/202331/08/20285.63106	Tasa Fija	12,258,685.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202320/10/202312.657	Tasa Fija	2,888,661.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202327/12/202312.7547	Tasa Fija	60,680.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202305/01/202413.3563	Tasa Fija	149,630.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202329/12/202311.5983	Tasa Fija	1,000,644.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202329/12/202311.5983	Tasa Fija	1,000,644.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202327/10/202312.657	Tasa Fija	709,084.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202313/11/202312.7547	Tasa Fija	228,268.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202325/01/202413.3563	Tasa Fija	110,775.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202325/10/202312.657	Tasa Fija	99,683.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202330/10/202312.657	Tasa Fija	2,383,408.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202319/12/202312.7547	Tasa Fija	159,271.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202326/12/202312.7547	Tasa Fija	5,506,245.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202327/11/202312.7547	Tasa Fija	1,461,171.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202306/11/202312.7547	Tasa Fija	516,385.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202327/02/202411.607	Tasa Fija	5,048,362.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo01/09/202327/02/202411.607	Tasa Fija	5,048,362.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202330/10/202312.657	Tasa Fija	114,883.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202326/12/202312.7547	Tasa Fija	80,189.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No01/09/202326/12/202312.7547	Tasa Fija	191,414.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202330/10/202312.656	Tasa Fija	344,826.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202330/10/202312.656	Tasa Fija	37,580.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202330/10/202312.656	Tasa Fija	2,723,368.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202327/11/202312.751	Tasa Fija	2,629,461.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202304/12/202312.751	Tasa Fija	205,387.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202327/11/202312.751	Tasa Fija	27,882.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202326/12/202312.751	Tasa Fija	1,378,130.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202316/10/202312.656	Tasa Fija	90,393.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202330/10/202312.656	Tasa Fija	744,868.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202326/12/202312.751	Tasa Fija	178,149.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202303/11/202312.656	Tasa Fija	481,878.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202322/12/202312.751	Tasa Fija	453,740.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202307/12/202312.751	Tasa Fija	341,279.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No04/09/202322/02/202413.3532	Tasa Fija	6,051,101.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/202328/02/202411.606	Tasa Fija	5,043,522.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo04/09/202301/03/202411.606	Tasa Fija	10,087,045.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202301/03/202411.6019	Tasa Fija	2,520,947.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202330/10/202312.6519	Tasa Fija	1,558.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202330/10/202312.6519	Tasa Fija	1,110,271.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202306/10/202312.6519	Tasa Fija	436,138.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No05/09/202329/12/202312.755	Tasa Fija	290,755.72

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 81 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202313/11/202312.755	Tasa Fija	22,468.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202329/12/202312.755	Tasa Fija	588,248.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202326/12/202312.755	Tasa Fija	326,317.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202304/12/202312.755	Tasa Fija	194,664.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202323/01/202413.3643	Tasa Fija	147,786.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,661,465.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,892,125.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202309/10/202312.6519	Tasa Fija	7,511.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202304/10/202312.6519	Tasa Fija	106,243.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202306/10/202312.6519	Tasa Fija	5,881.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202329/12/202312.755	Tasa Fija	204,785.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202306/11/202312.755	Tasa Fija	60,733.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	6,393.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202306/10/202312.6519	Tasa Fija	10,592.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202306/10/202312.6519	Tasa Fija	161,190.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202304/10/202312.6519	Tasa Fija	25,217.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202308/12/202312.755	Tasa Fija	44,486.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202328/12/202312.755	Tasa Fija	45,675.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202327/11/202312.755	Tasa Fija	5,353.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No05/09/202304/12/202312.755	Tasa Fija	77,028.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202304/12/202311.6019		Tasa Fija	352,932.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202301/03/202411.6019		Tasa Fija	5,041,895.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo05/09/202303/01/202411.6019		Tasa Fija	15,125,687.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202302/10/20236.52887	Tasa Fija	279,689.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202330/10/20236.6023	Tasa Fija	45,154.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202327/11/20236.6023	Tasa Fija	323,739.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202325/10/202312.6472	Tasa Fija	77,009.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202327/12/202312.7525	Tasa Fija	136,974.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202327/11/202312.7525	Tasa Fija	42,701.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202309/01/202413.3643	Tasa Fija	112,236.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	1,376,363.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/202411.5972		Tasa Fija	2,520,134.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202305/01/202413.3643	Tasa Fija	5,494.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202322/12/202312.7525	Tasa Fija	217,695.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202327/11/202312.7525	Tasa Fija	232,127.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No06/09/202306/10/202312.6472	Tasa Fija	27,863.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/20245.6123		Tasa Fija	8,315,502.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202304/03/202411.5972		Tasa Fija	5,040,268.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo06/09/202330/11/202311.5972		Tasa Fija	20,161,072.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202324/11/20236.59108	Tasa Fija	687,577.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202306/10/202312.651	Tasa Fija	153,601.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202310/10/202312.651	Tasa Fija	84,451.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202316/10/202312.651	Tasa Fija	206,990.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202306/10/202312.651	Tasa Fija	29,519.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202306/11/202312.651	Tasa Fija	564,372.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202306/11/202312.651	Tasa Fija	50,851.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202322/12/202312.7537	Tasa Fija	190,168.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	38,472.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No07/09/202304/12/202312.7537	Tasa Fija	94,878.56

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 82 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	124,447.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202304/12/202312.7537	Tasa Fija	10,947.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	143,651.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202313/10/202312.651	Tasa Fija	99,189.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202329/12/202312.7537	Tasa Fija	612,992.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202306/10/202312.651	Tasa Fija	12,380.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	11,956.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo07/09/202305/03/202411.601	Tasa Fija	2,519,335.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202303/01/202412.7537	Tasa Fija	61,445.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	1,753,316.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202305/01/202412.7537	Tasa Fija	45,303.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No07/09/202322/02/202413.375	Tasa Fija	2,583,317.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6	Tasa Fija	15,111,166.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6	Tasa Fija	1,007,411.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202325/10/202312.65	Tasa Fija	56,273.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/10/202312.65	Tasa Fija	16,386.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202313/10/202312.65	Tasa Fija	779,198.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202310/11/202312.7543	Tasa Fija	34,521.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202326/12/202312.7543	Tasa Fija	520,949.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	325,621.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	23,071.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	29,666.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202322/02/202413.383	Tasa Fija	5,964,119.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202313/10/202312.65	Tasa Fija	494,588.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6	Tasa Fija	1,703,532.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202306/11/202312.65	Tasa Fija	17,640.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202313/10/202312.65	Tasa Fija	2,359.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543	Tasa Fija	114,312.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	137,492.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202304/12/202312.7543	Tasa Fija	14,592.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	46,328.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202327/10/202312.65	Tasa Fija	19,099.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202320/10/202312.65	Tasa Fija	1,415,581.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202306/11/202312.65	Tasa Fija	966,969.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202313/10/202312.65	Tasa Fija	246,858.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202329/12/202312.7543	Tasa Fija	167,926.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202304/01/202412.7543	Tasa Fija	674,512.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543	Tasa Fija	1,325,594.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202302/01/202412.7543	Tasa Fija	261,153.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202304/12/202312.7543	Tasa Fija	401,661.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202305/01/202412.7543	Tasa Fija	84,697.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202304/12/202312.7543	Tasa Fija	20,958.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6	Tasa Fija	5,037,055.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6	Tasa Fija	5,037,055.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202305/01/202411.6	Tasa Fija	1,511,116.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No08/09/202329/02/202413.383	Tasa Fija	4,905,529.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202306/03/202411.6	Tasa Fija	10,074,111.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo08/09/202307/12/202311.6	Tasa	

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 83 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Fija 422,107.27

