



ANEXO
Scotiabank Inverlat

INFORMACIÓN FINANCIERA

SCOTIABANK INVERLAT

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros	T3 2023	T4 2023	T1 2024	T2 2024	T3 2024
ROE (Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)	14.8%	14.2%	13.1%	11.5%	13.9%
ROA (Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)	1.5%	1.4%	1.3%	1.1%	1.3%
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.3%	3.1%	3.0%	2.9%	3.0%
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	2.1%	2.2%	2.0%	2.1%	2.0%
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	4.0%	3.3%	3.4%	3.6%	3.9%
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.)	79.8%	77.4%	76.9%	76.8%	72.4%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	22.60%	21.47%	22.01%	22.44%	22.61% ¹⁾
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	17.07%	15.99%	16.64%	17.08%	17.75% ¹⁾
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	49.0%	47.2%	44.4%	46.9%	46.8%

¹⁾. Sujeto a aprobación de Banco Central

La utilidad neta al cierre del tercer trimestre alcanza \$2,947 millones, un incremento de \$11 millones respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores ingresos totales; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; así como mayores gastos de administración y promoción. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta mostró un incremento de \$587 millones o 25%, debido principalmente a mayores ingresos totales y una gestión eficiente de los gastos de administración y promoción.

La utilidad neta acumulada al cierre de septiembre de 2024 se ubicó en \$7,917 millones, una disminución de \$534 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales y menores impuestos. En el periodo el PTPP creció 12%, impulsado por mayores ingresos en el margen financiero y comisiones y tarifas (netas).

Scotiabank-Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2023	30-sep 2024	A/A Δ%
Ingresos por intereses	19,984	21,043	21,130	6%	57,994	63,013	9%
Gastos por intereses	(13,250)	(14,079)	(13,980)	6%	(38,101)	(42,124)	11%
Margen Financiero	6,734	6,964	7,150	6%	19,893	20,889	5%
Comisiones	1,044	1,301	1,405	35%	3,267	3,820	17%
Resultado por Intermediación	430	467	541	26%	1,553	1,764	14%
Otros ingresos/egresos de la operación	273	87	225	-18%	763	524	-31%
Ingresos no Financieros	1,747	1,855	2,171	24%	5,583	6,108	9%
Total Ingresos	8,481	8,819	9,321	10%	25,476	26,997	6%
Gastos de Administración y Promoción	(4,096)	(4,467)	(4,348)	6%	(12,810)	(12,868)	0%
PTPP ¹⁾	4,385	4,352	4,973	13%	12,666	14,129	12%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(574)	(1,316)	(1,203)	>+100%	(1,006)	(3,553)	>+100%
Resultado de la Operación	3,811	3,036	3,770	-1%	11,660	10,576	-9%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	285	37	0%	168	168	0%
Resultado antes de Impuestos a la Utilidad	3,811	3,321	3,807	0%	11,828	10,744	-9%
Impuestos a la Utilidad	(875)	(961)	(860)	-2%	(3,377)	(2,827)	-16%
Resultado Neto	2,936	2,360	2,947	0%	8,451	7,917	-6%
Otros Resultados Integrales							
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	(489)	(253)	(253)	-48%	(407)	16	>-100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	831	361	361	-57%	624	(245)	>-100%
Remediación de beneficios definidos a los empleados	20	4	4	-80%	25	22	-12%
Participación en ORI de otras entidades	-	9	9	0%	-	9	0%
Resultado Integral	3,298	2,481	3,068	-7%	8,693	7,719	-11%

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

MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de \$7,150 millones al cierre del tercer trimestre de 2024, un incremento de \$416 millones o 6% respecto al mismo trimestre del año pasado, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria y sin garantía; compensados parcialmente con mayores volúmenes en depósitos de exigibilidad inmediata.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$186 millones o 3%; principalmente por mayores volúmenes de cartera hipotecaria y automotriz; así como una mejora en la mezcla de depósitos.

El margen financiero acumulado al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$20,889 millones, un incremento de \$996 millones o 5% respecto al mismo periodo de 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria y un día más de operación; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de \$2,171 millones en el tercer trimestre de 2024, un incremento de \$424 millones o 24% respecto al mismo periodo del año pasado, debido a mayores ingresos por comisiones y tarifas netas en colocación de créditos, operaciones de crédito, cartas de crédito, avalúos y manejo de cuenta; así como mayores ingresos por intermediación principalmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de \$316 millones o 17%, debido a mayores ingresos por comisiones y tarifas pagadas por colocación de créditos, menores egresos por quebrantos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación; así como mayores ingresos en resultados por intermediación principalmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros; compensada parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$6,108 millones, un incremento de \$525 millones o 9% respecto al año pasado debido a mayores ingresos en comisiones y tarifas netas principalmente en operaciones de crédito, avalúos, manejo de cuenta, colocación de créditos y cartas de crédito; así como mayores ingresos por intermediación; compensados parcialmente por mayores aportaciones al IPAB y quebrantos (ambos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación). Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en mercado cambiario e inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2024	30-sep 2024	A/A Δ%
Aceptaciones por Cuenta de Terceros	-	1	1	0%	2	2	0%
Actividades Fiduciarias	53	57	44	-17%	166	158	-5%
Apertura de Cuenta	6	5	5	-17%	17	14	-18%
Cartas de Crédito	34	67	78	>+100%	170	226	33%
Cheques Certificados	1	-	1	0%	2	2	0%
Cheques de caja	-	-	-	0%	1	-	-100%
Compraventa de instrumentos financieros	(1)	1	2	>-100%	2	4	100%
Manejo de Cuenta	83	106	111	34%	248	323	30%
Operaciones de Crédito	403	512	509	26%	1,181	1,416	20%
Otras Comisiones y Tarifas	395	373	469	19%	1,259	1,139	-10%
Servicios de Banca Electrónica	45	154	158	>+100%	141	461	>+100%
Transferencia de Fondos	25	25	27	8%	78	75	-4%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	1,044	1,301	1,405	35%	3,267	3,820	17%

Scotiabank- Otros Ingresos/Egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2023	30-sep 2024	A/A Δ%
Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas	9	(5)	(6)	>-100%	21	3	-86%
Aportaciones al IPAB	(551)	(603)	(591)	7%	(1,626)	(1,776)	9%
Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo	8	6	14	75%	52	26	-50%
Donativos	-	(1)	(3)	0%	-	(4)	0%
Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados	18	(13)	13	-28%	54	8	-85%
Ingresos por Arrendamiento	11	13	12	9%	33	37	12%
Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados	53	59	62	17%	150	177	18%
Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación	782	724	725	-7%	2,263	2,200	-3%
Pérdida por venta de cartera de crédito	-	(2)	(2)	0%	-	(4)	0%
Quebrantos	(73)	(159)	(45)	-38%	(211)	(309)	46%
Recuperaciones	3	3	-	-100%	14	3	-79%
Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo	13	-	1	-92%	13	1	-92%
Utilidad por venta de cartera de crédito	-	2	15	0%	-	19	0%
Resultado por adjudicación de bienes	-	63	30	0%	-	143	0%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	273	87	225	-18%	763	524	-31%

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el tercer trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios ascendió a \$1,203 millones, un incremento de \$629 millones respecto al mismo periodo del año pasado. El incremento se debe principalmente a mayores volúmenes en la cartera de vivienda, consumo y automotriz, así como los requerimientos de reservas asociados a cartera en etapa 3.

Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de \$113 millones o 9%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera comercial debido a la gestión de riesgo. La mayoría de las provisiones se concentraron en la cartera de consumo y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$3,553 millones, un incremento de \$2,547 millones respecto al acumulado del año anterior. Este incremento fue impulsado por mayores volúmenes en cartera de tarjeta de crédito, automotriz y consumo, así como por la acumulación de cartera de vivienda en etapa 3.

Scotiabank – Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2023	30-sep 2024	A/A Δ%
Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(574)	(1,316)	(1,203)	> +100%	(1,006)	(3,553)	> +100%

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,348 millones en el tercer trimestre de 2024, un incremento de \$252 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, debido principalmente a mayores gastos por compensación variable.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$119 millones o 3%, debido principalmente a menores honorarios.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendieron a \$12,868 millones, un incremento anual de \$58 millones, debido principalmente a mayores gastos de promoción y publicidad, IVA, procesadores, operación de tarjetas de crédito y amortizaciones; compensados parcialmente por una menor compensación variable.

Scotiabank – Gastos de Administración y Promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2023	30-sep 2024	A/A Δ%
Gastos de Personal	(1,799)	(2,097)	(2,094)	16%	(6,167)	(5,959)	-3%
Gastos de Operación	(2,297)	(2,370)	(2,254)	-2%	(6,643)	(6,909)	4%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,096)	(4,467)	(4,348)	6%	(12,810)	(12,868)	0%

IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el tercer trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de \$860 millones, una disminución de \$15 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una disminución en los gastos no deducibles del trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$101 millones u 11%, principalmente por una mayor inflación compensada por una mayor utilidad en el trimestre.

Los impuestos netos acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendieron a \$2,827 millones, una disminución anual de \$550 millones o 16%, principalmente por una menor utilidad y una mayor inflación en el periodo.

Scotiabank – Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses				9 meses		
	30-sep 2023	30-jun 2024	30-sep 2024	A/A Δ%	30-sep 2023	30-sep 2024	A/A Δ%
Impuesto a la Utilidad Causado	(1,103)	(1,654)	(1,453)	32%	(3,044)	(3,817)	25%
Impuesto a la Utilidad Diferido	228	693	593	>+100%	(333)	990	>-100%
Total de Impuestos a la Utilidad	(875)	(961)	(860)	-2%	(3,377)	(2,827)	-16%

BALANCE GENERAL

Al 30 de septiembre de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$877,880 millones, un incremento de \$74,668 millones o 9% respecto al cierre de septiembre de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental), inversiones en instrumentos financieros derivados y deudores por reporto; compensados parcialmente por menores volúmenes de efectivo y equivalentes de efectivo.

Los activos totales incrementaron \$8,139 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en cartera de crédito total e instrumentos financieros derivados, compensados parcialmente por menores deudores por reporto.

El total del pasivo registró \$791,475 millones al 30 de septiembre de 2024, un incremento de \$69,386 millones o 10% respecto al cierre de septiembre de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (instrumentos financieros derivados, acreedores por liquidación de operaciones y valores asignados por liquidar).

El pasivo total incrementó \$5,401 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en otros pasivos (instrumentos financieros derivados y valores asignados por liquidar); compensados parcialmente por menores volúmenes en depósitos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores	275,547	304,283	299,778	9%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	479,687	500,968	507,211	6%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	19,791	18,562	20,398	3%
Partidas diferidas	2,899	3,429	3,694	27%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,793)	(14,252)	(14,762)	-7%
Otros Activos	41,081	56,751	61,561	50%
Total Activo	803,212	869,741	877,880	9%
Depósitos	530,579	568,429	554,321	4%
Préstamos Bancarios y de Otros Organismos	30,451	35,278	40,269	32%
Obligaciones Subordinadas en Circulación	9,102	9,057	9,104	0%
Otros Pasivos	151,957	173,310	187,781	24%
Total Pasivo	722,089	786,074	791,475	10%
Capital	81,123	83,667	86,405	7%
Total Pasivo y Capital	803,212	869,741	877,880	9%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de septiembre de 2024 alcanzó \$274,578 millones, un incremento anual de \$35,078 millones o 15% y de \$8,021 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de septiembre de 2024 se ubicó en \$232,633 millones, una disminución anual de \$7,554 millones y \$1,778 millones respecto al trimestre anterior. La disminución anual y trimestral se debió principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial.

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	34,424	41,858	44,575	29%
Créditos a la Vivienda	205,076	224,699	230,003	12%
Total Préstamos de Menudeo	239,500	266,557	274,578	15%
Actividad Empresarial o Comercial	200,356	196,584	185,090	-8%
Entidades Financieras	24,931	17,695	24,157	-3%
Entidades Gubernamentales	14,900	20,132	23,386	57%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	240,187	234,411	232,633	-3%
Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2	479,687	500,968	507,211	6%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 30 de septiembre de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$20,398 millones, un incremento anual y trimestral de \$607 millones o 3% y de \$1,836 millones o 10% respectivamente.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 30 de septiembre de 2024 se ubicó en \$14,762 millones, una disminución anual de \$1,031 millones o 7% y un incremento trimestral de \$510 millones o 4%.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 72.4% al 30 de septiembre de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 743pb y 441pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 30 de septiembre de 2024 fue de 3.9%, una disminución de 9pb respecto del año anterior y un incremento de 30pb respecto al trimestre pasado.

Scotiabank - Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024	A/A Δ%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3	19,791	18,562	20,398	3%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,793)	(14,252)	(14,762)	-7%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta	3,998	4,310	5,636	41%
Índice de morosidad	4.0%	3.6%	3.9%	-9 pb

DEPÓSITOS

El total de depósitos registró \$554,321 millones al 30 de septiembre de 2024, un incremento anual de \$23,742 millones o 4%, debido a mayores volúmenes en depósitos de vista y ahorro y títulos de crédito emitidos; compensados parcialmente por un menor volumen en mercado de dinero.

Respecto al trimestre inmediato anterior los depósitos disminuyeron \$14,108 millones o 2%, debido a menores volúmenes de depósitos a plazo y de vista y ahorro; compensados parcialmente por mayores títulos de crédito emitidos

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	269,967	299,048	290,768	8%
Público en General	207,459	222,127	207,471	0%
Mercado de Dinero	41,217	25,282	25,263	-39%
Total Depósitos a Plazo	248,676	247,409	232,734	-6%
Títulos de Crédito Emitidos	10,677	20,588	29,350	>+100%
Cuenta global de captación sin movimientos	1,259	1,384	1,469	17%
Total de Depósitos	530,579	568,429	554,321	4%

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN

Al 30 de septiembre de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,104 millones, sin cambios significativos respecto al cierre de septiembre 2023 y junio 2024.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024 valor razonable)					
Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	72,540	2,354	9	49	74,952
Sin restricción:	-	-	9	49	58
Restringidos:	72,540	2,354	-	-	74,894
En operaciones de reporto	54,323	2,354	-	-	56,677
Préstamos de valores	-	-	-	-	-
Otros	18,217	-	-	-	18,217
Instrumentos financieros para cobrar o vender	78,358	20,963	-	1,445	100,766
Sin restricción:	77,868	20,963	-	1,445	100,276
Restringidos:	490	-	-	-	490
En operaciones de reporto	-	-	-	-	-
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	490	-	-	-	490
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	5,053	-	-	-	5,053
Sin restricción	5,053	-	-	-	5,053
Total	155,951	23,317	9	1,494	180,771

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

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BANSAN_24403	14,908,650,295	10.9%	2	14,900

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

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	9,227	9,098	-	-	1,363	1,031	245	460	33,721	33,693	-	-	44,556	44,282
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	15,322	16,059	-	-	15,322	16,059

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

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

Con fines de negociación

Posición USD	7,081	7,704	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	151	186	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	71	71	555	553	-	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	1	1	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	50	50	-	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	-	-	822	822	-	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	3	3	5	-	-	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	187	2,444	4,159	1,870	-	-	-	-	-
Tasa de interés													
Pesos	-	-	-	-	-	-	28,687	28,496	600,980	604,701	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	776	776	9,468	9,513	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	8	-	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-	-

Con fines de cobertura

Tasa de interés													
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	82,744	580	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	618	967	-	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	128,429	56,326	-	184,755
Créditos a entidades financieras	22,936	1,221	-	24,157
Créditos a entidades gubernamentales	14,226	9,160	-	23,386
Créditos al consumo	43,406	-	-	43,406
Créditos a la vivienda	225,827	2	38	225,867
Total	434,824	66,709	38	501,571

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	335	-	-	335
Créditos al consumo	1,169	-	-	1,169
Créditos a la vivienda	4,130	4	2	4,136
Total	5,634	4	2	5,640

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	6,174	1,664	-	7,838
Créditos a entidades financieras	56	-	-	56
Créditos al consumo	1,083	-	-	1,083
Créditos a la vivienda	11,388	28	5	11,421
Total	18,701	1,692	5	20,398

Scotiabank-Variaciones Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos)	
Saldo al 30 de junio de 2024	18,562
Reestructuras	158
Recuperaciones	(409)
Castigos y quitas	(859)
Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 3	2,826
Fluctuación Tipo Cambio	120
Saldo al 30 de septiembre de 2024	20,398

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)	
Saldo al 30 de junio de 2024	14,252
Más: Creación de reservas	29
Calificación	1,280
Menos: Adjudicaciones y otros	80
Castigos y quitas	867
Comercial	1
Hipotecario	120
Consumo	746
Desliz cambiario	(148)
Saldo al 30 de septiembre de 2024	14,762

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

	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2			
Metropolitano	66.0%	70.7%	71.5%
Noroeste – Centro	9.9%	8.5%	8.3%
Norte	12.3%	10.5%	10.4%
Bajío	6.7%	5.9%	5.6%
Sur	5.1%	4.4%	4.2%
Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3			
Metropolitano	54.3%	58.8%	58.0%
Noroeste – Centro	15.8%	13.6%	12.7%
Norte	5.7%	5.5%	8.4%
Bajío	12.2%	12.6%	12.2%
Sur	12.0%	9.5%	8.7%

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

Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				Total Reservas Preventivas
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	459,307	935	133	482	339	1,889
Riesgo A2	55,873	523	49	225	17	814
Riesgo B1	10,282	109	56	71	16	252
Riesgo B2	7,988	41	87	38	47	213
Riesgo B3	3,325	4	29	39	40	112
Riesgo C1	3,745	20	75	83	56	234
Riesgo C2	4,054	6	47	121	270	444
Riesgo D	10,502	1,203	80	371	1,575	3,229
Riesgo E	10,496	3,888	716	333	2,515	7,452
Total	565,572	6,729	1,272	1,763	4,875	14,639
Exceso						123
Reservas Constituidas						14,762

NOTAS:

- Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 30 de septiembre de 2024.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$	-
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)		48
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3		3
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores		72
Total	\$	123

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

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

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	1,961	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	11,209,692	1,961	

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	5,192	1,067
Pagos anticipados	(506)	(104)
Comisiones cobradas por anticipado	(388)	(80)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	847	165
Plan de pensiones	1,116	228
Provisiones y otros	918	134
Otros	41	102
Efecto Neto en Diferido	7,220	1,512

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

Scotiabank-Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	4,267	2,615	-	6,882
Largo	-	-	14,083	4,132	-	18,215
Total	-	-	18,350	6,747	-	25,097
Tasa Promedio	0.00%	0.00%	12.51%	10.53%	0.00%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	8,895	-	10	362	-	9,267
Largo	1,990	-	2,954	961	-	5,905
Total	10,885	-	2,964	1,323	-	15,172
Tasa Promedio	5.45%	0.00%	6.16%	5.81%	0.00%	
Total Préstamos Interbancarios	10,885	-	21,314	8,070	-	40,269

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 2024.