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202309/10/20236.52933	Tasa Fija	234,672.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202306/11/20236.61099	Tasa Fija	103,045.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202304/12/20236.61099	Tasa Fija	3,553.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202326/12/20236.87601	Tasa Fija	106,891.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/202308/12/202311.6012	Tasa Fija	352,300.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/202307/03/202411.6012	Tasa Fija	2,460,758.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202306/11/202312.6512	Tasa Fija	293,881.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202306/11/202312.6512	Tasa Fija	197,115.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202306/11/202312.6512	Tasa Fija	2,478,731.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202313/10/202312.6512	Tasa Fija	116,617.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202301/12/202312.7572	Tasa Fija	326,991.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202322/12/202312.7572	Tasa Fija	452,204.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572	Tasa Fija	336,299.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572	Tasa Fija	845,291.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202304/12/202312.7572	Tasa Fija	1,072,129.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202302/01/202412.7572	Tasa Fija	1,256,695.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572	Tasa Fija	770,990.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202304/12/202312.7572	Tasa Fija	177,955.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202320/10/202312.6512	Tasa Fija	364,499.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202323/10/202312.6512	Tasa Fija	173,486.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572	Tasa Fija	15,293.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572	Tasa Fija	234,639.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202313/10/202312.6512	Tasa Fija	310,902.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202323/10/202312.6512	Tasa Fija	78,828.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202328/11/202312.7572	Tasa Fija	103,363.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202305/01/202412.7572	Tasa Fija	267,013.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202304/12/202312.7572	Tasa Fija	230,530.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202304/12/202312.7572	Tasa Fija	128,044.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202327/10/202312.6512	Tasa Fija	331,944.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202315/12/202312.7572	Tasa Fija	8,532.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo11/09/202307/03/202411.6012	Tasa Fija	5,032,225.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202327/10/202312.6512	Tasa Fija	382,497.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202327/10/202312.6512	Tasa Fija	371,217.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202327/10/202312.6512	Tasa Fija	344,168.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No11/09/202320/10/202312.6512	Tasa Fija	165,335.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202302/10/20236.52946	Tasa Fija	243,534.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202330/10/20236.61047	Tasa Fija	364,649.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202308/03/202411.6055	Tasa Fija	2,515,312.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202323/10/202312.6555	Tasa Fija	871,814.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202323/10/202312.6555	Tasa Fija	71,694.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202330/10/202312.6555	Tasa Fija	34,593.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202329/12/202312.755	Tasa Fija	21,425.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	1,098,910.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	51,657.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	731,246.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	13,177.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202309/02/202413.3783	Tasa Fija	339,626.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202311/12/202311.6055	Tasa Fija	350,333.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202309/11/202312.6555	Tasa Fija	19,479.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No12/09/202306/11/202312.6555	Tasa Fija	21,952.40

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

## NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN FINANCIERA

PAGINA 84 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202306/11/202312.6555	Tasa Fija	45,844.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202313/10/202312.6555	Tasa Fija	215,145.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	188,560.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202326/12/202312.755	Tasa Fija	113,945.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202304/12/202312.755	Tasa Fija	500,423.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	37,698.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202313/10/202312.6555	Tasa Fija	62,467.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202309/01/202412.255	Tasa Fija	12,521,661.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202311/12/202311.6055		Tasa Fija	452,756.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202313/10/202312.6555	Tasa Fija	9,684.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202308/12/202312.755	Tasa Fija	274,916.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No12/09/202305/01/202412.755	Tasa Fija	50,225.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo12/09/202308/03/202411.6055		Tasa Fija	5,030,625.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202311/12/202311.6004		Tasa Fija	330,353.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202312/10/202312.6504	Tasa Fija	912.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/11/202312.6504	Tasa Fija	19,034.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/10/202312.6504	Tasa Fija	2,497.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202319/12/202312.7525	Tasa Fija	47,214.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202326/12/202312.7525	Tasa Fija	114,495.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	932,174.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	120,296.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/02/202413.3855	Tasa Fija	811,551.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo13/09/202311/03/202411.6004		Tasa Fija	2,514,500.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/11/202312.6504	Tasa Fija	43,507.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	126,923.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202310/11/202312.6504	Tasa Fija	53,033.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/11/202312.6504	Tasa Fija	25,654.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202313/10/202312.6504	Tasa Fija	9,442.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	1,877,638.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No13/09/202306/02/202413.3855	Tasa Fija	3,041,977.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202309/10/20236.53356	Tasa Fija	117,947.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202316/10/20236.60822	Tasa Fija	812,824.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202310/11/202312.655	Tasa Fija	131,070.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202306/11/202312.655	Tasa Fija	96,423.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202306/11/202312.655	Tasa Fija	305,045.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202326/12/202312.7569	Tasa Fija	349,096.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	1,358,426.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	491,237.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	83,824.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202323/02/202413.3879	Tasa Fija	291,698.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	8,195.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	441,468.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202312/03/202411.605		Tasa Fija	2,463,426.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202313/12/202311.605		Tasa Fija	305,441.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo14/09/202313/12/202311.605		Tasa Fija	243,909.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202303/11/202312.655	Tasa Fija	75,146.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202313/10/202312.655	Tasa Fija	3,605.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202322/12/202312.7569	Tasa Fija	387,807.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No14/09/202303/01/202412.7569	Tasa Fija	59,261.51

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 85 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	6,057.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	92,021.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202305/01/202412.7569	Tasa Fija	72,836.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202306/02/202413.3879	Tasa Fija	126,111.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202301/11/202312.655	Tasa Fija	124,308.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No14/09/202303/01/202412.7569	Tasa Fija	268,632.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202309/10/20236.5322	Tasa Fija	529,073.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202330/10/20236.60943	Tasa Fija	490,328.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202313/03/202411.6075	Tasa Fija	2,392,278.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202313/11/202312.6575	Tasa Fija	45,593.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/11/202312.6575	Tasa Fija	21,052.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202320/10/202312.6575	Tasa Fija	4,506,352.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202310/01/202412.7585	Tasa Fija	464,874.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	1,376,155.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202303/01/202412.7585	Tasa Fija	303,427.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	8,930.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	98,711.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202314/12/202311.6075	Tasa Fija	480,274.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202314/12/202311.6075	Tasa Fija	368,888.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202324/10/202312.6575	Tasa Fija	2,045,637.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202318/10/202312.6575	Tasa Fija	601,679.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202303/01/202412.7585	Tasa Fija	490,869.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202304/12/202312.7585	Tasa Fija	61,939.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202304/12/202312.7585	Tasa Fija	31,230.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	1,154,744.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	29,194.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202312/01/202411.6075	Tasa Fija	1,256,448.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202314/12/202311.6075	Tasa Fija	351,805.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202310/11/202312.6575	Tasa Fija	28,366.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202323/10/202312.6575	Tasa Fija	510,478.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202320/10/202312.6575	Tasa Fija	6,006.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202305/01/202412.7585	Tasa Fija	63,272.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202311/12/202312.7585	Tasa Fija	181,674.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202308/01/202412.7585	Tasa Fija	86,810.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202306/02/202413.3756	Tasa Fija	473,439.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202309/11/202312.6575	Tasa Fija	916,439.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No15/09/202307/03/202413.3756	Tasa Fija	5,082,503.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo15/09/202313/03/202411.6075	Tasa Fija	15,077,383.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202301/12/20236.61009	Tasa Fija	424,366.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202314/03/202411.606	Tasa Fija	2,510,477.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202312/03/202411.606	Tasa Fija	9,238,557.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202310/11/202312.656	Tasa Fija	785,027.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202313/11/202312.656	Tasa Fija	60,115.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202313/11/202312.656	Tasa Fija	1,376,501.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202320/10/202312.656	Tasa Fija	12,075.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202310/01/202412.7525	Tasa Fija	414,397.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	1,004,530.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202311/12/202312.7525	Tasa Fija	3,390.68

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA 86 / 94

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202303/01/202412.7525	Tasa Fija	707,631.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	478,423.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	1,624,429.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	165,122.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	14,011.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202301/02/202413.3801	Tasa Fija	24,217.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202315/03/202411.606	Tasa Fija	27,113,158.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202310/10/202312.656	Tasa Fija	95,066.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202320/10/202312.656	Tasa Fija	1,390,236.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202306/11/202312.656	Tasa Fija	352,262.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202313/10/202312.656	Tasa Fija	26,247.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202304/10/202312.656	Tasa Fija	3,749,985.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	4,292.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202316/01/202411.606	Tasa Fija	1,255,238.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202313/10/202312.656	Tasa Fija	411,361.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202313/10/202312.656	Tasa Fija	392,421.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202317/11/202312.656	Tasa Fija	660,851.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202327/10/202312.656	Tasa Fija	299,154.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202301/12/202312.7525	Tasa Fija	466,613.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202303/11/202312.656	Tasa Fija	532,256.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	812,560.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	35,372.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No18/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	764,006.82
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202315/12/202311.606	Tasa Fija	365,651.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo18/09/202315/12/202311.606	Tasa Fija	369,086.41
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202313/03/202411.6055	Tasa Fija	9,235,590.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202303/11/202312.6555	Tasa Fija	136,645.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202317/10/202312.6555	Tasa Fija	151,974.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202313/11/202312.6555	Tasa Fija	124,278.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202306/11/202312.6555	Tasa Fija	7,405.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202313/11/202312.6555	Tasa Fija	33,616.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202312/01/202412.7525	Tasa Fija	646,890.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202328/12/202312.7525	Tasa Fija	155,013.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202308/01/202412.7525	Tasa Fija	1,999,770.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	680,479.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202303/01/202412.7525	Tasa Fija	605,845.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	69,927.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202304/12/202312.7525	Tasa Fija	89,850.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202306/02/202413.3745	Tasa Fija	635,693.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202317/01/202411.6055	Tasa Fija	1,505,802.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANo19/09/202315/03/202411.6055	Tasa Fija	1,505,802.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202310/11/202312.6555	Tasa Fija	132,485.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202324/11/202312.7525	Tasa Fija	312,712.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202317/11/202312.6555	Tasa Fija	452,899.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202317/11/202312.6555	Tasa Fija	402,393.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202305/01/202412.7525	Tasa Fija	134,428.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202309/02/202413.3745	Tasa Fija	110,850.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202306/02/202413.3745	Tasa Fija	25,783.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202310/11/202312.6555	Tasa Fija	39,584.82

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 87 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202309/10/202312.6555	Tasa Fija	159,447.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202302/10/202312.6555	Tasa Fija	106,685.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No19/09/202320/10/202312.6555	Tasa Fija	5,275.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202318/12/202311.6055	Tasa Fija	401,547.40
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202312/09/202411.6055	Tasa Fija	5,019,342.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202318/12/202311.6055	Tasa Fija	372,887.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202318/12/202311.6055	Tasa Fija	420,622.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202316/10/20236.52484	Tasa Fija	965,631.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202313/11/20236.59785	Tasa Fija	1,272,455.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202318/01/202411.6075	Tasa Fija	2,007,093.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202315/03/202411.6075	Tasa Fija	1,580,586.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202314/03/202411.6075	Tasa Fija	9,232,629.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202302/10/202312.6575	Tasa Fija	121,178.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202316/01/202412.7563	Tasa Fija	343,746.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202308/01/202412.7563	Tasa Fija	343,620.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563	Tasa Fija	740,146.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202310/01/202412.7563	Tasa Fija	366,263.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202304/12/202312.7563	Tasa Fija	6,196.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202309/02/202413.3809	Tasa Fija	189,389.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202316/10/202312.6575	Tasa Fija	48,275.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563	Tasa Fija	209,305.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No20/09/202305/01/202412.7563	Tasa Fija	63,652.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202319/12/202311.6075	Tasa Fija	403,282.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202319/12/202311.6075	Tasa Fija	349,436.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202315/03/202411.6037	Tasa Fija	9,229,653.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202319/03/202411.6037	Tasa Fija	1,755,640.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202319/01/202411.6037	Tasa Fija	2,006,446.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202320/10/202312.6537	Tasa Fija	253,208.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202312/01/202412.7575	Tasa Fija	559,175.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202320/10/202312.6537	Tasa Fija	145,197.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	219,994.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	333,882.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202321/11/202312.7575	Tasa Fija	100,944.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	630,285.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	613,323.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	338,296.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/02/202413.3915	Tasa Fija	93,541.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202303/11/202312.6537	Tasa Fija	21,776.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202307/11/202312.6537	Tasa Fija	2,125,503.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	30,002.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202327/10/202312.6537	Tasa Fija	6,336,758.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	26,769.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	282,221.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	7,252.38

---

**BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.**

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT**

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA**

PAGINA **88 / 94**

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	2,962.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202312/01/202412.7575	Tasa Fija	372,039.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202313/12/202312.7575	Tasa Fija	40,395.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202308/01/202412.7575	Tasa Fija	16,654.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	87,859.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202308/01/202412.7575	Tasa Fija	35,807.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	208,284.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202305/01/202412.7575	Tasa Fija	180,612.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202306/11/202312.6537	Tasa Fija	43,133.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202327/10/202312.6537	Tasa Fija	66,040.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No21/09/202317/01/202412.7575	Tasa Fija	75,304.81
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202320/12/202311.6037		Tasa Fija	314,391.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202320/12/202311.6037		Tasa Fija	326,774.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202308/12/20236.59613	Tasa Fija	156,660.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202321/12/202311.6065		Tasa Fija	258,028.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202321/12/202311.6065		Tasa Fija	340,528.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202320/03/202411.6065		Tasa Fija	1,755,077.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202330/10/202312.6565	Tasa Fija	133,673.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202310/11/202312.6565	Tasa Fija	30,251.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202303/11/202312.6565	Tasa Fija	553,488.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202330/10/202312.6565	Tasa Fija	1,668,149.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202327/10/202312.6565	Tasa Fija	88,085.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202319/01/202412.7612	Tasa Fija	1,303,499.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202318/01/202412.7612	Tasa Fija	408,674.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202302/01/202412.7612	Tasa Fija	151,696.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	474,888.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	213,467.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202304/12/202312.7612	Tasa Fija	3,098.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	98,066.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	136,846.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202327/10/202312.6565	Tasa Fija	21,493.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202311/12/202312.7612	Tasa Fija	75,193.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202303/01/202412.7612	Tasa Fija	33,476.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	25,616.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	158,773.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202316/02/202413.4028	Tasa Fija	163,245.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	1,022,925.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	423,953.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202320/10/202311.6065		Tasa Fija	13,037,721.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202321/11/202312.6565	Tasa Fija	2,199,878.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/10/202312.6565	Tasa Fija	313,929.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202316/11/202312.6565	Tasa Fija	605,815.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/11/202312.6565	Tasa Fija	467,748.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202312/01/202412.7612	Tasa Fija	85,305.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202315/01/202412.7612	Tasa Fija	722,740.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202315/12/202312.7612	Tasa Fija	279,829.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202305/01/202412.7612	Tasa Fija	456,354.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202315/01/202412.7612	Tasa Fija	76,219.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202314/03/202413.4028	Tasa Fija	2,144,069.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	131,225.77