Scotiabank-Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 sep 2023	30 jun 2024	30 sep 2024
Depósitos a la Vista	52.2%	54.8%	55.7%
Metropolitano	25.6%	29.7%	31.1%
Noroeste – Centro	8.8%	7.8%	7.3%
Norte	7.5%	7.3%	7.0%
Bajío	4.8%	4.8%	5.2%
Sur	5.5%	5.2%	5.1%
Depósitos Ventanilla	39.9%	40.6%	39.5%
Metropolitano	16.5%	15.4%	13.7%
Noroeste – Centro	4.4%	4.6%	4.8%
Norte	6.6%	8.2%	7.8%
Bajío	6.3%	7.3%	7.3%
Sur	6.1%	5.1%	5.9%
Total de Captación del Público	92.1%	95.4%	95.2%
Fondeo Profesional	7.9%	4.6%	4.8%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional Tasa Promedio (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	6.35%	2.73%
Depósitos a plazo	10.05%	0.00%

Scotiabank-Resultados por Intermediación (millones de pesos)

	30 sep 2024
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(2,793)
Resultado por valuación de divisas	2,930
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	303
Resultado por compraventa de divisas	1,378
Costos de transacción	(51)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(3)
Total	1,764

EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

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

	Cuarta*	**Primera	**Segunda	**Tercera	**Cuarta	**Quinta
Clave de Pizarra	SCOTIAB 23	SCOTIAB 24	SCOTIAB 24-2	SCOTIAB 24V	SCOTIAB 24D	SCOTIAB 24-3
Monto de la Emisión	\$7,125 millones	\$5,189 millones	\$4,811 millones	\$4,325 millones	"\$24 millones usd / \$472 millones MXN	\$3,970 millones
Fecha de Emisión y Colocación	18 agosto 2023	26 febrero 2024	26 febrero 2024	13 sep 2024	13 sep 2024	13 sep 2024
Plazo de Vigencia de la Emisión	927 días, aprox. 2.5 años	1,095 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años	1,095 días, aprox. 3 años	1,092 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	TIIIE28+0.04	Fondeo+0.32%	9.24%	Fondeo+0.32%	3.46+0.84%	9.89%
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018.

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

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe (\$)	Tasa (%)
18-diciembre-14	05-diciembre-24	MXOQSC1N0016	3,640	2,093,000,000	7.4
28-junio-18	09-junio-33	MXOQSC1N0024	5,460	3,360,000,000	12.3
11-septiembre-18	Perpetua	MXOQSC1N0032	-	3,455,000,000	11.3
Total de Obligaciones Subordinadas				8,908,000,000	

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto MXN
99_SCOTIAB_9-21	3,753,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	375,320,000
99_SCOTIAB_10-21	3,719,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	371,925,000
99_SCOTIAB_1-22	533,200	28-feb-22	25-feb-25	1093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_5-22	1,238,860	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6-22	1,795,500	15-jun-22	13-jun-25	1094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7-22	793,540	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8-22	1,027,150	16-jun-22	13-jun-25	1093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11-22	5,528,250	17-nov-22	14-nov-25	1093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	552,825,000
99_SCOTIAB_12-22	457,550	18-nov-22	14-nov-25	1092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13-22	104,500	23-nov-22	21-nov-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14-22	753,800	19-dic-22	17-dic-25	1094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	75,380,000
99_SCOTIAB_2-23	5,542,850	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	554,285,000
99_SCOTIAB_3-23	353,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	35,360,000
83_SCOTIAB_4-23	146,267	21-nov-23	15-nov-24	360	S&P 500 Index (SPX)	14,626,700
99_SCOTIAB_5-23	2,529,850	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	252,985,000
99_SCOTIAB_6-23	1,576,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	157,660,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
83_SCOTIAB_1-24	1,661,850	27-mar-24	05-nov-24	223	Dólar - Peso (USDMXN)	166,185,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2024						3,199,721,700

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto USD
99_SCOTIAB 2-24D	25,000	19-jul-24	14-jul-27	1090	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	2,500,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2024						2,500,000

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

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

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

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

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

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

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

- a) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 1 al 24 de octubre de 2023, y que no cuenten con días de atraso, no presentaron clave de observación alguna en las SIC.
- b) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 2 al 24 de octubre de 2023, y que cuenten con días de atraso, presentaron la clave de observación RA en las SIC.
- c) Los créditos registrados contablemente como cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 con posterioridad al 24 de octubre de 2023, presentaron la clave de observación RA en las SIC.

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

Aplicación del programa OTIS

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

a) CrediAuto

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

b) Hipotecario

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

c) Préstamo personal y préstamo de nómina

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

d) ScotiaLine

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

e) Tarjetas de crédito

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

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

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

30 sep 2024

	Saldo con CCE OTIS	Efectos en Cartera y Estimación	Saldo sin CCE OTIS
Cartera comercial	\$ 232,298	-	232,298
Créditos de consumo	43,406	6	43,412
Créditos a la vivienda:	225,867	39	225,906
Etapa 1	\$ 501,571	45	501,616
Cartera comercial	335	-	335
Créditos de consumo	1,169	1	1,170
Créditos a la vivienda:	4,136	6	4,142
Etapa 2	\$ 5,640	7	5,647
Cartera comercial	7,894	-	7,894
Créditos de consumo	1,083	(7)	1,076
Créditos a la vivienda:	11,421	(45)	11,376
Etapa 3	\$ 20,398	(52)	20,346
Cartera de crédito	\$ 527,609	-	527,609
(+/-) Partidas diferidas	\$ 3,694	-	3,694
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios	\$ (14,762)	(7)	(14,769)
Total cartera de crédito, neta	\$ 516,541	(7)	516,534
Total activos	\$ 877,880	(7)	877,873
Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados)	\$ (3,553)	(7)	(3,560)
Resultado neto	\$ 7,917	(7)	7,910
Total capital contable	\$ 86,405	(7)	86,398
Total pasivo y capital contable	\$ 877,880	(7)	877,873

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 2024)

Referencia	Capital común de nivel 1 (CET1): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente	13,468
2	Resultados de ejercicios anteriores	54,989
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	17,939
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	86,396
Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios		
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	1,944
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)	1,533
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	7,634
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	6,792
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	842
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 1	11,111
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	75,285
Capital adicional de nivel 1: instrumentos		
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,484
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,484
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital adicional de nivel 1	-
34	Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)	No aplica
35	del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
36	Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios	3,484
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios		
37 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de nivel 1	No aplica
39 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera de alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde las Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
40 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
41	Ajustes regulatorios nacionales	-
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1	-
44	Capital adicional de nivel 1 (AT1)	3,484
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	78,770
Capital de nivel 2: instrumentos y reservas		
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	3,477

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	Reservas	72
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	3,549
Capital de nivel 2: ajustes regulatorios		
52	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54	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	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-
58	Capital de nivel 2 (T2)	3,549
59	Capital total (TC = T1 + T2)	82,319
60	Activos ponderados por riesgo totales	463,647
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.24%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	16.99%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	17.75%
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)	19.34%
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)	9.24%
Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)		
69	Razón mínima nacional de CET1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
70	Razón mínima nacional de T1 (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
71	Razón mínima nacional de TC (si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)	No aplica
Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)		
72	Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financieras	No aplica
73	Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
74	Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	No aplica

75	Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
----	--	---

Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2

76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	72
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	4,228
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología de calificaciones internas (previo a la aplicación de límite)	-
79	Límite en la inclusión de reservas en el capital de nivel 2 bajo la metodología de calificaciones internas	-

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

80	Límite actual de los instrumentos de CET1 sujetos a eliminación gradual	No aplica
81	Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	No aplica
82	Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual	-
83	Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-
84	Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual	-
85	Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)	-

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

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

	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
12*	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*	El monto de la inversión en cualquier acción propia que:
	la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido.
17*	Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
19*	Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

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

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

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

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

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
Activo		
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	42,491
BG2	Cuentas de Margen	2,104
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	180,771
BG4	Deudores por reporto	14,052
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	59,878
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(277)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	516,541
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	38,545
BG11	Bienes adjudicados (neto)	831
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,628
BG13	Inversiones permanentes	4,918
BG14	Activos de larga duración mantenidos para la venta	13
BG15	Impuestos a la utilidad diferidos (neto)	7,160
BG16	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	1,981
	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,504
	Activos Intangibles (neto)	4,674
Pasivo		
BG17	Captación tradicional	554,455
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	40,269
	Valores Asignados por liquidar	21,099
BG19	Acreedores por reporto	56,687
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	-
BG22	Instrumentos financieros derivados	60,341
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-

BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	38,215
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	-
BG27	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	1,192
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,246
	Pasivos por arrendamiento	1,684
	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	9,104
	Pasivos por Beneficio a los Empleados	7,118
Capital contable		
BG29	Capital contribuido	13,468
BG30	Capital ganado	72,936
Cuentas de orden		
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	327,895
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	498,324
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	82,429
BG37	Colaterales recibidos por la entidad	20,017
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	-
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,985
BG41	Otras cuentas de registro	2,777,580

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 2024)

Identificador	Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital Neto	Referencia del formato de revelación de la integración de capital del apartado I del presente anexo	Monto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto	Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia mencionada
ACTIVO				
1	Crédito mercantil	8	-	
2	Otros Intangibles	9	-	
3	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales	10	1,944	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,944
4	Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización	13	-	
5	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
6	Inversiones en acciones de la propia institución	16	-	
7	Inversiones recíprocas en el capital ordinario	17	-	

8	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18	-	
9	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido	18		
10	Inversiones directas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19	-	
11	Inversiones indirectas en el capital de entidades financieras donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	19		
12	Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de diferencias temporales	21	1,533	BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$1533
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	72	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$72
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	6,792	BG 16 Activos Intangibles \$3,865 más Gastos de Instalación \$2,927
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	842	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 842
PASIVO				
24	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil	8	-	
25	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles	9	-	
26	Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
27	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos	15		
28	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores	21	-	
29	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R	31	3,484	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,484
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	3,477	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,477
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que	47	-	

	computan como capital complementario			
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
CAPITAL CONTABLE				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468	BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	54,989	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$54,989
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	457	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$457
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	17,483	BG 30 Reservas de Capital \$10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$85) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$590) más Resultado Neto \$7,917
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
CUENTAS DE ORDEN				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL				
44	Reservas pendientes de constituir	12	-	
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	-	
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-	
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
48	Derogado			

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

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

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

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	38,008	3,041
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,424	114
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	3,277	262
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	53	4
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	7,729	618
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	2,034	163
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	24	2
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	458	37
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%)	34	3
Grupo I-B (ponderados al 4%)	-	-
Grupo II (ponderados al 0%)	-	-
Grupo II (ponderados al 10%)	-	-
Grupo II (ponderados al 20%)	-	-
Grupo II (ponderados al 50%)	-	-
Grupo II (ponderados al 100%)	-	-
Grupo II (ponderados al 120%)	-	-
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	907	73
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,425	354
Grupo III (ponderados al 25%)	43	3
Grupo III (ponderados al 50%)	1,702	136
Grupo III (ponderados al 57.5%)	200	16
Grupo III (ponderados al 100%)	666	53
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%)	5,022	402
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	236	19

Grupo V (ponderados al 50%)	41	3
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	456	36
Grupo VI (ponderados al 20%)	5,425	434
Grupo VI (ponderados al 25%)	3,733	299
Grupo VI (ponderados al 30%)	14,015	1,121
Grupo VI (ponderados al 40%)	13,558	1,085
Grupo VI (ponderados al 50%)	39,268	3,141
Grupo VI (ponderados al 70%)	36	3
Grupo VI (ponderados al 75%)	35,156	2,813
Grupo VI (ponderados al 85%)	11,014	881
Grupo VI (ponderados al 100%)	30,520	2,442
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%)	145	12
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	19,561	1,565
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	838	67
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	6,230	498
Grupo VII_A (ponderados al 60%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	130,918	10,473
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	702	56
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	67	5
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 120%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VIII (ponderados al 115%)	10,058	805
Grupo VIII (ponderados al 150%)	2,887	231
Grupo IX (ponderados al 100%)	22,120	1,770
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-

Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	3,966	317
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	18	1
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	150	12

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	46,500	3,720

CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 17.75% al cierre de septiembre 2024, 306pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.69% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).

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

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

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

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

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

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

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

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

Ref.	RUBRO	Sep-24 ¹⁾ T	Jun-24 T-1	Mar-24 T-2	Dic-23 T-3	Sep-23 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	16,639	16,769	15,792	16,280	7,799
1 ^a	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	463,647	470,684	464,864	471,664	461,662
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	3.25%	3.25%	3.25%	3.25%	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	887,401	894,365	842,238	868,289	831,882
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	1.88%	1.88%	1.88%	1.88%	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	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	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

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

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

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 2024 fue de \$20.93 millones y su promedio durante el tercer trimestre de 2024 fue de \$18.54 millones mismo que corresponde a un 0.022% del capital neto (\$85,851 millones a agosto 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	1,739,583	1,500,224
Mercado de Dinero	51,700	54,153
Tipo de cambio		
Cash	4,429	4,003
Derivados	323,278	315,485
Capitales		
Cash	9	5
Derivados	7,874	7,902
VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2024	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	19.26	18.34
Tipo de cambio	4.83	1.85
Capitales	-	-
VaR Global	20.93	18.54

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 2024 muestra una pérdida máxima de \$389.89 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 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ²	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US)	60,454	58,042
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	134,348	130,471

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 2024 de 167.01% y 115.48% respectivamente.

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

² Cifras previas al cierre del tercer trimestre 2024.

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(2,031)	(2,510)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(203)	(100)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender ¹⁾	94,172	93,678
Derivados de Cobertura	111,693	99,896

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 2024 y el promedio del tercer trimestre del 2024 fueron \$5,608 millones y \$4,501 millones, respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y realizar el proceso de cálculo de reservas de todas las carteras de crédito, conforme a los modelos regulatorios establecidos por CNBV en la CUB.

Se utilizan las Agencias Calificadoras aprobadas por CNBV conforme se describe en Anexo 1-B de la CUB.

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 \$12 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 2024, el Banco mantiene \$67 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

INFORMACIÓN METODOLÓGICA

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

- La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

- La pérdida no esperada, es una medida de dispersión alrededor de la pérdida esperada. Representa el capital económico necesario para mantener solvente a la Institución en caso de un evento adverso de gran magnitud que impacte las carteras crediticias.

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

Métricas Riesgo de Crédito¹⁾ (Cifras al 30 de septiembre 2024)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.28%	2.91%
Consumo	3.70%	15.59%
Cartera Comercial	0.59%	4.21%
Total	0.72%	4.59%

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

Parámetros de Riesgo¹⁾ (Cifras a millones al 30 de septiembre 2024)	EI ²⁾	PI	SP
Hipotecas	230,003	1.60%	16.79%
Consumo	62,914	4.70%	72.25%
Cartera Comercial	275,772	1.40%	43.50%

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 el proceso de constitución de garantías; previo a su aceptación, se valora la capacidad de absorción de riesgo y 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 2024.

POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO

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

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

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

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

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS

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

Al cierre de septiembre 2024 y en promedio durante el tercer trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.03% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.31% y 0.29% respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO EN OPERACIONES DE DERIVADOS

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

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

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

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

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

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

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

RIESGO OPERACIONAL

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

METODOLOGÍA GENERAL

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

POLÍTICAS PARA LA GESTIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

EVALUACIÓN DE RIESGO OPERACIONAL

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

MANUAL PARA LA RECOLECCIÓN Y CLASIFICACIÓN DE DATOS DE RIESGO OPERACIONAL

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

NIVELES DE TOLERANCIA DE RIESGO OPERACIONAL

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

INDICADORES CLAVE DE RIESGO (KRI)

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

RIESGO LEGAL

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

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de julio-septiembre 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$85.2 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$38.0 millones, donde \$3.1 millones corresponden al Riesgo Operacional y \$34.9 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO

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

Para gestionar el Riesgo Tecnológico, el Banco cuenta con el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos para gestionar y vigilar los riesgos asociados con las Tecnologías de la Información y la Ciberseguridad

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: julio 2024 – septiembre 2024 (T3 2024)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez³

(Cifras en millones de pesos)	Calculo Individual T3 2024		Calculo Consolidado T3 2024		
	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES					
1	Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	140,094.71	No aplica	140,094.71
SALIDAS DE EFECTIVO					
2	Financiamiento minorista no garantizado	166,369	13,424	166,369	13,424
3	Financiamiento estable	98,201	6,607	98,201	6,607
4	Financiamiento menos estable	68,168	6,817	68,168	6,817
5	Financiamiento mayorista no garantizado	269,244	93,492	269,244	93,492
6	Depósitos operacionales	159,543	39,079	159,543	39,079
7	Depósitos no operacionales	109,020	53,732	109,020	53,732
8	Deuda no garantizada	681	681	681	681
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500	No aplica	500
10	Requerimientos adicionales:	282,289	20,210	282,289	20,210
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	8,432	6,606	8,432	6,606
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	0	0	0	0
13	Líneas de crédito y liquidez	273,857	13,604	273,857	13,604
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	64	64	64	64
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,860	2,860	2,860	2,860
16	TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	130,549	No aplica	130,549
ENTRADAS DE EFECTIVO					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	11,042	507	11,042	507
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	47,702	30,015	47,702	30,015
19	Otras entradas de efectivo	15,614	15,614	15,614	15,614
20	TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	74,358	46,136	74,358	46,136
21	TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	140,095	No aplica	140,095
22	TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	84,414	No aplica	84,414
23	COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ^[1]	No aplica	167.01	No aplica	167.01

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

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

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

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$75,443 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$30,407 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 \$5,608 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$13,661 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$28,162 millones y por operaciones de call money de \$8,669 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$14,900 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$134,768 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$99,269 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$24,384 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$7,670 millones y \$4,053 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del segundo trimestre 2024: 158% – promedio del tercer trimestre 2024: 167%

El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 900 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$5,181 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$5,229 millones.
- Los activos líquidos tuvieron una disminución de \$16,311 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en \$22,965 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$14,190 millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables⁵;

Evolución de Activos Líquidos T3-2024	Julio	Agosto	Septiembre
Efectivo	5%	6%	6%
Reservas en el Banco Central	24%	14%	18%
Nivel 1	69%	77%	73%
Nivel 2 ^a	2%	3%	3%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

⁵ Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Julio	Agosto	Septiembre
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	49%	48%	49%
Depósitos a plazo			
Del público en general	38%	37%	35%
Mercado de dinero	4%	4%	4%
Títulos de crédito emitidos	3%	4%	5%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	3%	3%	3%
De largo plazo	3%	4%	4%
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 2024) (Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación	4,953
Sin contrato de compensación	10,200
Posibles llamadas de margen (septiembre 2024)	
Colateral en Tránsito	73
Downgrade (septiembre 2024)	
Baja calificación 3 niveles	5,608

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

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	1,739,583
Tipo de cambio	323,278
Capitales	7,874
Total	2,070,735

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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 6.6% al cierre de septiembre del 2024 y en promedio durante tercer trimestre del 2024 fue de 6.3%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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 2024.

⁶ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

Descripción ⁷	Promedio	Septiembre
	T3 2024	2024
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	49,138	44,672
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	74,794	70,319
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	39	39
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	38	38
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	39	39
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	38	38

- 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 2024 y el promedio del tercer trimestre de 2024 son:

Scotiabank ⁸	Posición	Posición
	(Cierre) ⁹	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,454	58,042
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	134,348	130,471

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

II. Información cualitativa

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

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

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

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

⁷ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

⁸ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

⁹ Cifras previas al cierre de septiembre 2024.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- Instrumentar y mantener disponibles programas para la emisión de pasivos, y descuento de cartera con fondos especializados.
- Mantener la capacidad operativa en los sistemas de liquidación establecidos por Banco de México, considerando para esto los requerimientos de garantía y límites establecidos para tal efecto.
- Mantener reservas de activos líquidos para satisfacer las necesidades de operación y eventos imprevistos de necesidades de liquidez.

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

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

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

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

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

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

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

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

- En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de 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 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del tercer trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto¹⁰

(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:	89,296.24	0.00	0.00	0.00	89,296.24	89,296.24	0.00	0.00	0.00	89,296.24
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	89,296.24	0.00	0.00	0.00	89,296.24	89,296.24	0.00	0.00	0.00	89,296.24
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	208,944.81	988.44	25.71	193,576.69	0.00	208,944.81	988.44	25.71	193,576.69
5	Depósitos estables.	0.00	91,731.70	489.28	12.68	87,622.61	0.00	91,731.70	489.28	12.68	87,622.61
6	Depósitos menos estables.	0.00	117,213.11	499.16	13.03	105,954.08	0.00	117,213.11	499.16	13.03	105,954.08
7	Financiamiento mayorista:	0.00	370,199.37	23,756.34	43,388.07	189,198.14	0.00	370,199.37	23,756.34	43,388.07	189,198.14
8	Depósitos operacionales.	0.00	44,735.84	0.00	0.00	22,367.92	0.00	44,735.84	0.00	0.00	22,367.92
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	325,463.53	23,756.34	43,388.07	166,830.22	0.00	325,463.53	23,756.34	43,388.07	166,830.22
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:	74.26	48,066.50	2,103.76	5,639.41	6,691.29	74.26	48,066.50	2,103.76	5,639.41	6,691.29
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	74.26	0.00	0.00	0.00	0.00	74.26	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	48,066.50	2,103.76	5,639.41	6,691.29	0.00	48,066.50	2,103.76	5,639.41	6,691.29
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	89,370.50	627,210.68	26,848.54	49,053.19	478,762.35	89,370.50	627,210.68	26,848.54	49,053.19	478,762.35

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

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,178.69	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,178.69
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	127,289.46	38,581.10	298,684.44	354,098.78	0.00	127,289.46	38,581.10	298,684.44	354,098.78
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	11,151.34	0.00	0.00	1,115.13	0.00	11,151.34	0.00	0.00	1,115.13
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	13,527.26	5,463.46	2,482.03	7,242.85	0.00	13,527.26	5,463.46	2,482.03	7,242.85
20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	84,762.40	30,001.19	133,843.55	164,662.02	0.00	84,762.40	30,001.19	133,843.55	164,662.02
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	4,058.31	4,319.71	248,228.64	171,474.45	0.00	4,058.31	4,319.71	248,228.64	171,474.45
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	1,111.18	1,203.27	88,403.49	58,619.49	0.00	1,111.18	1,203.27	88,403.49	58,619.49
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	14,901.34	0.00	2,533.72	9,604.33	0.00	14,901.34	0.00	2,533.72	9,604.33
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	66,644.85	3,213.56	10,808.73	38,879.20	0.00	66,644.85	3,213.56	10,808.73	38,879.20
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	1,930.76	0.00	0.00	1,641.15	No Aplica	1,930.76	0.00	0.00	1,641.15
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	1,151.89	No Aplica	0.00	0.00	0.00	1,151.89
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	988.58	No Aplica	0.00	0.00	0.00	988.58
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		64,714.09	3,213.56	10,808.73	35,097.59	0.00	64,714.09	3,213.56	10,808.73	35,097.59
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	268,328.39	0.00	0.00	13,416.42	No Aplica	268,328.39	0.00	0.00	13,416.42
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	414,573.09	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	414,573.09
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	115.48	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	115.48

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

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

- Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$186,553 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$136,107 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$94,410 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$27,497 millones y \$32,843 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$3,449 millones.

- Fondeo Estable Requerido:



Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$353,177 millones y por operaciones mercado de dinero de \$19,416 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,649 millones, deducciones de capital por \$11,191 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$725 millones.

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

Promedio del segundo trimestre del 2024: 115.64% – Promedio del tercer trimestre del 2024: 115.48%

El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 16pb respecto al segundo trimestre del 2024, esto debido principalmente a:

- El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 22,979 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 8,743 millones.
- El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron \$6,580 millones.
- 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	484,319	468,912	483,056
Financiamiento Estable Requerido	416,552	414,221	412,946
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	116.27%	113.20%	116.98%

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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$8.98 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.01 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	920,000	1.85	1.92	(0.07)
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISH RS	105,000	5.51	5.53	(0.02)
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	100,000	1.62	1.54	0.08
Total			1,125,000.00	8.98	8.99	(0.01)

Al cierre del tercer trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$1.11 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	64,900	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	364,211	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1A_BABA_N	1,900	0.12	-	0.12
Scotiabank	Pública	1I_MCHI_*	2,700	0.32	-	0.32
Scotiabank	Pública	1I_PSQ_*	4,200	0.05	(0.03)	0.02
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	96,511	0.07	-	0.07
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	1,000	0.15	-	0.15
Scotiabank	Pública	1I_IB01_N	147	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	22,644	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_GMEXICO_B	10,000	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	3,213	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_ALFA_A	111,429	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	531,573	0.01	(0.07)	(0.06)
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	44,122	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	71,000	0.09	(0.03)	0.06
Scotiabank	Pública	1_GMEXICO_B	1,000	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	26,489	0.03	(0.04)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1_ALFA_A	513,557	0.47	(0.08)	0.39
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	50,176	-	-	-
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISH RS	143,197	0.01	(0.02)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1A_MGA_N	700	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	62,885	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	90,105	-	-	-
Scotiabank	Pública	1B_NAFTRAC_ISH RS	43,157	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_CHDRAUI_B	4,200	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	4,337	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	6	-	-	-
Scotiabank	Pública	1I_MBIL_N	27	-	-	-
Total			2,269,386	1.42	(0.31)	1.11

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	-	-	-
Total			9,317	-	-	-

Al 30 de septiembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$1.90 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$1.40 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$0.50 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	6.30	0.00	6.30	22.23%	1.40
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	6.30	0.00	6.30	8.00%	0.50
Índices accionarios	0.00	0.00	0.00	4.00%	0.00
Requerimiento por riesgos específico	0.00	0.00	0.00	4.00%	0.00
Total Requerimiento de capital					1.90

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-24	sep-24
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	794,359	803,884
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(10,446)	(11,111)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	783,912	792,773
Exposiciones a instrumentos financieros derivados			
4	Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible)	6,553	3,717
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	6,289	6,418
6	Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo		
7	(Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados)	(1,932)	(3,543)
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)	10,910	6,592
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	22,871	14,052
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(21,870)	(14,052)

14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	11	9
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	1,012	9
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	388,965	327,896
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(290,435)	(239,868)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	98,530	88,028
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	76,795	78,770
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	894,365	887,401
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	8.59%	8.88%

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

Referencia	DESCRIPCION	jun-24	sep-24
1	Activos totales	869,361	877,814
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	(816)	(842)
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	(41,221)	(53,286)
5	Ajuste por operaciones de reperto y préstamo de valores	(21,859)	(14,043)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	98,530	88,028
7	Otros ajustes	(9,631)	(10,268)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	894,365	887,401

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

Referencia	DESCRIPCION	jun-24	sep-24
1	Activos totales	869,361	877,814
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(52,131)	(59,878)
3	Operaciones en reperto y préstamos de valores	(22,871)	(14,052)
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	794,359	803,884

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

CONCEPTO/PERIODO	jun-24	sep-24	Variación
Capital Básico ¹⁾	76,795	78,770	1,975
Activos Ajustados ²⁾	894,365	887,401	-6,964
Razón de Apalancamiento ³⁾	8.59%	8.88%	29 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 2024.

El indicador se ubicó en 8.88%, 29pb mayor respecto el trimestre anterior, debido al incremento del capital nivel 1 de \$1,975 millones(+22pb) principalmente por el resultado neto del periodo; así como a la disminución de los activos ajustados por \$6,964 millones (+7pb); principalmente por la disminución de las exposiciones fuera del balance que compensaron parcialmente el incremento de las exposiciones dentro del balance.

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
	Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) <i>recibidas</i> , siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:
	<ul style="list-style-type: none"> 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.
4	<ul style="list-style-type: none"> d) El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. e) El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.
	En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.
	En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el

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

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

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

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

Referencia	Descripción
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico. El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
2	El monto se debe registrar con signo negativo. El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.
3	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 doscientos millones) de acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de Scotiabank mediante una sola exhibición en efectivo, el dividendo de referencia no fue pagado a través de la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S.A. de C.V., se llevó a cabo a través de Scotiabank con fecha 20 de diciembre de 2013.

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

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

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

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

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

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

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

FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ

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

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$117,904 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$42,492 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 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



Instrumentos Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

2). (MR) Mercados reconocidos

3). (ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

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

Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹¹	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	60,454	58,042
Liquidity Buffer	134,348	130,471

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

¹¹Cifras previas al cierre de septiembre 2024.

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

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

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

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

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

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

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

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

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

SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

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

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

POLÍTICAS DE VAR

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

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

B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

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

BONOS CUPÓN CERO

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

RIESGO DE CRÉDITO

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

SENSIBILIDAD DEL PASIVO

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

DERIVADOS DE TASAS DE INTERÉS

SWAPS DE TASA DE INTERÉS

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

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

FUTUROS DE TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

FUTUROS DE BONO M

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

FUTUROS DE CETE

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

EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

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

Durante el tercer trimestre de 2024 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, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia o CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.

C) INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS

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

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

Al cierre de septiembre de 2024 y promedio del tercer trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank– (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹²	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	134,348	130,471

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

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

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM positivo:

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

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

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

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

En donde:

Parámetro	Descripción
<i>SD</i>	Salida de efectivo por derivados.
T_{ii}	Umbral con la Contraparte i en el estado i
T_{ij}	Umbral con la Contraparte i en el estado j
<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.

¹²Cifras previas al cierre de septiembre 2024.

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario Estrés
Gap 30d Gap Acum	60,454	54,845	54,844	54,842
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(5,609)	(5,610)	(5,612)

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 gamma1 y gamma5.-

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

VEGA

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

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

RHO

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

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

THETA

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

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

DIVIDEND RISK

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

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

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

Cifras expresadas en pesos

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a septiembre 30, 2024

	0 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(347,953.69)	(69,941.60)	(177,804.18)	10,870.24	(584,848.44)	(1,169,677.67)
CCS	(332.92)	150.99	207.59	17.85	43.55	87.06
Caps&Floors	(5,341.44)	438.87	(5.40)	(0.35)	(4,900.55)	(9,808.87)
Binary	-	-	-	-	-	-
Caps&Floors	-	-	-	-	-	-
TIIIE Futures	-	-	-	-	-	-
Total	(353,628.05)	(69,351.74)	(177,601.99)	10,887.74	(589,705.44)	(1,179,399.48)

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

SUPUESTOS DE CÁLCULO.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (176.24) Millones de pesos.
- Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock (+/-)	P&L	Stress 1 Shock (+/-)	P&L	Stress 2 Shock (+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(1.18)	121.68	50.00	(58.97)	100.00	(117.94)	200.00	(235.88)
Volatilidad al 1% a FX %	Caps & Floors	(0.01)	2.37	0.10	(0.00)	0.40	(0.00)	1.00	(0.01)
a FX %	Forwards	1.85	36.53	0.10	(3.65)	0.20	(7.31)	0.50	(18.26)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	0.00
Total					(62.62)		(125.25)		(254.15)

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

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPU15.INDX	6,588.00	23,902.00	220.00
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options INTC.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Total	6,588.00	23,902.00	220.00

Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja	(0.1)	(0.3)	(0.5)
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNPU15.INDX	(658.80)	(1,976.40)	(3,294.00)
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options INTC.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Total	(658.80)	(1,976.40)	(3,294.00)

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

Escenarios al alza	0.05	0.15	0.2
Options AAPL.OQ	-	-	-
Options BNUI5.INDX	329.40	988.20	1,317.60
Options ENHFO5.INDX	-	-	-
Options ENHGE5.INDX	-	-	-
Options INTC.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MSFDV1.INDX	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SHELL.AS	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options STX50E.INDX	-	-	-
Total	329.40	988.20	1,317.60

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Escenario	Monto
Probable	(658.80)
Poco Probable	(1,976.40)
Muy poco Probable	(3,294.00)