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 89 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	37,777.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No22/09/202306/02/202413.4028	Tasa Fija	39,160.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202321/11/20236.60009	Tasa Fija	671,346.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202306/11/20236.60009	Tasa Fija	3,459,616.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202321/03/202411.6055		Tasa Fija	1,753,384.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202324/11/202312.6555	Tasa Fija	48,285.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202317/11/202312.6555	Tasa Fija	692,137.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202321/11/202312.6555	Tasa Fija	704,552.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202321/11/202312.6555	Tasa Fija	1,020,969.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202313/10/202312.6555	Tasa Fija	13,329.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/12/202312.7581	Tasa Fija	218,685.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	4,167,080.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	1,760,808.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202318/12/202312.7581	Tasa Fija	228,509.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202320/12/202312.7581	Tasa Fija	47,495.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	551,941.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	147,448.34
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	55,691.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/03/202413.4134	Tasa Fija	114,554.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202326/02/202413.4134	Tasa Fija	406,907.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202314/03/202413.4134	Tasa Fija	2,195,843.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202306/02/202413.4134	Tasa Fija	450,615.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202317/11/202312.6555	Tasa Fija	284,964.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202324/11/202312.6555	Tasa Fija	350,156.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202324/11/202312.6555	Tasa Fija	322,669.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202304/10/202312.6555	Tasa Fija	1,727,708.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202313/11/202312.6555	Tasa Fija	41,751.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202321/11/202312.6555	Tasa Fija	33,021.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202327/10/202312.6555	Tasa Fija	40,131.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202311/12/202312.7581	Tasa Fija	116,013.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202315/01/202412.7581	Tasa Fija	72,309.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No25/09/202305/01/202412.7581	Tasa Fija	53,451.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202322/12/202311.6055		Tasa Fija	350,721.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202322/12/202311.6055		Tasa Fija	368,256.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202315/09/202711.7555		Tasa Fija	1,795,448.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202323/10/20236.51751	Tasa Fija	3,520,763.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202321/11/20236.59981	Tasa Fija	520,008.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202322/03/202411.599		Tasa Fija	1,752,819.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202306/11/202312.649	Tasa Fija	1,224,479.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202327/10/202312.649	Tasa Fija	514,307.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202306/11/202312.649	Tasa Fija	129,972.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202327/11/202312.754	Tasa Fija	76,629.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202304/12/202312.754	Tasa Fija	605,461.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202304/03/202413.4152	Tasa Fija	1,131,733.32
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202322/12/202311.599		Tasa Fija	400,644.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202324/11/202312.649	Tasa Fija	444,358.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	220,619.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	51,207.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202305/01/202412.754	Tasa Fija	40,863.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No26/09/202316/02/202413.4152	Tasa Fija	99,729.67

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
 INSTITUCION DE BANCA  
 MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
 SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
 FINANCIERA

PAGINA 90 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202315/02/202413.4152	Tasa Fija	135,438.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202306/02/202413.4152	Tasa Fija	478,111.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202306/02/202413.4152	Tasa Fija	30,855.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No26/09/202308/03/202413.4152	Tasa Fija	110,827.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202322/12/202311.599	Tasa Fija	244,811.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202322/12/202311.599	Tasa Fija	353,546.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202323/04/202411.599	Tasa Fija	50,080,548.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202321/11/20236.59112	Tasa Fija	48,469.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202309/10/202312.6495	Tasa Fija	106,434.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202319/12/202312.752	Tasa Fija	176,994.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202302/01/202412.752	Tasa Fija	36,816.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202317/01/202412.752	Tasa Fija	2,473,717.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	1,765,028.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	44,629.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202325/03/202411.5995	Tasa Fija	1,752,255.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202325/03/202411.5995	Tasa Fija	1,501,933.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202303/11/202312.6495	Tasa Fija	72,257.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202329/12/202312.752	Tasa Fija	126,200.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202305/01/202412.752	Tasa Fija	192,744.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202317/01/202412.752	Tasa Fija	175,914.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202305/01/202412.752	Tasa Fija	18,064.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	22,686.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No27/09/202306/02/202413.4306	Tasa Fija	297,971.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202326/12/202311.5995	Tasa Fija	331,217.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202326/12/202311.5995	Tasa Fija	279,695.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202315/01/20246.86327	Tasa Fija	60,451.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202326/03/202411.6041	Tasa Fija	1,751,692.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202326/03/202411.6041	Tasa Fija	1,751,692.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202324/11/202312.6541	Tasa Fija	3,568,797.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202317/11/202312.6541	Tasa Fija	13,039.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202310/11/202312.6541	Tasa Fija	543,998.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202316/10/202312.6541	Tasa Fija	83,350.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202309/10/202312.6541	Tasa Fija	8,342.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202317/01/202412.7583	Tasa Fija	5,841.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	574,674.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	981,405.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	100,318.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202322/03/202413.4397	Tasa Fija	2,092,554.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202314/02/202413.4397	Tasa Fija	51,022.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202304/03/202413.4397	Tasa Fija	315,352.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202314/03/202413.4397	Tasa Fija	3,572,116.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	44,641.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	48,209.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202327/10/202312.6541	Tasa Fija	237,358.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/11/202312.6541	Tasa Fija	292,664.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/10/202312.6541	Tasa Fija	143,054.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.No28/09/202306/11/202312.6541	Tasa Fija	52,755.45

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 91 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202322/12/202312.7583	Tasa Fija	272,038.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	9,718.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	2,528.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	67,585.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202305/01/202412.7583	Tasa Fija	2,289.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	13,116.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	7,140.77
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202327/11/202312.6541	Tasa Fija	913,090.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202327/10/202312.6541	Tasa Fija	11,854.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202315/03/202413.4397	Tasa Fija	119,016.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No28/09/202306/02/202413.4397	Tasa Fija	55,585.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202331/07/202411.6041		Tasa Fija	50,048,350.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202327/12/202311.6041		Tasa Fija	329,359.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202327/12/202311.6041		Tasa Fija	257,530.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202325/04/202411.6041		Tasa Fija	20,019,340.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202325/04/202411.6041		Tasa Fija	1,701,643.91
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202327/03/202411.5983		Tasa Fija	1,751,127.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202327/03/202411.5983		Tasa Fija	1,500,966.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202326/04/202411.5983		Tasa Fija	19,512,564.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202313/11/202312.6483	Tasa Fija	3,186,754.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202306/11/202312.6483	Tasa Fija	366,588.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202306/11/202312.6483	Tasa Fija	115,150.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202327/11/202312.6483	Tasa Fija	2,545,643.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202315/01/202412.7566	Tasa Fija	64,801.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	80,546.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	1,460,033.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	225,560.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202305/01/202412.7566	Tasa Fija	35,560.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202321/03/202413.441	Tasa Fija	2,453,941.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202314/03/202413.441	Tasa Fija	2,206,751.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202306/02/202413.441	Tasa Fija	363,699.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202327/11/202312.6483	Tasa Fija	454,499.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202317/11/202312.6483	Tasa Fija	1,720.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202327/11/202312.6483	Tasa Fija	2,188,018.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202323/11/202312.6483	Tasa Fija	389,595.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202327/10/202312.6483	Tasa Fija	20,873.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202319/01/202412.7566	Tasa Fija	429,117.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	5,931,507.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202323/02/202413.441	Tasa Fija	44,389.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202327/11/202312.6483	Tasa Fija	57,263.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202313/11/202312.6483	Tasa Fija	269,574.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202329/12/202312.7566	Tasa Fija	542,031.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202326/12/202312.7566	Tasa Fija	56,275.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	68,216.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202317/01/202412.7566	Tasa Fija	54,098.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202322/01/202412.7566	Tasa Fija	318,027.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.No29/09/202306/02/202413.441	Tasa Fija	36,762.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202328/12/202311.5983			

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 93 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