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 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Colateral		Colateral	
	Recibido MXN	Enviado MXN	Recibido USD	Enviado USD
CLIENTE 1	-	-	19,555,000	(13,180,000)
CLIENTE 2	970,000,000	(812,000,000)	-	-
CLIENTE 3	-	-	755,000	-
CLIENTE 4	-	-	4,525,000	-
CLIENTE 5	-	(34,900,000)	-	-
CLIENTE 6	39,600,000	(533,854,889)	37,825,000	(32,575,000)
CLIENTE 7	-	-	27,210,000	(31,390,000)
CLIENTE 8	-	-	162,980,000	(194,570,000)
CLIENTE 9	-	-	114,300,000	(247,800,000)
CLIENTE 10	-	-	570,000	-
SUBTOTAL	1,009,600,000	(1,380,754,889)	367,720,000	(519,515,000)

Contraparte	Colateral		Colateral	
	Recibido MXN	Enviado MXN	Recibido USD	Enviado USD
CLIENTE 11	-	-	5,910,000	(830,000)
CLIENTE 12	-	-	-	(100,000)
CLIENTE 13	-	-	27,890,000	(26,650,000)
CLIENTE 14	-	-	-	(580,000)
CLIENTE 15	95,400,000	(49,200,000)	-	-
CLIENTE 16	230,300,000	(382,300,000)	-	-
CLIENTE 17	300,000	-	-	-
CLIENTE 18	339,600,000	(199,500,000)	111,810,000	(102,160,000)
CLIENTE 19	333,214,685	(852,937,172)	-	-
CLIENTE 20	1,000,000	-	-	-
CLIENTE 21	26,400,000	-	-	-
CLIENTE 22	-	-	4,230,000	(5,200,000)
CLIENTE 23	-	-	1,750,000	-
CLIENTE 24	-	-	680,000	(340,000)
CLIENTE 25	-	-	260,000	(2,960,000)
CLIENTE 26	-	-	6,500,000	(21,870,000)
TOTAL	2,035,814,685	(2,864,692,061)	526,750,000	(680,205,000)

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

Producto	Fecha	Cliente	Divisa	Monto	Motivo del incumplimiento
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	10/07/2024	Cliente 1	MXN	(51,234)	Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	12/07/2024	Cliente 2	MXN	115,617	Falla del sistema propio
Pagos por Operaciones de Opción	17/07/2024	Cliente 3	MXN	1,665,500	Pago cuenta errónea
Pagos por Operaciones Cambiarias	22/07/2024	Cliente 4	MXN	893,740	Falta de liquidez
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	29/07/2024	Cliente 5	MXN	(1,000,742)	En espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	29/08/2024	Cliente 6	MXN	(1,099,126)	En espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Opción	03/09/2024	Cliente 7	MXN	2,828,143	No realizó unwind
Pagos por Operaciones de Opción	04/09/2024	Cliente 8	USD	50,000	Otros
Pagos por Operaciones de Opción	04/09/2024	Cliente 9	MXN	(920,000)	Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	18/09/2024	Cliente 10	EUR	114,653	Otros
Pagos por Operaciones de Opción	19/09/2024	Cliente 11	MXN	18,650,000	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción	19/09/2024	Cliente 12	MXN	(200,000)	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción	19/09/2024	Cliente 13	USD	(1,000,000)	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	26/09/2024	Cliente 14	USD	4,098	Pago incompleto
Pagos por Operaciones de Opción	26/09/2024	Cliente 15	MXN	18,650,000	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción	26/09/2024	Cliente 16	MXN	(200,000)	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción	26/09/2024	Cliente 17	USD	(1,000,000)	Se rechazó pago
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards)	27/09/2024	Cliente 18	USD	14,824,848	Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)	30/09/2024	Cliente 19	MXN	(1,039,802)	Otros

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

Cifras expresadas en pesos

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C92554	26/08/2024	Active		mxn/usd	120,000,000	7,039,197	
C92555	26/08/2024	Active		usd/mxn	7,039,197	120,000,000	
M00143692	31/07/2024	Active	4,487,415	usd		4,487,415	
M00143693	31/07/2024	Active	2,556,852	usd		2,556,852	
M00338155	05/07/2024	Active	18,150	mxn	18,150		
M00338156	05/07/2024	Active	1,000	usd		1,000	
M00338160	04/07/2024	Active	147	mxn	147		
M00339131	05/07/2024	Active	141	mxn	141		
M00339705	08/07/2024	Active	1,000	usd		1,000	
M00339706	08/07/2024	Active	217	mxn	217		
M00339707	08/07/2024	Active	18,080	mxn	18,080		
M00340699	09/07/2024	Active	306	mxn	306		
M00340700	09/07/2024	Active	1,000	usd		1,000	
M00340701	09/07/2024	Active	18,000	mxn	18,000		
MNF396	29/07/2024	Active	2,000,000,000	mxn		2,000,000,000	
MNF414	27/09/2024	Active	60,000,000	mxn		60,000,000	
MNF447	04/07/2024	Active	110,000,000	mxn		110,000,000	
MNF480	23/08/2024	Active	2,667,560	usd		2,667,560	
MNF485	23/08/2024	Active	4,070,566	usd		4,070,566	
MNF494	13/09/2024	Active	101,933,333	mxn		101,933,333	
MWW146	27/09/2024	Active	400,000,000	mxn		400,000,000	
P17453	23/08/2024	Active	30,981,773	mxn			30,981,773
P17544	27/08/2024	Active	60,000,000	mxn			60,000,000
P17546	27/08/2024	Active	60,000,000	mxn			60,000,000
P17547	27/08/2024	Active	60,000,000	mxn			60,000,000
P17549	27/08/2024	Active	60,000,000	mxn			60,000,000
P17794	30/09/2024	Active	16,130,626	mxn			16,130,626
P17797	30/09/2024	Active	16,130,626	mxn			16,130,626
P18159	23/08/2024	Active	30,981,773	mxn			30,981,773
P18190	26/07/2024	Active	16,000,000	mxn			16,000,000
P18191	26/07/2024	Active	16,000,000	mxn			16,000,000
P18195	26/07/2024	Active	16,000,000	mxn			16,000,000
P18197	26/07/2024	Active	16,000,000	mxn			16,000,000
P18231	04/08/2024	Active	30,000,000	mxn			30,000,000
P18233	04/08/2024	Active	30,000,000	mxn			30,000,000
P18237	04/08/2024	Active	30,000,000	mxn			30,000,000
P18238	04/08/2024	Active	30,000,000	mxn			30,000,000
P18271	08/08/2024	Active	140,000,000	mxn			140,000,000
P18272	08/08/2024	Active	140,000,000	mxn			140,000,000
P18273	08/08/2024	Active	140,000,000	mxn			140,000,000
P18274	08/08/2024	Active	140,000,000	mxn			140,000,000
P18315	28/08/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18316	28/08/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18318	29/08/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18319	29/08/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18346	11/09/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18347	11/09/2024	Active	500,000,000	mxn			500,000,000
P18367	06/07/2024	Active	44,775,000	usd			44,775,000
P18368	06/07/2024	Active	44,775,000	usd			44,775,000

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
P18369	06/07/2024	Active	5,000,000	usd			5,000,000
P18370	06/07/2024	Active	5,000,000	usd			5,000,000
P18380	20/08/2024	Active	138,828,528	mxn			138,828,528
P18381	20/08/2024	Active	138,828,528	mxn			138,828,528
P18384	20/08/2024	Active	138,828,528	mxn			138,828,528
P18385	20/08/2024	Active	138,828,528	mxn			138,828,528
SDQ942	23/09/2024	Active	16,250,000	usd	16,250,000	16,250,000	
SDR969	16/08/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDR971	16/08/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDS043	23/08/2024	Active	226,000,000	mxn	226,000,000	226,000,000	
SDS066	30/08/2024	Active	303,454	usd	303,454	303,454	
SDS091	30/08/2024	Active	303,454	usd	303,454	303,454	
SDS134	10/09/2024	Active	10,008,055	mxn	10,008,055	10,008,055	
SDS147	10/09/2024	Active	10,008,055	mxn	10,008,055	10,008,055	
SDS252	03/07/2024	Active	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	1,300,000,000	
SDS283	09/08/2024	Active	8,041,811	mxn	8,041,811	8,041,811	
SDS299	09/08/2024	Active	8,041,811	mxn	8,041,811	8,041,811	
SDS352	27/09/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SDS356	27/09/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SDS397	27/09/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SDS444	13/08/2024	Active	12,509,480	mxn	12,509,480	12,509,480	
SDS449	13/08/2024	Active	12,509,480	mxn	12,509,480	12,509,480	
SDS532	26/09/2024	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	
SDS596	23/08/2024	Active	4,070,566	usd	4,070,566	4,070,566	
SDS598	23/08/2024	Active	2,667,560	usd	2,667,560	2,667,560	
SDS650	23/08/2024	Active	2,667,560	usd	2,667,560	2,667,560	
SDS655	23/08/2024	Active	4,070,566	usd	4,070,566	4,070,566	
SDS839	05/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDS840	05/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDS911	12/09/2024	Active	18,065,938	mxn	18,065,938	18,065,938	
SDS925	12/09/2024	Active	18,065,938	mxn	18,065,938	18,065,938	
SDT268	12/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDT306	12/07/2024	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SDT318	01/08/2024	Active	68,800,000	mxn	68,800,000	68,800,000	
SDT321	01/08/2024	Active	10,107,981	mxn	10,107,981	10,107,981	
SDT335	01/08/2024	Active	76,112,796	mxn	76,112,796	76,112,796	
SDT341	01/08/2024	Active	76,112,796	mxn	76,112,796	76,112,796	
SDT344	01/08/2024	Active	10,107,981	mxn	10,107,981	10,107,981	
SDT348	01/08/2024	Active	68,800,000	mxn	68,800,000	68,800,000	
SDT356	01/08/2024	Active	8,891,448	mxn	8,891,448	8,891,448	
SDT361	01/08/2024	Active	8,891,448	mxn	8,891,448	8,891,448	
SDT377	12/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT509	17/07/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDT531	11/09/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT551	15/07/2024	Active	1,100,000,000	mxn	1,100,000,000	1,100,000,000	
SDT556	15/07/2024	Active	1,100,000,000	mxn	1,100,000,000	1,100,000,000	
SDT559	10/07/2024	Active	41,486,694	mxn	41,486,694	41,486,694	
SDT613	17/07/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SDT676	10/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDT730	11/09/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDT783	02/07/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SDT948	04/07/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SDT956	10/09/2024	Active	3,920,078	mxn	3,920,078	3,920,078	
SDT963	17/09/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDT994	19/07/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU008	10/09/2024	Active	3,920,078	mxn	3,920,078	3,920,078	
SDU010	02/07/2024	Active	700,000,000	mxn	700,000,000	700,000,000	
SDU022	03/07/2024	Active	1,400,000,000	mxn	1,400,000,000	1,400,000,000	
SDU045	19/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU163	22/07/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SDU177	18/09/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SDU210	25/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU222	30/08/2024	Active	600,000	usd	600,000	600,000	
SDU229	30/08/2024	Active	600,000	usd	600,000	600,000	
SDU252	18/09/2024	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	
SDU332	30/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU343	18/09/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU384	30/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU425	19/09/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDU457	30/07/2024	Active	160,000,000	mxn	160,000,000	160,000,000	
SDU516	31/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU549	23/09/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU578	23/09/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU636	01/08/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU652	24/09/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU681	29/08/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDU690	29/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU699	29/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU789	02/09/2024	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SDU792	02/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU797	02/09/2024	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SDU802	23/08/2024	Active	2,667,560	usd	2,667,560	2,667,560	
SDU808	29/07/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SDU811	29/07/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SDU825	27/09/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU827	23/08/2024	Active	4,070,566	usd	4,070,566	4,070,566	
SDU830	29/07/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SDU863	30/09/2024	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SDU878	30/09/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDU895	30/09/2024	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	
SDU904	05/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU953	30/09/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDU967	15/09/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDU975	06/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV024	23/08/2024	Active	563,911	usd	563,911	563,911	
SDV028	23/08/2024	Active	563,911	usd	563,911	563,911	
SDV124	07/08/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV134	16/09/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV193	10/07/2024	Active	248,752	usd	248,752	248,752	
SDV206	07/08/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDV209	21/08/2024	Active	172,647,590	mxn	172,647,590	172,647,590	
SDV210	12/08/2024	Active	10,622,421	mxn	10,622,421	10,622,421	
SDV216	10/07/2024	Active	248,752	usd	248,752	248,752	
SDV224	12/08/2024	Active	10,622,421	mxn	10,622,421	10,622,421	
SDV361	13/09/2024	Active	101,933,333	mxn	101,933,333	101,933,333	
SDV372	13/09/2024	Active	101,933,333	mxn	101,933,333	101,933,333	
SDV374	13/09/2024	Active	101,933,333	mxn	101,933,333	101,933,333	
SDV456	12/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV484	04/07/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SDV487	04/07/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SDV510	12/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV572	12/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV614	12/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDV658	12/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW205	14/08/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW282	14/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW284	25/09/2024	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	
SDW383	04/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW386	15/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW429	05/07/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW465	08/07/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDW503	08/07/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW537	08/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW598	09/07/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SDW624	10/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW641	29/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW661	04/07/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW674	29/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW702	29/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW718	11/07/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW737	30/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW745	11/07/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SDW761	30/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SDW770	11/07/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SDW795	05/09/2024	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	
SDW901	06/09/2024	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	
SDW972	27/08/2024	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	
SDW991	30/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SED708	12/07/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SEE960	23/07/2024	Active	1,908,075	usd	1,908,075	1,908,075	
SEE963	23/07/2024	Active	633,428	usd	633,428	633,428	
SEE964	23/07/2024	Active	2,241,615	usd	2,241,615	2,241,615	
SEE965	23/07/2024	Active	2,241,615	usd	2,241,615	2,241,615	
SEE966	23/07/2024	Active	1,908,075	usd	1,908,075	1,908,075	
SEE967	23/07/2024	Active	633,428	usd	633,428	633,428	
SEF933	26/07/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SEP437	10/07/2024	Active	9,870,241	mxn	9,870,241	9,870,241	
SEP539	10/07/2024	Active	9,870,241	mxn	9,870,241	9,870,241	
SER480	10/07/2024	Active	10,901,289	mxn	10,901,289	10,901,289	
SER557	10/07/2024	Active	10,901,289	mxn	10,901,289	10,901,289	
SES729	31/07/2024	Active	14,388,091	mxn	14,388,091	14,388,091	
SES748	31/07/2024	Active	14,388,091	mxn	14,388,091	14,388,091	
SGD451	01/09/2024	Active	4,347,385	mxn	4,347,385	4,347,385	
SGD453	01/09/2024	Active	4,347,385	mxn	4,347,385	4,347,385	
SGL757	02/09/2024	Active	10,754,228	mxn	10,754,228	10,754,228	
SGY261	04/07/2024	Active	545,000,000	mxn	545,000,000	545,000,000	
SGY262	04/07/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SGY263	04/07/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SGY365	05/07/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGY760	10/07/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SGY824	11/07/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SGZ095	12/07/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGZ096	12/07/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SGZ247	15/07/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SGZ251	15/07/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SGZ252	15/07/2024	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	
SHA254	22/07/2024	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	
SHA382	23/07/2024	Active	560,000,000	mxn	560,000,000	560,000,000	
SHA383	23/07/2024	Active	560,000,000	mxn	560,000,000	560,000,000	
SHA545	24/07/2024	Active	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	
SHA899	26/07/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHB017	22/07/2024	Active	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	
SHB044	29/07/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SHB055	29/07/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHB077	30/07/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SHB085	30/07/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SHB933	02/08/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHB934	02/08/2024	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	
SHC045	05/08/2024	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	
SHC170	05/08/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SHC291	06/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHC532	08/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHC623	08/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHC628	08/08/2024	Active	865,000,000	mxn	865,000,000	865,000,000	
SHC791	09/08/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHD249	14/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHD438	15/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHD445	15/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHD594	16/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHD829	19/08/2024	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	
SHD830	19/08/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHD960	20/08/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHD961	20/08/2024	Active	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	
SHE089	21/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHE108	21/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SHE164	21/08/2024	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	
SHE168	21/08/2024	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	
SHE169	21/08/2024	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	
SHE347	22/08/2024	Active	435,000,000	mxn	435,000,000	435,000,000	
SHE348	22/08/2024	Active	435,000,000	mxn	435,000,000	435,000,000	
SHE407	22/08/2024	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	
SHE496	23/08/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SHE497	23/08/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SHE561	23/08/2024	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	
SHE567	23/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHE740	26/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHE744	26/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SHE862	27/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHE875	27/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHF022	28/08/2024	Active	440,000,000	mxn	440,000,000	440,000,000	
SHF026	28/08/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHF756	02/09/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHF942	04/09/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SHG635	10/09/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHG816	11/09/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SHH020	12/09/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SHI762	27/09/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHI765	27/09/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SHI775	27/09/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SJD569	26/07/2024	Active	3,055,556	usd	3,055,556	3,055,556	
SJD746	26/07/2024	Active	3,055,556	usd	3,055,556	3,055,556	
SJH401	04/07/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SJH755	05/07/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SJI206	10/07/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJI209	10/07/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SJI212	10/07/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SJI714	12/07/2024	Active	540,000,000	mxn	540,000,000	540,000,000	
SJI789	15/07/2024	Active	570,000,000	mxn	570,000,000	570,000,000	
SJJ090	16/07/2024	Active	530,000,000	mxn	530,000,000	530,000,000	
SJJ771	22/07/2024	Active	895,000,000	mxn	895,000,000	895,000,000	
SJJ817	23/07/2024	Active	895,000,000	mxn	895,000,000	895,000,000	
SJJ869	23/07/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SJJ870	23/07/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SJK516	26/07/2024	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SJK631	29/07/2024	Active	705,000,000	mxn	705,000,000	705,000,000	
SJK843	30/07/2024	Active	1,060,000,000	mxn	1,060,000,000	1,060,000,000	
SJK844	30/07/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SJK845	30/07/2024	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	
SJL400	01/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJL401	01/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJL402	01/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SJL465	01/08/2024	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	
SJL521	02/08/2024	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SJL522	02/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJL841	05/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJL867	05/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJL896	05/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJL897	05/08/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SJM314	08/08/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SJM595	08/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJM601	08/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJM603	08/08/2024	Active	720,000,000	mxn	720,000,000	720,000,000	
SJM639	09/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJM764	09/08/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SJM874	12/08/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SJN045	13/08/2024	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	
SJN056	13/08/2024	Active	234,934,763	mxn	234,934,763	234,934,763	
SJN194	14/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJN196	14/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJN749	19/08/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SJN892	31/07/2024	Active	2,556,852	usd	2,556,852	2,556,852	
SJN893	31/07/2024	Active	2,556,852	usd	2,556,852	2,556,852	
SJO137	31/07/2024	Active	4,487,415	usd	4,487,415	4,487,415	
SJO140	31/07/2024	Active	4,487,415	usd	4,487,415	4,487,415	
SJO615	22/08/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SJP240	23/08/2024	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	
SJP257	23/08/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJP300	23/08/2024	Active	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	
SJP727	28/08/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJQ352	28/08/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJQ366	28/08/2024	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	
SJQ518	04/09/2024	Active	920,000,000	mxn	920,000,000	920,000,000	
SJQ523	04/09/2024	Active	915,000,000	mxn	915,000,000	915,000,000	
SJR270	06/09/2024	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	
SJR289	06/09/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	
SJR290	06/09/2024	Active	180,000,000	mxn	180,000,000	180,000,000	

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SJR711	10/09/2024	Active	550,000,000	mxn	550,000,000	550,000,000	
SJT282	18/09/2024	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	
SJU836	26/09/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SJU837	26/09/2024	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	
SJV590	27/09/2024	Active	560,000,000	mxn	560,000,000	560,000,000	
SJY485	27/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJY487	27/08/2024	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	
SJZ644	02/07/2024	Active	2,710,000,000	mxn	2,710,000,000	2,710,000,000	
SKA275	04/07/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SKB452	15/07/2024	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SKB453	15/07/2024	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	
SKB898	17/07/2024	Active	1,320,000,000	mxn	1,320,000,000	1,320,000,000	
SKB937	17/07/2024	Active	660,000,000	mxn	660,000,000	660,000,000	
SKD999	08/08/2024	Active	10,400,952	usd	10,400,952	10,400,952	
SKE005	08/08/2024	Active	10,400,952	usd	10,400,952	10,400,952	
SKE045	01/08/2024	Active	1,285,000,000	mxn	1,285,000,000	1,285,000,000	
SKE520	06/08/2024	Active	1,300,000,000	mxn	1,300,000,000	1,300,000,000	
SKE524	06/08/2024	Active	1,280,000,000	mxn	1,280,000,000	1,280,000,000	
SKE592	06/08/2024	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKE593	06/08/2024	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	
SKG186	11/07/2024	Active	21,287,833	usd	21,287,833	21,287,833	
SKG187	08/08/2024	Active	9,626,115	usd	9,626,115	9,626,115	
SKG191	11/07/2024	Active	21,287,833	usd	21,287,833	21,287,833	
SKG192	08/08/2024	Active	9,626,115	usd	9,626,115	9,626,115	
SKG305	31/07/2024	Active	4,487,415	usd	4,487,415	4,487,415	
SKG307	31/07/2024	Active	2,556,852	usd	2,556,852	2,556,852	
SKH257	21/08/2024	Active	2,625,000,000	mxn	2,625,000,000	2,625,000,000	
SKJ922	05/09/2024	Active	2,550,000,000	mxn	2,550,000,000	2,550,000,000	
SKL267	18/09/2024	Active	1,265,000,000	mxn	1,265,000,000	1,265,000,000	
SKS903	31/07/2024	Active	1,900,000,000	mxn	1,900,000,000	1,900,000,000	
SKT175	01/08/2024	Active	1,135,000,000	mxn	1,135,000,000	1,135,000,000	
SKT195	01/08/2024	Active	1,140,000,000	mxn	1,140,000,000	1,140,000,000	
SKX011	29/07/2024	Active	1,800,000,000	mxn	1,800,000,000	1,800,000,000	
SKX126	26/08/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SKX128	26/08/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SKZ953	10/09/2024	Active	1,480,000,000	mxn	1,480,000,000	1,480,000,000	
SKZ966	10/09/2024	Active	2,480,000,000	mxn	2,480,000,000	2,480,000,000	
SKZ995	10/09/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SLB284	20/09/2024	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	
SLE456	12/07/2024	Active	17,500,000,000	mxn	17,500,000,000	17,500,000,000	
SLF519	19/07/2024	Active	15,000,000,000	mxn	15,000,000,000	15,000,000,000	
SLF750	19/07/2024	Active	13,000,000,000	mxn	13,000,000,000	13,000,000,000	
SLF752	19/07/2024	Active	3,250,000,000	mxn	3,250,000,000	3,250,000,000	
SLF889	19/08/2024	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	
SLF891	19/08/2024	Active	3,000,000,000	mxn	3,000,000,000	3,000,000,000	
SLF930	22/07/2024	Active	3,750,000,000	mxn	3,750,000,000	3,750,000,000	
SLG110	23/07/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SLG143	23/07/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SLJ252	06/09/2024	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	
SLJ486	12/08/2024	Active	7,500,000,000	mxn	7,500,000,000	7,500,000,000	
SLO265	22/08/2024	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SLO273	22/08/2024	Active	2,220,000,000	mxn	2,220,000,000	2,220,000,000	
SLQ132	02/09/2024	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	
SLQ135	02/09/2024	Active	2,380,000,000	mxn	2,380,000,000	2,380,000,000	
SMQ021	05/09/2024	Active	1,650,000,000	mxn	1,650,000,000	1,650,000,000	
SMQ966	11/09/2024	Active	2,405,000,000	mxn	2,405,000,000	2,405,000,000	
SMS179	17/09/2024	Active	1,965,000,000	mxn	1,965,000,000	1,965,000,000	
SMS485	18/09/2024	Active	2,375,000,000	mxn	2,375,000,000	2,375,000,000	
SMS487	18/09/2024	Active	1,580,000,000	mxn	1,580,000,000	1,580,000,000	
SMS502	18/09/2024	Active	3,950,000,000	mxn	3,950,000,000	3,950,000,000	
SMT051	20/09/2024	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	
SMT077	20/09/2024	Active	8,000,000,000	mxn	8,000,000,000	8,000,000,000	
SMT935	31/07/2024	Active	45,675,925	mxn	45,675,925	45,675,925	
SMT990	31/07/2024	Active	45,675,925	mxn	45,675,925	45,675,925	