Scotiabank / FONDOS BanorteNo13/12/202213/12/2023TIIIE28 +0.03	1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS Scotia BankNo30/01/202306/11/2023TIIIE28 +0.03	1,250,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BanorteNo31/01/202302/01/2024TIIIE28 +0.03	900,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BBVANO28/02/202330/01/2024TIIIE28 +0.04	2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo28/02/202313/02/2024TIIIE28 +0.03	350,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BBVANO30/03/202329/02/2024TIIIE FONDEO +0.25	2,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BanorteNo31/03/202301/03/2024TIIIE FONDEO +0.26	1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BanorteNo31/03/202301/03/2024TIIIE28 +0.03	1,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BBVANO17/04/202315/04/2024TIIIE FONDEO +0.25	3,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BBVANO20/04/202318/04/2024TIIIE FONDEO +0.26	3,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS BanorteNo26/04/202325/03/2024TIIIE28 +0.03	2,000,000,000.00
Scotiabank / Banco del BienestarNo31/05/202329/05/2024TIIIE FONDEO +0.26	500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS HSBCNo31/05/202315/05/2024TIIIE28 +0.02	2,000,000,000.00
Scotiabank / FONDOS Scotia BankNo31/08/202309/05/2024TIIIE28 +0.02	1,500,000,000.00
Scotiabank / FONDOS Scotia BankNo31/08/202309/05/2024TIIIE28 +0.02	500,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNNo18/12/201405/12/20247.4	2,093,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNNo28/06/201809/06/203312.3	3,360,000,000.00
Scotiabank / SCOTIABANK CAYMANNNo11/09/201805/09/202311.32	3,455,000,000.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No20/07/202330/11/202311.54998	52,099,362.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No06/07/202302/01/202411.60002	620,204,500.00
Scotiabank / IMSSNo12/04/202308/01/202412.06005	2,180,599,995.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No13/07/202309/01/202411.60002	213,562,518.00
Scotiabank / IMSSNo31/01/202315/01/202411.6	1,112,261,666.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No20/07/202316/01/202411.57002	53,425,728.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No03/08/202330/01/202411.55995	72,531,314.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No19/05/202313/02/202411.75001	272,920,169.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No31/08/202327/02/202411.67997	122,807,400.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No15/09/202313/03/202411.67997	44,584,010.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No19/05/202313/05/202411.61997	77,997,992.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No31/08/202327/05/202411.57995	54,331,231.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No06/07/202301/07/202411.46997	46,653,082.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No20/07/202315/07/202411.36005	29,637,768.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No03/08/202329/07/202411.44996	55,730,850.00
Scotiabank / Scotia Casa de Bolsa No31/08/202326/08/202411.54997	55,775,985.00
TOTAL	14,757,099,362.00 25,263,024,208.00 2,093,000,000.00 - -
3,360,000,000.00	697,116,000.00 - - - -
Colocaciones privadas (con garantía)	

TOTAL	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Total bursátiles listados en bolsa y colocaciones privadas	16,195,875,528.00									
27,612,710,534.00	2,093,000,000.00	7,125,499,300.00	-	3,360,000,000.00						
697,116,000.00	-	-	-	-						
Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de interés y/o sobretasaDenominación [eje]										
Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]										
Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]										
Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]										
Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]										
Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]										
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]										
Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo										

TOTAL - - - - - - - - - - - - - - - -

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA  
MULTIPLE, GRUPO FINANCIERO  
SCOTIABANK INVERLAT

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN  
FINANCIERA

PAGINA 94 / 94

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]

Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]

Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]

Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]

Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]

Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]

Proveedores [sinopsis]

Proveedores

TOTAL - - - - -

Total proveedores - - - - -

Institución Extranjera (Si/No) Fecha de firma/contrato Fecha de vencimiento Tasa de interés y/o sobretasa Denominación [eje]

Moneda nacional [miembro] Moneda extranjera [miembro]

Intervalo de tiempo [eje] Intervalo de tiempo [eje]

Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro] Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro]

Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro] Año actual [miembro] Hasta 1 año [miembro]

Hasta 2 años [miembro] Hasta 3 años [miembro] Hasta 4 años [miembro] Hasta 5 años o más [miembro]

Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]

Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - -

Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - -

Total de créditos 18,144,074,675.86 41,808,616,111.22 4,207,431,708.11 8,493,989,307.64

1,823,227,773.11 3,948,192,102.70 943,159,139.38 7,668,488,744.95 14,818,959.75

67,040,888.91 120,285,606.62 295,413,135.18

Comentarios:  
El tipo de cambio tomado al cierre de septiembre es de 17.4279

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

## I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

### a. Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo.

Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

Las diferentes áreas responsables de la operación y supervisión del mercado definen los objetivos, metas y procedimientos particulares, de operación y control, así como las tolerancias máximas de riesgo aceptables por área, mismos que deberán ser congruentes con los lineamientos generales establecidos por la Dirección General.

Los productos derivados son importantes herramientas de gestión de riesgo tanto para el Banco como para sus clientes.

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus clientes y toma posiciones por cuenta propia, realiza operaciones con instrumentos financieros derivados, con fines de cobertura y/o de negociación de acuerdo con las políticas establecidas.

Los objetivos generales de los productos derivados que opera Scotiabank Inverlat son los siguientes:

- 1) Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo- rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo con su perfil de riesgo.
  - 2) Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.
  - 3) Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.
  - 4) Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión
-

del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

- 1) Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.
- 2) Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.
- 3) Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

La Institución cuenta con Políticas y manuales, que se enlistan a continuación, donde descansan los lineamientos y procedimientos relativos a la operación y administración de derivados; entre estas políticas se destaca la de Gestión del Riesgos de Nuevas Iniciativas que involucra la participación de diversas áreas de la Institución, a fin de garantizar que no se incurran en riesgos operativos, legales o reputacionales.

- 1) Manual de Operación de Derivados.
- 2) Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.
- 3) Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).
- 4) Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas
- 5) Política de Riesgo de Contraparte
- 6) Política de Sobregiros

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al riesgo de tasas de interés y al riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a la Norma de Información Financiera (NIF), criterio C-10 "Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura", en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de las operaciones de cobertura.

Actualmente se cuenta con 9 estrategias de cobertura, las cuales tienen como objetivo general cubrir posiciones tanto activas como pasivas del balance ante posibles movimientos de las tasas de interés y de tipo de cambio. Las condiciones de mercado bajo las cuales se realizan coberturas son las siguientes:

Núm.	Tipo de Cobertura	Posición	Cubierta	Tipo de posición	cubierta	Condición de
Mercado	Derivado					
1.	Flujos de Efectivo	Pagarés	con rendimiento	liquidable	al vencimiento	de tasa fija
	Pasiva	Cobertura	ante una posible	alza	en las tasas	de interés
				Swap	de tasas	de

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 3 / 25

CONSOLIDADO

Impresión Final

---

interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)  
2. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente. Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)  
3. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante Activa Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)  
4. Valor Razonable Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera Activa Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)  
5. Flujos de Efectivo Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)  
6. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)  
7. Flujos de Efectivo Reportos Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)  
8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)  
9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Banco se encuentran:

Subyacente\* Futuros Opciones Swaps  
MRMEMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (Currency Swaps), Regular Caps&Floors, Binary Caps&Floors, puede tener modalidades o variaciones para intercambiar pagos de intereses a partir de una fecha futura (Forward Starting)), las cuales son definidas al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

2). (MR) Mercados reconocidos

---

---

3).(ME) Mercados extrabursátiles

Las operaciones de derivados de cobertura se incluirán dentro del cálculo de medidas de sensibilidad (i.e. Valor Económico y Sensibilidad del Margen). En adición, se monitorearán bajo los límites establecidos para ALM previamente aprobados por el Comité de Riesgos.

El objetivo de la función de administración de riesgos de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en factores de riesgo como tasas de interés, precios en el mercado accionario y otros en los mercados de dinero, capitales y derivados, a los que están expuestas las posiciones.

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual, se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algortihmics y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Con esta metodología se generan 300 escenarios a partir de las observaciones históricas y los principales supuestos del modelo son:

- El modelo de Simulación Histórica no hace supuestos sobre la correlación de los factores de riesgo
- El modelo no hace supuestos sobre la forma de la distribución de los cambios en el valor del portafolio. No supone normalidad.
- El modelo permite agregar los riesgos a través de los diferentes productos (divisas, mercado de dinero, derivados.)
- El modelo puede incorporar la característica no lineal de las opciones, así como efectos gamma y vega.

Debido a que la medida de VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución realiza diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

Adicionalmente se realizan pruebas de backtest donde se compara el P&L (teórico y real) diario vs VaR de 1 día. Este análisis es realizado mensualmente y es presentado al Comité de Riesgos del Consejo de Administración al menos trimestralmente.

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles. Scotiabank Inverlat administra su exposición al riesgo de liquidez conforme a las disposiciones regulatorias aplicables y a las mejores prácticas de mercado.

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

---



# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 5 / 25

CONSOLIDADO

Impresión Final

- 
- 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 2023 y en promedio para el tercer trimestre de 2023 es de:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 72,51383,087

Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,949116,211

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura.

Inventario de modelos de derivados

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México). El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los aplicativos desarrollados en casa matriz (K2/Peak & Wall Street).