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2108620	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108621	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108622	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108623	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108644	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108645	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108646	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2108647	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2108969	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108970	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108971	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2108972	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109017	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109018	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109019	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109020	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2109058	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109059	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109060	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109079	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2109080	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109081	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2109141	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109142	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109143	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109144	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109145	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109146	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109159	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109160	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109161	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109162	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109163	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109164	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109448	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109449	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109450	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109451	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,892
2109452	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109453	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109454	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109455	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109456	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109457	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109458	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109459	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109472	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109473	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109474	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109475	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	31,892
2109476	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109477	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109478	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109479	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109480	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109481	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2109482	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2109483	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	31,892
2109806	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109807	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2109808	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109809	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2109810	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109811	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109812	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109813	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109814	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109815	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2109816	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109817	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2109818	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109819	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109820	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2109821	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2110078	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2110079	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110080	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2110081	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,676
2110082	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2110778	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110779	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110780	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110781	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110782	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110783	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110784	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110785	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110786	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110787	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110788	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110789	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110790	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110791	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110792	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110793	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110794	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110795	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2110796	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2110797	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110798	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110799	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110836	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110837	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	60,000
2110838	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	60,000
2110875	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110876	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110877	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110914	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2110915	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2110916	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2111728	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111729	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111730	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111731	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111736	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111737	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2111738	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2111739	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2113407	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113408	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113409	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113410	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113411	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113412	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113413	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113414	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113415	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113416	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113417	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113418	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113419	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113420	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113421	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113422	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113423	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113424	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113425	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113426	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,466
2113427	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113428	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113429	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113430	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113431	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113432	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113433	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113434	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113435	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113436	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113437	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113438	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113439	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113440	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113441	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113442	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113443	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113444	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113445	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113446	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2113706	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113707	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113708	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113709	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113710	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113711	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2113712	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,102
2113713	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2113714	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113715	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2113716	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,466
2115123	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115124	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115125	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115126	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115127	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115128	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115129	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115130	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115131	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115132	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115133	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115134	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115135	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115136	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115137	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115138	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115139	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115140	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115141	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115142	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115143	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115144	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115145	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115146	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115147	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115148	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115149	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115150	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115151	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115152	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115153	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115154	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115155	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115156	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115157	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115158	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115159	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115160	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115161	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115162	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115163	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115164	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115165	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115166	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115167	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115168	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115169	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115170	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115171	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115172	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115173	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115174	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115175	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115176	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115177	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115178	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115179	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115180	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115181	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115182	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115183	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115184	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115185	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115186	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115187	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115368	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115369	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115370	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115371	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115372	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115373	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115374	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115375	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115376	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115377	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115378	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115379	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115380	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115381	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115382	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115383	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115384	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115385	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115386	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115387	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,863
2115388	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115389	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115390	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115391	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115392	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115393	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115394	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115395	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115396	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115397	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115398	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115399	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115400	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115401	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115402	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115403	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115404	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115405	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115406	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115407	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115408	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115409	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115410	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115411	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115412	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115413	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115414	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115415	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115416	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115417	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115418	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115419	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115420	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115421	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115422	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115423	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115424	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115425	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115426	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115427	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115428	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,408
2115429	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2115430	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115431	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2115432	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	9,863
2115513	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115514	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115515	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115516	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115517	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115518	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115519	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115520	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115521	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115522	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,132
2115523	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115524	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115525	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115526	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115527	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,132
2115568	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115569	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2115570	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115571	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115572	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	20,132
2115573	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115574	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115575	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115576	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115577	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,132
2115578	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,912
2115579	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2115580	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115581	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2115582	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	20,132
2115825	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115826	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115827	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115828	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115829	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115830	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115831	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115832	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115833	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115834	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115835	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115836	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115837	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115838	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115839	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2115945	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115946	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115947	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115948	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115949	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115950	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115951	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115952	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115953	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115954	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,577
2115955	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,333
2115956	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115957	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2115958	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2115959	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,577
2116135	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116136	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116137	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116138	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116139	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116140	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116141	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116142	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116143	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116144	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116145	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116146	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116147	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116148	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116149	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116150	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116151	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116152	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116153	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116154	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116155	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116156	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116157	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116158	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116159	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116160	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116161	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116162	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116163	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116164	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116165	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116166	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116167	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116168	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116169	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116170	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116171	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116172	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116173	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116282	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116283	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116284	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116285	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116286	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116287	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116288	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116289	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116290	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116291	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116292	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116293	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116294	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116295	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116296	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116297	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116298	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116299	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116300	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116301	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116302	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116303	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116304	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116305	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116306	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116307	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116308	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116309	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116310	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116311	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116312	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116313	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116314	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116315	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116316	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116317	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116318	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116319	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116320	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116418	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116419	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116420	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116421	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116422	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,556
2116478	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,874
2116479	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2116480	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116481	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2116482	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,556
2116511	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,200,000
2116512	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2116516	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,200,000
2116517	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2116521	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200,000
2116522	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,200,000
2116606	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116607	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116608	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116609	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116610	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116611	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116612	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116613	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116614	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116615	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116616	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116617	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116693	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116694	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116695	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116696	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116697	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116698	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116699	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116700	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116701	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2116702	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116703	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2116704	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2116985	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2116986	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116987	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2116988	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2116989	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,410
2117045	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,198
2117046	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117047	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2117048	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2117049	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,410
2117126	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,333
2117127	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117128	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117129	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117130	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2117131	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,333
2117132	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117133	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117134	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2117135	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,789
2117256	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117257	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117258	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117259	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117260	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117261	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117262	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117263	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117264	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117265	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117266	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117267	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117268	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117269	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117270	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117271	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117272	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117273	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117274	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117275	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117276	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117277	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117278	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117279	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117280	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117281	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117282	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117283	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117284	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117285	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117286	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117287	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117288	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117289	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117290	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117291	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117292	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117293	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117294	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117295	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117296	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117297	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117298	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117299	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117300	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117301	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117302	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117303	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117304	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117305	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117306	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117307	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117308	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117309	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117310	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117311	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117312	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117313	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117314	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117315	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117316	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117317	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117318	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117319	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117320	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117506	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117507	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117508	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117509	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117510	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117511	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117512	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117513	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117514	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117515	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117516	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117517	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117518	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117519	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117520	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117521	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117522	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117523	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117524	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117525	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117526	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117527	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117528	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117529	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117530	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,128
2117531	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117532	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117533	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117534	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117535	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117536	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117537	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117538	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117539	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117540	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117541	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117542	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117543	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117544	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117545	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117546	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117547	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117548	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117549	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117550	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117551	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117552	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117553	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117554	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117555	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117556	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117557	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117558	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117559	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117560	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117561	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117562	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117563	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117564	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117565	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117566	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,097
2117567	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117568	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117569	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117570	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,128
2117732	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117733	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117734	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117735	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,613
2117736	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2117964	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117965	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117966	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117967	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117968	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117969	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117970	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117971	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117972	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117973	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117974	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117975	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117976	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117977	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117978	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117979	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2117980	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117981	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2117982	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2117983	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,613
2118036	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118037	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118038	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118039	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118040	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118056	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,302
2118057	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	350,000
2118058	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118059	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	350,000
2118060	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,883
2118289	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118290	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118291	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118292	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118293	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118294	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118295	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118296	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118297	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118298	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118299	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118300	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118301	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118302	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118303	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118304	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118305	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118306	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118307	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118308	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118309	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118310	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118311	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118312	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118313	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118314	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118315	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118316	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118317	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118318	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118319	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118320	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118321	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118322	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118323	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118324	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118325	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118326	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118327	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118328	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118329	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118330	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118331	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118332	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118333	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118334	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118335	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118336	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118337	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118338	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118339	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118340	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118485	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118486	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118487	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118488	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118489	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118490	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118491	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118492	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118493	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118494	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118495	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118496	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118497	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118498	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118499	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118500	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118501	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118502	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118503	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118504	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,941
2118505	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118506	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118507	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118508	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118509	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118510	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118511	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118512	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118513	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118514	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118515	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118516	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118517	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118518	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118519	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118520	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118521	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118522	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118523	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118524	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118525	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118526	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118527	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118528	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118529	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118530	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118531	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118532	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118533	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118534	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2118535	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2118536	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,941
2118648	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118649	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118650	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118651	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118652	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118653	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118670	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118671	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118672	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118673	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118674	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118675	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118707	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118708	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118709	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118710	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118711	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118712	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118713	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118714	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118715	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118716	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118717	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118718	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2118719	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118720	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118721	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118762	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118763	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118764	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118765	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118766	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118767	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118768	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118769	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118770	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118771	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,368
2118772	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,709
2118773	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118774	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2118775	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2118776	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,368
2118817	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118818	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118819	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2118820	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118821	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118822	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118823	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118824	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118825	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118826	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2118827	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118828	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118829	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118830	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118831	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2118872	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	10,778
2118873	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118874	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2118875	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2118876	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	21,391
2118877	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118878	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118879	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118880	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118881	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2118882	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	14,464
2118883	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2118884	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118885	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2118886	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	24,844
2118978	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118979	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118980	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118981	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118982	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118983	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118984	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118985	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118986	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118987	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118988	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118989	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118990	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118991	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118992	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118993	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118994	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118995	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118996	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2118997	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2118998	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2118999	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119000	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119001	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119002	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119003	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119004	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119005	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119006	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,986
2119007	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119008	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119200	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119201	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119250	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119251	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119252	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119253	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,336
2119254	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119255	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2119256	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2119257	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,336
2119297	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119298	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119299	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119300	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119301	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119302	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119303	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119304	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119305	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119306	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119307	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119308	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119348	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119349	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119350	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119351	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119352	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119353	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119354	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119355	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119356	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119357	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119358	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119359	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119370	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119371	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119372	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119373	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119374	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119375	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119414	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119415	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119416	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119417	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119418	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	500,000
2119419	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2119472	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119473	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119474	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119475	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2119476	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119477	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2119568	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119569	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119570	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119571	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119572	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119573	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119574	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119575	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119576	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119577	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119578	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119579	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119580	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119581	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119582	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119583	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119584	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119585	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119586	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119587	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119588	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119589	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119590	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119591	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119592	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119593	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119594	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119595	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119596	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119597	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119598	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119599	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119600	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119601	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119602	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119603	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119604	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119605	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119606	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119607	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119608	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119609	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119610	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119611	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119612	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119613	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119614	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119615	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119616	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119617	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119618	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119619	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119620	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119621	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119622	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119623	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119624	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119625	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119626	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119627	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119628	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119629	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119630	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119631	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119632	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119828	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119829	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119830	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119831	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119832	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119833	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119834	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119835	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119836	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119837	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119838	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119839	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119840	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119841	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119842	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,202
2119843	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119844	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119845	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119846	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119847	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119848	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119849	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119850	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119851	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119852	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119853	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119854	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119855	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119856	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119857	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119858	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119859	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119860	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119861	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119862	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119863	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119864	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119865	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119866	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119867	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119868	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2119869	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119870	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119871	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119872	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119873	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119874	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119875	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119876	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119877	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119878	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119879	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119880	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119881	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119882	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119883	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119884	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119885	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119886	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119887	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2119888	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	6,007
2119889	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119890	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2119891	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2119892	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,202
2120088	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120089	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120090	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120091	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120092	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120093	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120094	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120095	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120096	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120097	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120098	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120099	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120100	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120101	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120102	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120103	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120104	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120105	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120106	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120107	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120108	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120109	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120110	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120111	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120112	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120113	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120114	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120115	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120116	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120117	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120118	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120119	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120120	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120121	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120122	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120123	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120124	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120125	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120126	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120127	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120128	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120129	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120130	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120131	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120132	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120133	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120134	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120135	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120136	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120137	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120138	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120139	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120140	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120141	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120142	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120143	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120144	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120145	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120146	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120147	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120148	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120149	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120150	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120151	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120152	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120308	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120309	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120310	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120311	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120312	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120313	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120314	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120315	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120316	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120317	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120318	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120319	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120320	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120321	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120322	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120323	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120324	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120325	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120326	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120327	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,038
2120328	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120329	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120330	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120331	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120332	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120333	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120334	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120335	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120336	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120337	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120338	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120339	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120340	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120341	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120342	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120343	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120344	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120345	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120346	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120347	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120348	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	7,509
2120349	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120350	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	125,000
2120351	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	125,000
2120352	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,038
2120353	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120354	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120355	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120356	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120357	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120358	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120359	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120360	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120361	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120362	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120363	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120364	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120365	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120366	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120367	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120368	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,011
2120369	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120370	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2120371	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2120372	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,446
2120508	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120509	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120510	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120511	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120512	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120513	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120514	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120515	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120516	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120517	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120518	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120519	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120520	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120521	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120522	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120558	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120559	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120560	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120561	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120562	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120563	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120564	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120565	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120566	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120567	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120568	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,724
2120569	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2120570	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120571	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2120572	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	3,611
2120704	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120705	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120706	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120707	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120708	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120709	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120710	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120711	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120712	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120713	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120714	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120715	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120716	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120717	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120718	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120719	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120720	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120721	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120722	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120723	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120724	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120725	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120726	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120727	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120728	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120729	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120730	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120731	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120732	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120733	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120734	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120735	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120736	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120737	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120738	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120739	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120740	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120741	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120742	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120743	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120744	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120745	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120746	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120747	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120748	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120749	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120750	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120751	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120752	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120753	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120754	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120755	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120756	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2120757	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120758	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120759	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120760	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120761	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120762	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120763	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120896	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120897	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120898	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120899	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120900	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120901	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120902	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120903	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120904	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120905	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120906	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120907	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120908	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120909	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120910	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120911	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120912	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120913	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120914	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120915	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120916	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120917	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120918	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120919	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120920	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120921	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120922	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120923	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120924	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120925	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120926	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120927	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120928	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120929	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120930	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120931	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120932	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120933	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120934	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120935	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120936	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120937	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120938	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120939	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120940	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120941	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120942	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120943	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120944	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120945	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120946	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120947	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120948	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120949	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120950	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120951	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120952	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,226
2120953	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	75,000
2120954	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2120955	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	75,000
2121117	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121118	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121119	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121120	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121129	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121130	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121131	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121132	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2121178	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121179	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121180	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121181	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121366	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121367	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121368	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121369	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121370	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121371	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121372	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	11,694
2121373	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121374	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121375	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121376	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121377	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121378	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121379	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121380	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121381	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121382	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121383	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121384	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121385	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121386	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121387	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121388	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121389	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121390	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121391	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121392	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121393	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121394	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121395	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121396	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121397	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121398	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121399	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121400	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121401	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121402	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121403	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121404	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121405	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121406	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121407	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121408	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121409	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121410	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121411	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121412	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121413	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121414	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121415	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121416	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121417	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121418	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,438
2121419	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2121420	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121421	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2121422	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	11,694
2121483	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121484	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121485	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121489	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121490	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121491	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121501	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2121505	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2121520	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121521	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121522	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121523	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121526	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121527	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121528	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121529	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121774	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121775	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121776	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121777	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,689
2121778	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121779	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121780	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121781	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,350
2121782	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121783	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121784	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121785	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,551
2121802	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121803	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121804	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121805	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,689
2121806	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121807	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121808	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121809	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,350
2121810	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121811	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2121812	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2121813	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	4,551
2121830	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121831	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121832	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121839	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121840	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2121841	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,000,000
2121848	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121849	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121850	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121851	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121852	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121853	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121858	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121859	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121860	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121861	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121862	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2121863	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2121912	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121913	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121914	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121915	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121916	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121917	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121918	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121919	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121920	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121921	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121922	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121923	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121924	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121925	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121926	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121927	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121928	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121929	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121930	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121931	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121932	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121933	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121934	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121935	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121936	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121937	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121938	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121951	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121952	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121953	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121954	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121955	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121956	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121957	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121958	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121959	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121960	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121961	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121962	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121963	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121964	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121965	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121966	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2121967	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121968	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121969	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121970	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121971	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121972	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121973	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121974	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121975	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121976	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	25,000
2121977	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	25,000
2121986	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121987	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2121996	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2121997	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2122020	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122021	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122022	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122023	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122024	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122025	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122026	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122027	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122028	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122029	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122030	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122031	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122032	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122033	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122034	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122065	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122066	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122067	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122068	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122069	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122070	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122071	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122072	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122073	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122074	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122075	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,348
2122076	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2122077	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122078	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2122079	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	8,686
2122108	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122109	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122110	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122112	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122113	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122114	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122116	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122117	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122118	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122120	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122121	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122122	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122124	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122125	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122126	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122128	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122129	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122130	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122132	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122133	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122134	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122136	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122137	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122138	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122140	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122141	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122142	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122160	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122161	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122162	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122164	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2122165	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122166	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2122168	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123485	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123496	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,578,455
2123497	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,578,455
2123498	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,578,455
2123499	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,578,455
2123510	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,578,455
2123511	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,578,455
2123512	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,578,455
2123513	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,578,455
2123529	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123530	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123531	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123532	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123533	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,105,052
2123534	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123550	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123551	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123552	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123572	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123573	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123574	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123575	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123576	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123577	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123578	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123579	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123588	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123589	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123590	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123591	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123592	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123593	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123594	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2123595	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2123612	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,520,503
2123613	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,520,503
2123614	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,520,503
2123615	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,520,503
2123626	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123627	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2123628	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,556
2123629	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2123630	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2123631	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,556
2123632	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123633	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,105,052
2123634	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,105,052
2123641	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,520,503
2123642	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,520,503
2123643	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,520,503
2123644	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,520,503
2123660	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123661	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123662	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123663	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123664	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123665	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123666	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123667	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123668	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123669	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123670	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123671	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123672	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123673	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123674	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123675	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123676	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123677	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123678	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123679	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123680	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123681	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123682	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123683	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123684	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123685	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123686	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123687	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2123688	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123689	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123690	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123691	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123692	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123693	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123694	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123695	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123735	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123736	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123737	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123738	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123739	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123740	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123741	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123742	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123743	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123744	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123745	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123746	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123747	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123748	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123749	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123750	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123751	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123752	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123753	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123754	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123755	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123756	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123757	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123758	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123759	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123760	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123761	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123762	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123763	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123764	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123765	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123766	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123767	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123768	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123769	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123770	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123811	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123812	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123813	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123814	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123815	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123816	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123817	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123818	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123819	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123820	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123821	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123822	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123843	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123844	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123845	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123846	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123847	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123848	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123849	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123850	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123851	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123852	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2123853	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2123854	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	956
2123927	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123928	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2123929	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123930	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2123931	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123932	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2123933	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123934	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	35,000
2123935	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123936	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000
2123937	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	35,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124185	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,625,000
2124186	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,625,000
2124187	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	2,625,000
2124188	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,202
2124189	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124190	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124191	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124192	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124193	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124194	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124195	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124196	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124197	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124198	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124199	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124200	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124201	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124202	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124203	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124204	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124205	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124206	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124207	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124208	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124209	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124210	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124211	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124212	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124213	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124214	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124215	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124216	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124217	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124218	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	195,000
2124219	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	195,000
2124220	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	7,444
2124221	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124222	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124223	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124224	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124225	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124226	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124227	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124228	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124229	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124230	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124231	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124232	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124233	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124234	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124235	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124236	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124237	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124238	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124239	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124240	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124241	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124242	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124243	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124244	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124245	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124246	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124247	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124248	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124249	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124250	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2124251	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2124252	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,145
2124253	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2124254	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2124255	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2124256	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,726
2124257	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2124258	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2124259	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2124260	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,726
2124261	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000
2124262	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	150,000
2124263	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124574	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	68,000
2124579	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124580	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124581	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124582	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124583	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124584	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124585	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124586	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124587	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124588	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124589	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124590	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124591	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124592	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124593	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124594	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124595	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124596	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124597	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124598	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124599	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124600	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124601	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124602	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124603	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124604	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124605	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124606	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124607	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124608	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124609	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124610	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2124653	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124654	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2124655	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2124662	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124663	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124664	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124671	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124672	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124673	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124674	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124675	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124676	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124677	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124678	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124679	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124680	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124681	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124682	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124683	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124684	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124685	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2124728	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124729	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124730	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124734	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2124735	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2124736	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2124740	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124741	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124742	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2124839	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2124840	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2124841	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636
2124842	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2124843	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2124844	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2124845	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2124846	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2124847	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2124848	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2124849	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2124850	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2124851	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2124852	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2124853	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2124854	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2124855	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2124856	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2124863	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2124864	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2124865	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636
2124866	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2124867	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2124868	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2124869	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2124870	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2124871	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2124872	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2124873	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2124874	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2124875	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2124876	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2124877	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2124878	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375
2124879	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2124880	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2124887	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2124888	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2124889	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636
2124890	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2124891	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2124892	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2124893	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2124894	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2124895	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2124896	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2124897	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2124898	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2124899	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2124900	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2124901	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2124902	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375
2124903	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2124904	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2124911	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2124912	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2124913	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636
2124914	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2124915	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2124916	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2124917	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2124918	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2124919	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2124920	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2124921	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2124922	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2124923	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2124924	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2124925	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2124926	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375
2124927	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2124928	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2124967	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124968	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124969	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124970	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124983	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124984	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124985	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2124986	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2124999	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125000	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125001	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125002	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125003	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125004	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125011	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125012	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125013	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125014	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125015	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125016	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125023	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2125024	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2125025	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125026	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2125027	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2125028	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2125029	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2125030	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2125031	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2125032	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2125033	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2125034	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2125035	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2125036	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2125037	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2125038	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375
2125039	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2125040	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2125047	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	680,410
2125048	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	680,410
2125049	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,165,636
2125050	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,165,636
2125051	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,255,796
2125052	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,255,796
2125053	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	682,006
2125054	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	682,006
2125055	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	720,702
2125056	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	720,702
2125057	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	932,581
2125058	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	932,581
2125059	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,204
2125060	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,204
2125061	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	636,375
2125062	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	636,375
2125063	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,025,290
2125064	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,025,290
2125105	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125106	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125107	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125108	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125109	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125110	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125129	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125130	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125131	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125132	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125133	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125134	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125157	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125158	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125159	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125160	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	777
2125161	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125162	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125163	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125164	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125165	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125166	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125167	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125168	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125205	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125206	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125207	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125208	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	777
2125209	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125210	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125211	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125212	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125213	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125214	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125215	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125216	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	777
2125294	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125295	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125296	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125297	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125298	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125299	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125300	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125301	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125302	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125303	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125304	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125305	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125322	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125323	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125324	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125325	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125326	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125327	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125328	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125329	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125330	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125331	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2125332	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2125333	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	765
2125371	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125372	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125373	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125374	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125375	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125376	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125377	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125378	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125379	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125380	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125381	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125382	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125383	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125384	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125385	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125386	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125387	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125388	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	903
2125389	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125390	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125391	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125401	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125402	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125403	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125404	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125405	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125406	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125407	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125408	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125409	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125410	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125411	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125412	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125413	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125414	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125415	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125416	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125417	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	40,000
2125418	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	903
2125419	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125420	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	40,000
2125421	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	903
2125483	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125484	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125485	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125486	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125487	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125488	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125495	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125496	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125497	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125498	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125499	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	88,000
2125500	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	88,000
2125509	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125510	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125511	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125512	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125513	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125514	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125515	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125516	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125573	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125574	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125575	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec.id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125576	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125577	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125578	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125579	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	140,000
2125580	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	140,000
2125605	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125606	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2125607	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125608	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125609	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125610	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125615	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125616	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	200,000
2125617	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125618	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125619	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125620	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	200,000
2125625	FX	jul-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125626	FX	jul-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2125627	FX	ago-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125628	FX	ago-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125629	FX	sep-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125630	FX	sep-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125635	FX	jul-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125636	FX	jul-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2125637	FX	ago-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125638	FX	ago-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125639	FX	sep-24	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125640	FX	sep-24	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2125649	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	136,000
2125650	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	136,000
2125651	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,154
2125658	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	136,000
2125659	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	136,000
2125660	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	3,154
2125661	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125662	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125663	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125664	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125665	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125666	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125667	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125668	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125669	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125670	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125671	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125672	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125709	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2125710	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125711	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125712	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125713	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125714	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125715	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125716	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125717	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125718	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125719	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125720	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125787	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125788	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125789	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125790	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125791	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125792	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125793	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2125794	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125795	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2125823	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125824	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125825	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125826	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125827	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125828	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125829	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125830	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2125831	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2125841	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125842	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2125843	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125844	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125845	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125846	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125853	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125854	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125855	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125856	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125857	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,150,000
2125858	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,150,000
2125883	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125889	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2125922	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	TRIGGERED	47,000
2125923	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125924	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125925	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125926	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125927	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125928	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125929	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125930	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125931	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125932	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125933	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125958	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	TRIGGERED	47,000
2125959	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125960	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125961	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125962	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125963	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125964	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125965	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125966	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125967	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125968	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	47,000
2125969	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2125990	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,429
2125991	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2125992	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2125993	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2125994	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,990
2125995	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2125996	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2125997	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2125998	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2125999	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	32,642
2126000	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,429
2126001	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	300,000
2126002	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126003	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	300,000
2126004	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	13,990
2126005	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	36,000
2126006	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	700,000
2126007	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2126008	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	700,000
2126009	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	32,642
2126010	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126011	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126012	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126013	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126014	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126015	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126016	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	90,000
2126017	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126018	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	90,000
2126028	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126029	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126030	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126031	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126032	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126033	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126034	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126035	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	160,000
2126036	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	160,000
2126152	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2126153	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	47,000
2126355	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000
2126356	FX	jul-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	30,000
2126357	FX	jul-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	30,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126638	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	114,220
2126639	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	114,220
2126646	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,000,000
2126647	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,000,000
2126648	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126649	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126650	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126651	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126652	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126678	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,732
2126679	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2126680	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126681	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2126682	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	6,000
2126711	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126712	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126717	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	80,000
2126718	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	80,000
2126723	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126724	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126725	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126726	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126735	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126736	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126737	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126738	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,323
2126747	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126748	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126749	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126750	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116
2126759	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	50,000
2126760	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126761	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	50,000
2126762	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,116
2126786	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126787	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126788	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126789	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126790	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126791	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126792	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126793	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2126794	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126795	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126799	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126800	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	2,000,000
2126804	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126805	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126806	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126807	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126808	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,716
2126829	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	9,589
2126830	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126831	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126832	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126833	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,716
2126854	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126855	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126856	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126857	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126858	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126859	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126860	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126861	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126862	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126863	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126899	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126900	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126901	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126902	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126903	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126904	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	12,978
2126905	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126906	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126907	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126908	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	13,514
2126944	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,091
2126945	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126946	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2126947	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126948	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,920
2126949	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,091
2126950	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126951	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126952	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126953	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,920
2126984	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,091
2126985	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126986	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126987	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126988	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,920
2126989	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	8,091
2126990	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126991	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	250,000
2126992	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	250,000
2126993	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	15,920
2127026	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127037	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	500,000
2127052	FX	ago-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,014,083
2127053	FX	ago-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,014,083
2127054	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,014,083
2127055	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,014,083
2127090	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,755,742
2127091	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,755,742
2127130	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,285,217
2127131	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,285,217
2127132	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,284,416
2127133	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,284,416
2127134	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,282,016
2127135	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,282,016
2127136	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,281,217
2127137	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,281,217
2127138	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,280,418
2127139	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,280,418
2127140	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,279,619
2127141	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,279,619
2127142	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,278,820
2127143	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,278,820
2127144	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,275,628
2127145	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,275,628
2127146	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,274,830
2127147	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,274,830
2127148	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,274,033
2127149	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,274,033
2127150	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,273,236
2127151	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,273,236
2127152	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,270,846
2127153	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,270,846
2127154	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,270,050
2127155	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,270,050
2127156	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,269,254
2127157	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,269,254
2127158	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,268,458
2127159	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,268,458
2127160	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,267,663
2127161	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,267,663
2127162	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	5,265,278
2127163	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	5,265,278
2127164	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,841,238
2127165	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,841,238
2127166	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,840,957
2127167	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,840,957
2127168	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,840,114
2127169	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,840,114
2127170	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,839,834
2127171	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,839,834
2127172	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,839,553
2127173	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,839,553
2127174	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,839,273
2127175	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,839,273
2127176	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,838,992
2127177	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,838,992
2127178	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,837,871
2127179	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,837,871
2127180	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,837,591
2127181	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,837,591
2127182	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,837,311
2127183	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,837,311

Deal No	OTC type	Expiration Date	CCY/Sec. id	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status	Prin. Amt.
2127184	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,837,032
2127185	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,837,032
2127186	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,836,193
2127187	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,836,193
2127188	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,835,913
2127189	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,835,913
2127190	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,835,634
2127191	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,835,634
2127192	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,835,354
2127193	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,835,354
2127194	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,835,075
2127195	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,835,075
2127196	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,834,238
2127197	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,834,238
2127198	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,833,959
2127199	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,833,959
2127200	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,833,680
2127201	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,833,680
2127203	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2127204	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2127205	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2127206	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2127207	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	400,000
2127208	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	400,000
2127209	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2127210	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2127237	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	1,000,000
2127238	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	1,000,000
2127249	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127250	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127251	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127252	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127253	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127254	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127255	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127256	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127257	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127333	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127334	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127335	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127336	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127337	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127338	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127339	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127340	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127341	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127433	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127434	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127435	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127449	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127450	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127451	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127769	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127770	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127771	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127847	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED	100,000
2127848	FX	sep-24	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000
2127849	FX	sep-24	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED	100,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024071603693	BO	CADMXN	07/17/2024	10,000,000	12.90542	(129,054,180)
2024090303010	BO	CADUSD	09/03/2024	600,000	1.35483	(442,862)
2024070103019	B	EURUSD	07/03/2024	1,000,000	1.07451	(1,074,510)
2024070103113	B	EURUSD	07/03/2024	1,000,000	1.07231	(1,072,310)
2024070103147	B	EURUSD	07/03/2024	1,000,000	1.07221	(1,072,210)
2024070103156	B	EURUSD	07/03/2024	1,000,000	1.07224	(1,072,240)
2024070103065	S	EURUSD	07/03/2024	(1,000,000)	1.07351	1,073,510
2024070103256	S	EURUSD	07/03/2024	(1,000,000)	1.07319	1,073,190
2024070103430	S	EURUSD	07/03/2024	(1,000,000)	1.07265	1,072,650
2024070103483	S	EURUSD	07/03/2024	(1,000,000)	1.07283	1,072,830
2024070203066	B	EURUSD	07/05/2024	1,000,000	1.07298	(1,072,980)
2024070203732	B	EURUSD	07/05/2024	2,000,000	1.07459	(2,149,180)
2024070203122	S	EURUSD	07/05/2024	(1,000,000)	1.07384	1,073,840
2024070203660	S	EURUSD	07/05/2024	(2,000,000)	1.07416	2,148,320
2024070203588	SO	EURMXN	07/08/2024	(5,000,000)	19.65266	98,263,280
2024070303187	B	EURUSD	07/05/2024	2,000,000	1.07999	(2,159,980)
2024070303256	S	EURUSD	07/05/2024	(1,000,000)	1.07941	1,079,410
2024070303352	S	EURUSD	07/05/2024	(1,000,000)	1.07874	1,078,740
2024070403088	B	EURUSD	07/08/2024	1,000,000	1.08129	(1,081,290)
2024070403073	S	EURUSD	07/08/2024	(1,000,000)	1.08083	1,080,830
2024070803122	B	EURUSD	07/10/2024	1,000,000	1.08333	(1,083,330)
2024070803135	B	EURUSD	07/10/2024	1,000,000	1.08333	(1,083,330)
2024070803237	B	EURUSD	07/10/2024	1,000,000	1.08313	(1,083,130)
2024070803600	S	EURUSD	07/10/2024	(3,000,000)	1.08234	3,247,020
2024070903044	B	EURUSD	07/11/2024	1,000,000	1.0816	(1,081,600)
2024070903057	B	EURUSD	07/11/2024	1,000,000	1.08164	(1,081,640)
2024070903058	B	EURUSD	07/11/2024	1,000,000	1.08154	(1,081,540)
2024070903094	B	EURUSD	07/11/2024	1,000,000	1.08146	(1,081,460)
2024070903100	B	EURUSD	07/11/2024	1,000,000	1.08116	(1,081,160)
2024070903047	S	EURUSD	07/11/2024	(1,000,000)	1.08229	1,082,290
2024070903054	S	EURUSD	07/11/2024	(1,000,000)	1.08206	1,082,060
2024070903066	S	EURUSD	07/11/2024	(1,000,000)	1.08187	1,081,870
2024070903194	S	EURUSD	07/11/2024	(2,000,000)	1.0815	2,163,000
2024071003098	B	EURUSD	07/12/2024	2,000,000	1.08225	(2,164,500)
2024071003247	B	EURUSD	07/12/2024	2,000,000	1.08224	(2,164,480)
2024071003362	S	EURUSD	07/12/2024	(4,000,000)	1.0827	4,330,800
2024071203344	BO	EURMXN	07/15/2024	7,000,000	19.22828	(134,597,974)
2024071203496	S	EURMXN	07/16/2024	(1,400,000)	19.258	26,961,200
2024071203497	B	EURMXN	09/03/2024	1,400,000	19.45031	(27,230,428)
2024071603237	BO	EURMXN	07/17/2024	500,000	19.21274	(9,606,372)
2024071603242	B	EURMXN	07/17/2024	500,000	19.21274	(9,606,372)
2024071603915	BO	EURMXN	07/17/2024	2,500,000	19.2514	(48,128,508)
2024071603028	B	EURUSD	07/18/2024	1,000,000	1.08771	(1,087,710)
2024071603220	B	EURUSD	07/18/2024	1,000,000	1.08836	(1,088,360)
2024071603256	B	EURUSD	07/18/2024	1,000,000	1.08823	(1,088,230)
2024071603054	S	EURUSD	07/18/2024	(1,000,000)	1.08778	1,087,780
2024071603074	S	EURUSD	07/18/2024	(1,000,000)	1.0881	1,088,100
2024071603078	S	EURUSD	07/18/2024	(1,000,000)	1.08816	1,088,160
2024071603486	S	EURUSD	07/18/2024	(2,000,000)	1.08911	2,178,220
2024071703142	S	EURMXN	07/19/2024	(2,000,000)	19.40113	38,802,260
2024071803647	BO	EURUSD	07/19/2024	500,000	1.08967	(544,837)
2024071803030	B	EURUSD	07/22/2024	2,000,000	1.09079	(2,181,580)
2024071803384	B	EURUSD	07/22/2024	2,000,000	1.09042	(2,180,840)
2024071803041	S	EURUSD	07/22/2024	(2,000,000)	1.09095	2,181,900
2024071803202	S	EURUSD	07/22/2024	(2,000,000)	1.09153	2,183,060
2024071903542	B	EURUSD	07/23/2024	2,000,000	1.08798	(2,175,960)
2024071903563	S	EURUSD	07/23/2024	(2,000,000)	1.08769	2,175,380
2024072203574	B	EURUSD	07/24/2024	1,000,000	1.08863	(1,088,630)
2024072203577	B	EURUSD	07/24/2024	1,000,000	1.08873	(1,088,730)
2024072203080	S	EURUSD	07/24/2024	(1,000,000)	1.08836	1,088,360
2024072203216	S	EURUSD	07/24/2024	(1,000,000)	1.08835	1,088,350
2024072503417	B	EURUSD	07/29/2024	2,000,000	1.08544	(2,170,880)
2024072503105	S	EURUSD	07/29/2024	(2,000,000)	1.08521	2,170,420
2024072503556	S	EURUSD	07/29/2024	(2,000,000)	1.08465	2,169,300
2024072603568	BO	EURUSD	07/29/2024	8,000,000	1.08569	(8,685,528)
2024072603033	B	EURUSD	07/30/2024	2,000,000	1.08572	(2,171,440)
2024072603200	B	EURUSD	07/30/2024	2,000,000	1.08624	(2,172,480)
2024072603037	S	EURUSD	07/30/2024	(2,000,000)	1.08551	2,171,020
2024072603053	S	EURUSD	07/30/2024	(2,000,000)	1.08574	2,171,480
2024072903074	B	EURUSD	07/31/2024	2,000,000	1.08041	(2,160,820)
2024072903688	B	EURUSD	07/31/2024	2,000,000	1.08255	(2,165,100)
2024072903141	S	EURUSD	07/31/2024	(2,000,000)	1.08198	2,163,960
2024072903327	S	EURUSD	07/31/2024	(1,000,000)	1.08229	1,082,290
2024072903499	S	EURUSD	07/31/2024	(2,000,000)	1.08244	2,164,880
2024073003034	B	EURUSD	08/01/2024	2,000,000	1.08007	(2,160,140)
2024073003037	B	EURUSD	08/01/2024	1,000,000	1.08002	(1,080,020)
2024073003065	B	EURUSD	08/01/2024	1,000,000	1.08014	(1,080,140)
2024073003189	B	EURUSD	08/01/2024	1,000,000	1.08004	(1,080,040)
2024073003423	B	EURUSD	08/01/2024	2,000,000	1.081	(2,162,000)
2024073003695	B	EURUSD	08/01/2024	2,000,000	1.0811	(2,162,200)
2024073003205	S	EURUSD	08/01/2024	(2,000,000)	1.0805	2,161,000
2024073003206	S	EURUSD	08/01/2024	(1,000,000)	1.08061	1,080,610
2024073003207	S	EURUSD	08/01/2024	(2,000,000)	1.0807	2,161,400
2024073003288	S	EURUSD	08/01/2024	(1,000,000)	1.08107	1,081,070
2024073003339	S	EURUSD	08/01/2024	(1,000,000)	1.08121	1,081,210
2024073003561	S	EURUSD	08/01/2024	(1,000,000)	1.08153	1,081,530
2024073003571	S	EURUSD	08/01/2024	(1,000,000)	1.08159	1,081,590
2024073103086	B	EURUSD	08/02/2024	2,000,000	1.08245	(2,164,900)
2024073103098	B	EURUSD	08/02/2024	2,000,000	1.08239	(2,164,780)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024073103121 B		EURUSD	08/02/2024	1,000,000	1.08208	(1,082,080)
2024073103301 S		EURUSD	08/02/2024	(2,000,000)	1.08117	2,162,340
2024073103318 S		EURUSD	08/02/2024	(3,000,000)	1.08078	3,242,340
2024073103566 BO		EURUSD	02/03/2025	863,500	1.09019	(941,382)
2024080103052 B		EURUSD	08/05/2024	2,000,000	1.07919	(2,158,380)
2024080103092 B		EURUSD	08/05/2024	2,000,000	1.07877	(2,157,540)
2024080103332 B		EURUSD	08/05/2024	1,000,000	1.079	(1,079,000)
2024080103588 S		EURUSD	08/05/2024	(2,000,000)	1.07841	2,156,820
2024080103605 S		EURUSD	08/05/2024	(3,000,000)	1.07837	3,235,110
2024080603364 B		EURUSD	08/08/2024	2,000,000	1.09278	(2,185,560)
2024080603531 B		EURUSD	08/08/2024	2,000,000	1.09248	(2,184,960)
2024080603119 S		EURUSD	08/08/2024	(2,000,000)	1.09282	2,185,640
2024080603444 S		EURUSD	08/08/2024	(2,000,000)	1.09293	2,185,860
2024080703131 B		EURUSD	08/09/2024	2,000,000	1.09327	(2,186,540)
2024080703214 B		EURUSD	08/09/2024	2,000,000	1.0925	(2,185,000)
2024080703236 B		EURUSD	08/09/2024	2,000,000	1.09247	(2,184,940)
2024080703297 B		EURUSD	08/09/2024	2,000,000	1.09241	(2,184,820)
2024080703050 S		EURUSD	08/09/2024	(2,000,000)	1.09231	2,184,620
2024080703079 S		EURUSD	08/09/2024	(2,000,000)	1.09321	2,186,420
2024080703353 S		EURUSD	08/09/2024	(2,000,000)	1.09183	2,183,660
2024080703415 S		EURUSD	08/09/2024	(2,000,000)	1.09236	2,184,720
2024080703611 BO		EURMXN	10/08/2024	2,000,000	21.33166	(42,663,318)
2024080703613 BO		EURMXN	10/08/2024	400,000	21.32686	(8,530,743)
2024080803415 B		EURUSD	08/12/2024	2,000,000	1.09099	(2,181,980)
2024080803068 S		EURUSD	08/12/2024	(2,000,000)	1.09077	2,181,540
2024080903200 B		EURUSD	08/13/2024	2,000,000	1.09242	(2,184,840)
2024080903240 B		EURUSD	08/13/2024	2,000,000	1.09233	(2,184,660)
2024080903306 B		EURUSD	08/13/2024	2,000,000	1.09185	(2,183,700)
2024080903221 S		EURUSD	08/13/2024	(2,000,000)	1.09267	2,185,340
2024080903411 S		EURUSD	08/13/2024	(2,000,000)	1.09158	2,183,160
2024080903423 S		EURUSD	08/13/2024	(2,000,000)	1.09179	2,183,580
2024081203142 B		EURUSD	08/14/2024	2,000,000	1.09384	(2,187,680)
2024081203191 B		EURUSD	08/14/2024	2,000,000	1.0932	(2,186,400)
2024081203226 B		EURUSD	08/14/2024	2,000,000	1.09265	(2,185,300)
2024081203242 B		EURUSD	08/14/2024	2,000,000	1.09285	(2,185,700)
2024081203303 B		EURUSD	08/14/2024	1,000,000	1.09237	(1,092,370)
2024081203092 S		EURUSD	08/14/2024	(2,000,000)	1.09263	2,185,260
2024081203138 S		EURUSD	08/14/2024	(2,000,000)	1.09322	2,186,440
2024081203440 S		EURUSD	08/14/2024	(2,000,000)	1.09329	2,186,580
2024081203452 S		EURUSD	08/14/2024	(3,000,000)	1.09333	3,279,900
2024081303595 S		EURUSD	08/14/2024	(35,000,000)	1.09969	38,489,122
2024081303065 B		EURUSD	08/15/2024	2,000,000	1.0955	(2,191,000)
2024081303396 B		EURUSD	08/15/2024	3,000,000	1.09782	(3,293,460)
2024081303043 S		EURUSD	08/15/2024	(2,000,000)	1.09552	2,191,040
2024081303250 S		EURUSD	08/15/2024	(2,000,000)	1.09588	2,191,760
2024081303264 S		EURUSD	08/15/2024	(1,000,000)	1.09598	1,095,980
2024081303596 B		EURUSD	10/03/2024	35,000,000	1.10224	(38,578,313)
2024081403139 B		EURUSD	08/16/2024	2,000,000	1.10356	(2,207,120)
2024081403194 B		EURUSD	08/16/2024	2,000,000	1.10277	(2,205,540)
2024081403233 B		EURUSD	08/16/2024	1,000,000	1.10233	(1,102,330)