Instrumentos valuados a valor razonable

Product Name Underlying Product Currency Valuation Model Valuation Input Daily Pricing Source

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's

Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

IRS Futures TIIE Fondeo MXN Price Price VALMER

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 6 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Listed Interest Rate Swap (CME)TIIE FondeoMXN SwapInterest Rate CurveVALMER  
OTC European Index Call Spread OptionOTC European Index Call Spread Option  
MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY Call Spread OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket OptionEquity Index, Common StockMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-FactorCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with  
Target Volatility (Vol Under 15%)MXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source

OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,

EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2

SurfaceTrader's mark

Correlation

Dividend

Bond Futures(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 7 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,  
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER  
FX Rate  
Surface  
Precious Metals European OptionGold/Silver BullionGold/Silver Black 76CurveVALMER  
Price  
SurfaceBloomberg/Reuters  
Precious Metals ForwardGold/Silver BullionGold/Silver Forward OTC ModelCurveVALMER  
Price  
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,  
BRL,CLP,COP,PEN,  
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

Instrumentos valuados a costo

Product NameUnderlyingProduct CurrencyValuation ModelValuation InputDaily Pricing  
Source  
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,  
EUR,JPY PricePriceVALMER

Políticas Líneas de Crédito

Se informa a esa H. Comisión que en el Manual de Políticas de Crédito Cartera Comercial, en su "Manual de Productos y Programas Especiales de Crédito Cartera Comercial, Apartado III Mercado Financiero, 1.1 Operaciones del Banco en el Mercado Financiero" se norman las operaciones del Banco en el Mercado Financiero estableciendo:

Tipos de Operación que son ofrecidos en función al tipo de acreditado

a)Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

- Necesidades de tesorería del Banco
- Relación de corresponsalía
- Límites recíprocos

b)Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

- Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c)Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

- Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

1)Tesorería: Call Money

2)Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

3)Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

4)Cambios: FOREX

5)Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

6)Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

---

---

7) Metales

Sujetos de Crédito

Podrán ser sujetos de crédito en productos de este mercado, los siguientes:

- Integrantes del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
- Instituciones de Crédito, Casas de Bolsa y otras entidades financieras que sean integrantes de un Grupo Financiero, ya sean nacionales o extranjeros.
- Personas Morales y Personas Físicas con actividad empresarial, (nacionales)
- Entidades del Gobierno Federal y del Sector Público

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

- La autorización de Límites se deberá apegar al esquema de Facultades de Crédito vigente, tomando como base su valor equivalente al "Potential Future Exposure".
- La Autorización de Crédito, deberá especificar el tipo de producto y subyacente que se autoriza, quedando prohibida la utilización indistinta de un límite para operar subyacentes diferentes, pero si se deberá indicar los productos a operar.
- Los importes de los Límites Operativos autorizados se podrán establecer tanto en moneda nacional como en dólares de los Estados Unidos de Norteamérica.

- La valuación de los montos ejercidos en límites de productos que no son un financiamiento, pero que conllevan riesgo crediticio, como son los relacionados con Derivados, Valores / Instrumentos Financieros, se realizará con base en el valor de mercado de las operaciones vigentes (Mark to Market), a la fecha que corresponda y el Potential Future Exposure correspondiente.

Idoneidad del Cliente

La celebración de operaciones de productos de Mercado Financiero implica la necesidad de que el Banco cuente con elementos razonables que le garanticen, que:

- El cliente, conoce y comprende los riesgos y beneficios de las operaciones que pretende realizar
- Dichas operaciones concuerdan con las actividades y objetivos de negocio del cliente.

Para tales efectos, en toda Solicitud de línea para este tipo de productos, se deben aplicar las reglas de la Política de Idoneidad del Grupo Scotiabank, que establece los procesos a seguir para la clasificación del riesgo de idoneidad, basado en la complejidad de las operaciones y en el conocimiento/ experiencia que el cliente tenga al respecto. Asimismo, en cada revisión anual se debe evaluar si la clasificación de riesgo de idoneidad del cliente es la misma o ha cambiado desde la última revisión.

Políticas de VaR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las posiciones de derivados de Negociación. El VaR es medido utilizando el primer percentil y reflejando un horizonte temporal de 1 y 10 días, el cual se obtiene a partir de los cambios históricos de los factores de mercado de aquellas variables que afectan directamente el valor de las posiciones. El sistema utilizado para el cálculo del VaR de todos los instrumentos es Risk Watch de la empresa Algorithmics

---

---

y el modelo corresponde a una simulación histórica no paramétrica.

Debido a que la medida VaR sirve para estimar pérdidas potenciales en condiciones normales de mercado, la institución deberá realizar diariamente pruebas bajo condiciones extremas "stress testing" con el objeto de determinar la exposición al riesgo considerando grandes fluctuaciones anormales en los precios de mercado. En adición se cuenta con una estructura de límites principalmente de montos volumétricos o nocionales, de concentración, de sensibilidades y de VaR.

#### b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

##### Cálculo de Sensibilidades

La unidad Riesgo de Mercado (TFRM) es responsable de definir los procedimientos y cálculos necesarios para realizar el análisis de sensibilidad sobre los portafolios de Trading. Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple y eficaz, además de que se puede hacer un seguimiento de manera sencilla de Estados de resultados (P&L). Los cálculos de sensibilidad se realizan diariamente en forma automática, con procedimientos desarrollados por la Dirección de TFRM.

##### Portafolio de Renta Fija (Bonos)

Se estima cual sería el comportamiento del valor del portafolio ante un cambio en las tasas de interés cotizadas en el mercado (curva de rendimientos).

Las sensibilidades del portafolio de instrumentos de renta fija se basan en los conceptos de duración y convexidad y su aplicación dependerá del tipo de instrumento. En todos los casos se producen 2 mediciones; i) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 1 punto base (0.01%) en la curva de rendimiento, y ii) el cambio esperado en el valor del portafolio ante un cambio de 100 puntos base (1%) en la curva de rendimiento.

##### Bonos de Tasa Flotante

En el caso de bonos de tasa flotante la unidad Riesgo de Mercado (TFRM) realiza dos tipos de sensibilidades, la sensibilidad a la tasa libre de riesgos (curva de gobierno o curva mayor) y la sensibilidad a la sobretasa o Spreads, esta metodología asume que un bono de tasa flotante se comporta como la parte flotante de un swap de tasas de interés.

Con metodología se asume que la repreciaación ocurre justamente al pago de cupón.

##### Bonos Cupón Cero

Para el cómputo de la sensibilidad de instrumentos cupón cero, se utiliza el mismo sistema utilizado en instrumentos de tasa fija.

##### Riesgo de Crédito

También se utiliza el concepto de duración, pero en el caso de los instrumentos de

---

---

tasa flotante se utiliza la duración total de instrumento en lugar de la "duración al próximo cupón".

#### Sensibilidad del Pasivo

Gran parte del portafolio de trading de la institución se encuentra fondeado con reportos. Para efectos de determinar cuál es la sensibilidad de la parte corta (el financiamiento) de las posiciones, se determina el cambio del valor del portafolio ante un cambio de 1 (0.01%) y 100 puntos básicos en las tasas de interés (1%).

#### Derivados de Tasas de Interés

##### Swaps de Tasa de Interés

Para efectos de determinar la sensibilidad a cambios en la curva de rendimiento de los Swaps de TIIE, se efectúa un cambio de 1 punto base en cada uno de los puntos relevantes de la curva de rendimientos, además de un cambio de 1 y cien puntos base de forma paralela, valuando el portafolio con las diferentes curvas y calculando cual es el cambio en el valor del portafolio con cada uno de esos cambios.

En el caso de Swaps sobre otro tipo de tasas de interés, lo cual puede incluir CETES y/o Libor, los cálculos se realizan directamente haciendo un shock de 1 y 100 puntos base sobre la curva cupón cero. Todas las transacciones realizadas sobre subyacentes distintos de TIIE están autorizados sólo en una base back to back.

##### Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

##### Futuros de Bono M

Para el cálculo de sensibilidad de estos derivados a la tasa de interés, se utilizan los conceptos de duración y convexidad.

##### Futuros de CETE

El tratamiento de futuros de Cete es análogo al tratamiento de futuros de TIIE.

#### Efectividad De la Cobertura:

Se realizan pruebas y análisis, al inicio de cada operación de cobertura y de manera continua, con base en la comparación de los cambios pasados en el valor razonable o en los flujos de efectivo del instrumento de cobertura con los cambios que hayan experimentado en el pasado el valor razonable o los flujos de efectivo de la posición primaria.

Se considera la valuación del instrumento de cobertura y de la posición primaria bajo 61 escenarios semanales históricos, es decir una ventana de observación mayor a un año con base en un análisis de regresión.

Se determinan los cambios en valuación tanto para el instrumento de cobertura como para la posición primaria (serie de 60 cambios históricos).

---

---

Utilizando un análisis de regresión lineal se determina la correlación existente entre los cambios del instrumento de cobertura y la posición primaria. Las métricas necesarias para determinar que la relación es cobertura eficiente son:

Grado de relación entre los cambios observados:  $R^2 \geq 80\%$ .

Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].

Significancia de la regresión:  $F > 5$ .

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de septiembre 2023 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el tercer trimestre de 2023 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

La afectación en resultados por cambios en el valor de las coberturas se determina como la diferencia que resulta de comparar las variaciones acumuladas del valor de la posición cubierta y el valor del derivado de cobertura desde la fecha de inicio y hasta la fecha actual de valuación. Contablemente, la afectación a resultados por el efecto arriba descrito se reconoce con apego de los requerimientos de la NIF C-10.

Cobertura de Flujos de efectivo:

La porción efectiva de las ganancias o pérdidas del instrumento de cobertura se reconocen dentro de "Otro Resultado Integral" (ORI) y cualquier ganancia o pérdida remanente debe tratarse como ineffectividad de cobertura y reconocerse de inmediato en la utilidad o pérdida neta.

El componente que forma parte de "Otro Resultado Integral" asociado con la posición primaria se ajusta al valor menor (en valor absoluto) entre: la ganancia o pérdida acumulada del instrumento de cobertura; y el cambio acumulado en el valor razonable de la posición cubierta desde el inicio de la operación de cobertura.

Cobertura de Valor Razonable:

La ganancia o pérdida que resulte de valuar el instrumento de cobertura a su valor razonable es reconocida de forma inmediata en los resultados del período en que ocurre.

La ganancia o pérdida que resulte de valuar la posición cubierta atribuible al riesgo cubierto, debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

---

---

En adición a lo arriba descrito, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia, CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.

c. Información de Riesgos por el uso de Derivados

Scotiabank Inverlat asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que el Banco pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que estas se hacen exigibles, para lo cual el Banco aplica controles a las brechas de liquidez, monitorea indicadores clave de liquidez, mantiene fuentes diversificadas de fondeo, establece límites y mantiene un porcentaje mínimo de activos líquidos.

Las exposiciones al riesgo de liquidez son cubiertos desde el punto de vista de fondeo con contrapartes locales, autorizadas; lo cual también está en línea con los límites establecidos.

Al cierre de septiembre de 2023 y promedio del tercer trimestre 2023 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank  
(millones de pesos) Posición  
(Cierre) Posición  
(Promedio)  
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL) 122,949,116,211

Se realizó un análisis de sensibilidad para las operaciones con instrumentos financieros derivados mismo que refleja requerimientos adicionales que pudieran suscitarse por eventualidades en el mercado, lo anterior podría verse reflejado en una pérdida potencial o en salidas de efectivo adicionales para Scotiabank Inverlat.

Para estos efectos el cálculo de la exposición potencial para derivados considera lo siguiente:

Considerando 3 escenarios (probable, posible y de estrés), Scotiabank Inverlat podría tener salidas de efectivo adicionales por posible baja en su calificación crediticia, dado que el colateral entregado sería mayor. Esto en conexión con instrumentos financieros derivados OTC que tengan asociados contratos marco.

La salida/pérdida potencial para los 3 escenarios dada la baja de 3 escalafones en la calificación crediticia del GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat, está dada por:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

En donde:

---



---

 ParámetroDescripción

Salida de efectivo por derivados.

Umbral con la Contraparte i en el estado i

Umbral con la Contraparte i en el estado j

Mark to Market

En adición a lo anterior, se consideró una variación en los precios de los activos subyacentes del 10% para un escenario probable, del 30% para un escenario posible y de 50% para un escenario remoto. Derivado de estas variaciones se obtuvo la pérdida potencial que se tradujo en una salida de efectivo para el GFSBI, al cual pertenece Scotiabank Inverlat.

Considerando ambos elementos, los flujos de salida para los próximos 30 días para Scotiabank Inverlat considerando los 3 escenarios son:

Scotiabank

(millones de pesos)NormalEscenario PosibleEscenario ProbableEscenario de Estrés

Gap 30d Gap Acum72,51369,45569,40769,358

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(3,058)(3,106)(3,155)

d. Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

Las sensibilidades son una de las medidas de riesgos más relevantes utilizadas para analizar los portafolios, dado que permiten comprender el perfil de riesgos del portafolio de una manera simple, eficaz, y a la cual se le puede hacer seguimiento de manera sencilla mediante atribución de P&L. Los cálculos de sensibilidad son realizados de manera diaria.

El cálculo de sensibilidades (o griegas) de opciones listadas sobre el IPyC se basa en el modelo de valoración de opciones Black & Scholes.

Delta

La Delta de una opción se define universalmente como el cambio en el valor de una opción ante un cambio en el valor del subyacente. Delta puede ser expresado en términos porcentuales (delta analítica), en términos de exposición delta, o en términos de riesgo delta.

Delta Analítica (porcentual): Indica qué cantidad de subyacente es necesario mantener para hacer hedge a una opción, ante un cambio en el subyacente, todo esto en términos porcentuales. La delta analítica es por definición un número entre cero y uno y su signo dependerá de si la opción es call o put, además de si la posición es corta o larga. Su cálculo se realiza usualmente de manera analítica, esto es, derivando desde la fórmula de Black & Scholes.

Riesgo delta: Se define como el cambio en el valor de la opción ante un cambio de una magnitud predeterminada en el valor del subyacente (por ejemplo 1%). Su cálculo se realiza valuando la opción con niveles distintos del subyacente (uno original y uno con un shock de +1%), manteniendo todos los demás parámetros constantes.

Exposición Delta: Se define como el monto notional equivalente del subyacente (en

---

---

cantidad) necesario para mantener el valor presente del portafolio inalterado, ante un cambio de +1% en el valor del subyacente.

#### Gamma

El riesgo gamma es complementario al riesgo delta, y es otra medida de sensibilidad del valor de una opción con respecto al valor de un subyacente. Gamma mide la tasa de cambio de la delta ante un cambio en el nivel del subyacente, y análogo al cálculo de delta, puede ser interpretada de manera analítica, como la segunda derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al subyacente.

Tal como es el caso de la medición de otras griegas para derivados, los cálculos de medición de riesgos no se realizan de manera analítica, sino que se obtiene directamente valuando el portafolio. Actualmente se realizan dos mediciones de riesgo gamma, denominadas  $\gamma_{1\%}$  y  $\gamma_{5\%}$ .

$\gamma_{1\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que  $\gamma_{5\%}$  mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio ante un cambio de 5% en el valor del subyacente. Ambas mediciones cuentan con límites de riesgos.

#### Vega

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente, vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

Se define el riesgo Vega como el cambio en el valor del portafolio de opciones ante un cambio de +1% en la volatilidad implícita del portafolio.

#### Rho

Rho es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones a cambios en la tasa de interés. Matemáticamente hablando RHO es la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto a la tasa de interés. En general, la sensibilidad de un portafolio de opciones a la tasa de interés es menor comparada con la sensibilidad al precio del subyacente (delta) o de las volatilidades implícitas (vega).

RHO es entonces definida como el cambio en el valor de un portafolio de opciones, ante un incremento de 100 puntos básicos (+1%) en las tasas de interés.

#### Theta

Theta es la medida de sensibilidad de un portafolio de opciones que indica el cambio en el valor del portafolio ante el paso del tiempo. Analíticamente, Theta puede ser expresado como la primera derivada parcial de la función de Black & Scholes con respecto al tiempo.

Theta es calculada mediante el procedimiento de valuación completa (tal como es el caso de las otras griegas) en lugar de analíticamente, sólo con fines informativos y de atribución de P&L.

#### Dividend Risk

---

La valoración de opciones sobre índices o acciones supone una tasa de dividendos compuesta continua conocida. Los dividendos, sin embargo, son una estimación y por tanto una variable desconocida, representando un factor de riesgos para la valuación y el consiguiente P&L de las operaciones con opciones.

El riesgo de dividendos no tiene una letra "griega" asociada a su sensibilidad, y en el caso de opciones sobre índices y acciones. La medición se realiza por la vía de incrementar un 1% (i.e. desde 1% a 1.01%) la tasa de dividendos.

## II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

### a. Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Tasa

Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a septiembre 30, 2023:

Scotiabank

0-3 Meses 3 - 12 Meses 1 - 3 Años 3 - 5 Años 5 - 10 Años 10 - 30 Años Total

Swaps (113,268.00) (50,839.00) 97,760.00 359,483.00 20,265.00 (18,899.00) 294,502.00

CCS 5.00 (17.00) (46.00) 94.00 214.00 (12.00) 238.00

Caps&Floors (300.00) 3,713.00 2,513.00 (352.00) 2.000.00 5,576.00

Binary Caps&Floors-----

TIIE Futures-----

Mbonds Futures-----

Total DERIVADOS (113,563.00) (47,143.00) 100,227.00 359,225.00 20,481.00 (18,911.00)

300,316.00

1). Cifras expresadas en pesos

### Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

Para los derivados de tasa de interés como son los futuros de TIIE, Bonos M, Cap&Floor el método para calcular las sensibilidades es bajo el supuesto de bajar 1 punto base la curva Par de tasas de interés (IRS) que se proporciona nuestro proveedor de precios Valmer.

Para el caso de derivados de FX tanto de Forwards como de opciones, la sensibilidad o delta estimada es en base al tipo de cambio, de tal manera que para calcular un escenario potencial de P&L se tiene que multiplicar este valor por el movimiento porcentual del tipo de cambio.

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (190.87) Millones de pesos.
- b) Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (381.74) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (918.98) Millones de pesos.

Los escenarios de stress están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de -10%, -30% y -50% para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable  
Shock (+/-) P&L Stress 1

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2023

SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 16 / 25

CONSOLIDADO

Impresión Final

Shock(+/-)P&LStress 2  
Shock(+/-)P&L  
- lpb a la tasaFuturos de TIIE  
y Bono M - - 50.00 - 100.00 - 200.00 -  
- lpb a la tasaIRS & CCS & Delta Caps0.3028.2750.00(15.02)100.00(30.03)200.00  
(60.06)  
Volatilidad al 1%Caps & Floors(0.03)(0.97)0.10 - 0.40(0.01)1.00(0.03)  
a FX %Forwards87.261,568.560.10(156.86)0.20(313.71)0.50(784.28)  
a FX %Opciones Divisa - - 0.10 - 0.20 - 0.50 -  
Total(171.88)(343.75)(844.37)

b.Análisis de Sensibilidades del Portafolio de Operaciones Derivadas de Equity.

En el siguiente cuadro encontrarán el resumen de las operaciones derivadas de los portafolios de Bonos estructurados con sus respectivas sensibilidades al 30 de septiembre de 2023 (la sensibilidad de las mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo esta cerrado).

OpcionesDeltaVegaGamma  
Options AAPL.OQ---  
Options BNPUI5.INDX152,351.005,548.0038,930.00  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options IDBTV1.INDX92,417.002,306.0024,343.00  
Options META.OQ---  
Options MSFDV1.INDX---  
Options QQQ.OQ---  
Options SOXX.OQ---  
Options SPXSR5.INDX---  
Options VLO.N---  
TOTAL244,768.007,854.0063,273.00  
1).Cifras expresadas en pesos

Análisis de Stress

Los escenarios de stress a la baja; probable -10%, poco probable -30% y muy poco probable -50% son los siguientes:

Escenarios a la baja(0.1)(0.3)(0.5)  
Options AAPL.OQ---  
Options BNPUI5.INDX(15,235.10)(45,705.30)(76,175.50)  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 17 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX(9,241.70) (27,725.10) (46,208.50)  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
TOTAL(24,476.80) (73,430.40) (122,384.00)  
1).Cifras expresadas en pesos

Los escenarios de stress al alza; probable 5%, poco probable 15% y muy poco probable 20% son los siguientes:

Escenarios al alza(0.1) (0.3) (0.5)  
Options AAPL.OQ---  
Options BNPUI5.INDX7,617.5522,852.6530,470.20  
Options EEM.P---  
Options ENHFO5.INDX---  
Options ENHGE5.INDX---  
Options FXI.P---  
Options GLD.P---  
Options GOOG.OQ---  
Options ICLN.OQ---  
Options MEXIBX.INDX4,620.8513,862.5518,483.4  
Options MXSXAE.INDX---  
Options HSCE.INDX---  
Options MEXXLK.USM---  
Options IBM.USM---  
Options SBUX.USM---  
Options IBM.USM---  
TOTAL12,238.4036,715.2048,953.60  
1). Cifras expresadas en pesos

Y están basados en el movimiento que pudieran tener el subyacente de (10%), (30%) y (50%) para escenarios a la baja y de 5% ,15% y 20% de escenarios al alza.

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

ScotiabankMonto  
Probable(24,476.80)  
Poco Probable(73,430.40)  
Muy poco Probable(122,384.00)  
1).Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar las llamadas de margen que se hayan presentado durante el trimestre

---

# BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 18 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

Respecto a las llamadas de margen, al 30 de septiembre de 2023 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	MXN	366,000,000	(175,000,000)
CLIENTE 2	MXN	216,300,000	(54,000,000)
CLIENTE 3	MXN	21,600,000	(11,200,000)
CLIENTE 4	MXN	317,795,280	(224,100,000)
CLIENTE 5	USD	75,060,000	(41,200,000)
CLIENTE 6	USD	45,990,000	(17,250,000)
CLIENTE 7	USD	213,500,000	(335,900,000)
CLIENTE 8	USD	-	(830,000)
CLIENTE 9	USD	3,590,000	(6,830,000)
CLIENTE 10	USD	43,500,000	(27,640,000)
CLIENTE 11	MXN	41,100,000	(68,200,000)
CLIENTE 12	MXN	414,300,000	(217,800,000)
CLIENTE 13	MXN	454,800,000	(198,000,000)
CLIENTE 14	MXN	322,500,000	(277,776,432)
CLIENTE 15	MXN	2,000,000	-
CLIENTE 16	USD	8,300,000	-
CLIENTE 17	USD	120,000	(840,000)
CLIENTE 18	MXN	-	(33,200,000)
CLIENTE 19	USD	21,520,000	(13,230,000)
CLIENTE 20	USD	-	(1,300,000)
TOTAL		2,567,975,280	(1,704,296,432)

1).Cifras expresadas en pesos

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre y de aquéllos cuya posición haya sido cerrada.

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 19 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 20 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---



BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 21 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 22 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 23 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 24 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Liquidados anticipadamente

---

BOLSA MEXICANA DE VALORES, S.A.B. DE C.V.

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2023**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,  
INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE,  
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK  
INVERLAT**

**INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS**

PAGINA 25 / 25

**CONSOLIDADO**

**Impresión Final**

---

Revelación de cualquier incumplimiento que se haya presentado en los contratos respectivos

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados  
Cifras expresadas en pesos

VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF

---