2024081403452 B		EURUSD	08/16/2024	2,000,000	1.10175	(2,203,500)
2024081403117 S		EURUSD	08/16/2024	(2,000,000)	1.1044	2,208,800
2024081403241 S		EURUSD	08/16/2024	(3,000,000)	1.10218	3,306,540
2024081403468 S		EURUSD	08/16/2024	(2,000,000)	1.1014	2,202,800
2024081503454 B		EURUSD	08/19/2024	3,000,000	1.0975	(3,292,500)
2024081503479 B		EURUSD	08/19/2024	2,000,000	1.0974	(2,194,800)
2024081503074 S		EURUSD	08/19/2024	(2,000,000)	1.09826	2,196,520
2024081503228 S		EURUSD	08/19/2024	(2,000,000)	1.09873	2,197,460
2024081503247 S		EURUSD	08/19/2024	(1,000,000)	1.09866	1,098,660
2024081603043 B		EURUSD	08/20/2024	2,000,000	1.099	(2,198,000)
2024081603062 B		EURUSD	08/20/2024	2,000,000	1.09882	(2,197,640)
2024081603366 B		EURUSD	08/20/2024	2,000,000	1.10091	(2,201,820)
2024081603016 S		EURUSD	08/20/2024	(2,000,000)	1.10028	2,200,560
2024081603108 S		EURUSD	08/20/2024	(2,000,000)	1.0995	2,199,000
2024081603256 S		EURUSD	08/20/2024	(2,000,000)	1.10019	2,200,380
2024081903277 B		EURUSD	08/21/2024	2,000,000	1.10732	(2,214,640)
2024081903286 B		EURUSD	08/21/2024	2,000,000	1.10714	(2,214,280)
2024081903072 S		EURUSD	08/21/2024	(2,000,000)	1.10664	2,213,280
2024081903232 S		EURUSD	08/21/2024	(2,000,000)	1.1069	2,213,800
2024082003515 S		EURUSD	08/21/2024	(65,000,000)	1.11155	72,250,711
2024082003046 B		EURUSD	08/22/2024	2,000,000	1.10954	(2,219,080)
2024082003064 B		EURUSD	08/22/2024	2,000,000	1.11127	(2,222,540)
2024082003176 B		EURUSD	08/22/2024	1,000,000	1.11028	(1,110,280)
2024082003283 B		EURUSD	08/22/2024	2,000,000	1.11049	(2,220,980)
2024082003035 S		EURUSD	08/22/2024	(2,000,000)	1.11017	2,220,340
2024082003062 S		EURUSD	08/22/2024	(2,000,000)	1.11042	2,220,840
2024082003347 S		EURUSD	08/22/2024	(2,000,000)	1.1111	2,222,240
2024082003349 S		EURUSD	08/22/2024	(1,000,000)	1.11135	1,111,350
2024082003516 B		EURUSD	10/09/2024	65,000,000	1.11408	(72,415,330)
2024082103195 B		EURUSD	08/23/2024	2,000,000	1.11463	(2,229,260)
2024082103199 B		EURUSD	08/23/2024	2,000,000	1.11478	(2,229,560)
2024082103111 S		EURUSD	08/23/2024	(2,000,000)	1.11252	2,225,040
2024082103116 S		EURUSD	08/23/2024	(2,000,000)	1.11288	2,225,760
2024082203025 B		EURUSD	08/26/2024	2,000,000	1.11152	(2,223,040)
2024082203044 B		EURUSD	08/26/2024	2,000,000	1.11023	(2,220,460)
2024082203426 B		EURUSD	08/26/2024	2,000,000	1.11007	(2,220,140)
2024082203031 S		EURUSD	08/26/2024	(1,000,000)	1.10981	1,109,810
2024082203032 S		EURUSD	08/26/2024	(1,000,000)	1.111	1,111,000
2024082203526 S		EURUSD	08/26/2024	(4,000,000)	1.111	4,444,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024082303047 B		EURUSD	08/27/2024	2,000,000	1.11626	(2,232,520)
2024082303300 B		EURUSD	08/27/2024	2,000,000	1.11704	(2,234,080)
2024082303033 S		EURUSD	08/27/2024	(2,000,000)	1.11602	2,232,040
2024082303390 S		EURUSD	08/27/2024	(2,000,000)	1.11825	2,236,500
2024082603113 B		EURUSD	08/28/2024	2,000,000	1.1167	(2,233,400)
2024082603151 B		EURUSD	08/28/2024	1,000,000	1.11636	(1,116,360)
2024082603218 B		EURUSD	08/28/2024	1,000,000	1.11643	(1,116,430)
2024082603480 B		EURUSD	08/28/2024	2,000,000	1.1161	(2,232,200)
2024082603062 S		EURUSD	08/28/2024	(2,000,000)	1.1176	2,235,200
2024082603346 S		EURUSD	08/28/2024	(2,000,000)	1.1175	2,235,000
2024082603577 S		EURUSD	08/28/2024	(2,000,000)	1.11612	2,232,240
2024082703207 B		EURUSD	08/29/2024	2,000,000	1.11619	(2,232,380)
2024082703426 B		EURUSD	08/29/2024	2,000,000	1.11649	(2,232,980)
2024082703038 S		EURUSD	08/29/2024	(2,000,000)	1.117	2,234,000
2024082703285 S		EURUSD	08/29/2024	(2,000,000)	1.11672	2,233,440
2024082803435 B		EURUSD	08/30/2024	2,000,000	1.11121	(2,222,420)
2024082803475 S		EURUSD	08/30/2024	(2,000,000)	1.11068	2,221,360
2024082903663 BO		EURMXN	08/30/2024	4,000,000	21.93186	(87,727,452)
2024082903666 B		EURMXN	08/30/2024	15,000,000	21.93307	(328,995,990)
2024082903667 S		EURMXN	09/03/2024	(15,000,000)	21.9512	329,268,000
2024083003783 BO		EURMXN	08/30/2024	5,000,000	21.7406	(108,703,015)
2024090303480 S		EURMXN	09/04/2024	(400,000)	21.90482	8,761,929
2024090303485 S		EURMXN	09/04/2024	(1,000,000)	21.90841	21,908,413
2024090303516 S		EURMXN	09/04/2024	(1,400,000)	21.90482	30,666,751
2024090303044 B		EURUSD	09/05/2024	2,000,000	1.10389	(2,207,780)
2024090303065 B		EURUSD	09/05/2024	2,000,000	1.10399	(2,207,980)
2024090303086 B		EURUSD	09/05/2024	1,000,000	1.10389	(1,103,890)
2024090303059 S		EURUSD	09/05/2024	(2,000,000)	1.10476	2,209,520
2024090303541 S		EURUSD	09/05/2024	(3,000,000)	1.10305	3,309,150
2024090303481 B		EURMXN	10/03/2024	400,000	22.03472	(8,813,888)
2024090303486 B		EURMXN	10/03/2024	1,000,000	22.03824	(22,038,242)
2024090303517 B		EURMXN	10/03/2024	1,400,000	22.03472	(30,848,607)
2024090403118 B		EURUSD	09/06/2024	2,000,000	1.10871	(2,217,420)
2024090403044 S		EURUSD	09/06/2024	(2,000,000)	1.10815	2,216,300
2024090503041 B		EURUSD	09/09/2024	2,000,000	1.10881	(2,217,620)
2024090503348 B		EURUSD	09/09/2024	2,000,000	1.11051	(2,221,020)
2024090503074 S		EURUSD	09/09/2024	(2,000,000)	1.10846	2,216,920
2024090503271 S		EURUSD	09/09/2024	(2,000,000)	1.10998	2,219,960
2024090903043 B		EURUSD	09/11/2024	2,000,000	1.10378	(2,207,560)
2024090903204 B		EURMXN	09/11/2024	30,000,000	21.9507	(658,521,000)
2024090903286 S		EURUSD	09/11/2024	(2,000,000)	1.10484	2,209,680
2024090903134 SO		EURMXN	09/13/2024	(20,000,000)	21.94999	438,999,740
2024090903205 S		EURMXN	09/13/2024	(30,000,000)	21.95949	658,784,847
2024091003061 B		EURUSD	09/12/2024	2,000,000	1.10183	(2,203,660)
2024091003451 B		EURUSD	09/12/2024	2,000,000	1.10257	(2,205,140)
2024091003088 S		EURUSD	09/12/2024	(2,000,000)	1.1021	2,204,200
2024091003202 S		EURUSD	09/12/2024	(2,000,000)	1.10263	2,205,260
2024091103038 B		EURUSD	09/13/2024	2,000,000	1.10051	(2,201,020)
2024091103052 B		EURUSD	09/13/2024	2,000,000	1.10063	(2,201,260)
2024091103203 S		EURUSD	09/13/2024	(2,000,000)	1.10131	2,202,620
2024091103204 S		EURUSD	09/13/2024	(2,000,000)	1.10136	2,202,720
2024091203081 B		EURUSD	09/16/2024	2,000,000	1.10395	(2,207,900)
2024091203028 S		EURUSD	09/16/2024	(2,000,000)	1.10365	2,207,300
2024091303244 B		EURUSD	09/17/2024	2,000,000	1.10789	(2,215,780)
2024091303256 B		EURUSD	09/17/2024	2,000,000	1.10812	(2,216,240)
2024091303461 S		EURUSD	09/17/2024	(2,000,000)	1.1084	2,216,800
2024091303473 S		EURUSD	09/17/2024	(2,000,000)	1.10834	2,216,680
2024091803040 B		EURUSD	09/20/2024	2,000,000	1.11185	(2,223,700)
2024091803516 B		EURUSD	09/20/2024	2,000,000	1.11836	(2,236,720)
2024091803078 S		EURUSD	09/20/2024	(2,000,000)	1.11162	2,223,240
2024091803498 S		EURUSD	09/20/2024	(2,000,000)	1.11731	2,234,620
2024091903040 B		EURUSD	09/23/2024	2,000,000	1.11202	(2,224,040)
2024091903584 B		EURUSD	09/23/2024	2,000,000	1.11603	(2,232,060)
2024091903613 B		EURUSD	09/23/2024	2,000,000	1.11622	(2,232,440)
2024091903084 S		EURUSD	09/23/2024	(2,000,000)	1.113	2,226,000
2024091903168 S		EURUSD	09/23/2024	(2,000,000)	1.11449	2,228,980
2024091903277 S		EURUSD	09/23/2024	(2,000,000)	1.11574	2,231,480
2024091903341 S		EURUSD	09/23/2024	(2,000,000)	1.11558	2,231,160
2024092003161 B		EURUSD	09/24/2024	2,000,000	1.11393	(2,227,860)
2024092003462 B		EURUSD	09/24/2024	2,000,000	1.1165	(2,233,000)
2024092003184 S		EURUSD	09/24/2024	(2,000,000)	1.11495	2,229,900
2024092003237 S		EURUSD	09/24/2024	(2,000,000)	1.11631	2,232,620
2024092303143 B		EURUSD	09/25/2024	2,000,000	1.11268	(2,225,360)
2024092303205 S		EURUSD	09/25/2024	(2,000,000)	1.1136	2,227,200
2024092403069 B		EURUSD	09/26/2024	2,000,000	1.115	(2,230,000)
2024092403054 S		EURUSD	09/26/2024	(2,000,000)	1.11603	2,232,060
2024092503035 B		EURUSD	09/27/2024	2,000,000	1.11842	(2,236,840)
2024092503050 S		EURUSD	09/27/2024	(2,000,000)	1.11702	2,234,040
2024071703349 BO		GBPUSD	07/18/2024	15,000,000	1.30039	(19,505,910)
2024071703361 B		GBPUSD	07/18/2024	15,000,000	1.30039	(19,505,910)
2024070103260 S		USDMXN	07/02/2024	(106,000,000)	18.36	1,946,160,000
2024070103018 S		USDMXN	07/03/2024	(1,000,000)	18.40083	18,400,830
2024070103143 S		USDMXN	07/03/2024	(1,000,000)	18.37881	18,378,810
2024070103262 S		USDMXN	07/03/2024	(2,000,000)	18.36161	36,723,220
2024070103563 S		USDMXN	07/03/2024	(912)	18.34847	16,735
2024070103064 B		USDMXN	07/03/2024	2,000,000	18.44454	(36,889,080)
2024070103124 B		USDMXN	07/03/2024	2,000,000	18.40623	(36,812,460)
2024070103261 B		USDMXN	07/03/2024	106,000,000	18.362	(1,946,372,000)
2024070103702 B		USDMXN	07/03/2024	600,000	18.37887	(11,027,322)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024070103705	B	USDMXN	07/03/2024	52,800	18.37669	(970,289)
2024070103562	BO	USDMXN	07/17/2024	86,660	18.39361	(1,593,990)
2024070103482	BO	USDMXN	07/22/2024	32,750	18.41875	(603,214)
2024070103481	BO	USDMXN	07/31/2024	39,050	18.4441	(720,242)
2024070203147	S	USDMXN	07/02/2024	(100,000,000)	18.23	1,823,000,000
2024070203136	B	USDMXN	07/02/2024	50,000,000	18.245	(912,250,000)
2024070203139	B	USDMXN	07/02/2024	50,000,000	18.23	(911,500,000)
2024070203137	S	USDMXN	07/03/2024	(50,000,000)	18.2472	912,360,000
2024070203140	S	USDMXN	07/03/2024	(50,000,000)	18.23215	911,607,500
2024070203196	S	USDMXN	07/03/2024	(8,603,190)	18.24341	156,951,558
2024070203156	S	USDMXN	07/05/2024	(1,000,000)	18.2462	18,246,200
2024070203159	S	USDMXN	07/05/2024	(1,000,000)	18.25203	18,252,030
2024070203275	S	USDMXN	07/05/2024	(3,000,000)	18.21847	54,655,410
2024070203426	S	USDMXN	07/05/2024	(1,000,000)	18.23796	18,237,960
2024070203441	S	USDMXN	07/05/2024	(1,000,000)	18.23469	18,234,690
2024070203467	S	USDMXN	07/05/2024	(1,000,000)	18.24668	18,246,680
2024070203741	S	USDMXN	07/05/2024	(25,000,000)	18.25	456,250,000
2024070203808	S	USDMXN	07/05/2024	(291,563)	18.26944	5,326,693
2024070203065	B	USDMXN	07/05/2024	1,000,000	18.25546	(18,255,460)
2024070203121	B	USDMXN	07/05/2024	1,000,000	18.24502	(18,245,020)
2024070203197	B	USDMXN	07/05/2024	8,603,190	18.24739	(156,985,764)
2024070203212	B	USDMXN	07/05/2024	1,000,000	18.23432	(18,234,320)
2024070203720	B	USDMXN	07/05/2024	2,000,000	18.26	(36,520,000)
2024070203731	B	USDMXN	07/05/2024	2,000,000	18.255	(36,510,000)
2024070203148	B	USDMXN	07/10/2024	100,000,000	18.246	(1,824,600,000)
2024070203742	B	USDMXN	04/07/2025	25,000,000	19.0515	(476,287,500)
2024070303579	S	USDMXN	07/03/2024	(1,000)	18.15	18,150
2024070303558	S	USDMXN	07/05/2024	(25,000,000)	18.15712	453,928,025
2024070303580	B	USDMXN	07/05/2024	1,000	18.156	(18,156)
2024070303010	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.13704	18,137,040
2024070303011	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.13178	18,131,780
2024070303029	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.13381	18,133,810
2024070303032	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.13538	18,135,380
2024070303038	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.13608	18,136,080
2024070303104	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.1464	18,146,400
2024070303106	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.14414	18,144,140
2024070303118	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.16038	18,160,380
2024070303147	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.11935	18,119,350
2024070303150	S	USDMXN	07/08/2024	(50,000,000)	18.11	905,500,000
2024070303155	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.12823	18,128,230
2024070303343	S	USDMXN	07/08/2024	(2,000,000)	18.14	36,280,000
2024070303390	S	USDMXN	07/08/2024	(30,000,000)	18.136	544,080,000
2024070303039	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.13517	(18,135,170)
2024070303040	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.13462	(18,134,620)
2024070303093	B	USDMXN	07/08/2024	2,000,000	18.14	(36,280,000)
2024070303096	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.13567	(18,135,670)
2024070303124	B	USDMXN	07/08/2024	3,000,000	18.13	(54,390,000)
2024070303136	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.12487	(18,124,870)
2024070303137	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.12317	(18,123,170)
2024070303530	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.1742	(18,174,200)
2024070303559	B	USDMXN	07/08/2024	25,000,000	18.16449	(454,112,250)
2024070303584	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.17614	(18,176,140)
2024070303585	B	USDMXN	07/08/2024	450,000	18.17843	(8,180,294)
2024070303781	B	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.19697	(18,196,970)
2024070303783	B	USDMXN	07/08/2024	84,478	18.19811	(1,537,340)
2024070303798	B	USDMXN	07/08/2024	800,000	18.18595	(14,548,760)
2024070303108	SO	USDMXN	07/10/2024	(1,000,000)	18.14192	18,141,924
2024070303189	BO	USDMXN	08/21/2024	95,060	18.24772	(1,734,628)
2024070303391	B	USDMXN	10/08/2024	30,000,000	18.399	(551,970,000)
2024070303151	B	USDMXN	01/08/2025	50,000,000	18.638	(931,900,000)
2024070303169	BO	USDMXN	01/08/2025	350,000	18.65264	(6,528,424)
2024070403635	S	USDMXN	07/08/2024	(1,000,000)	18.09	18,090,000
2024070403645	S	USDMXN	07/08/2024	(9,542)	18.09426	172,660
2024070403523	B	USDMXN	07/08/2024	500,000	18.098	(9,049,000)
2024070403526	B	USDMXN	07/08/2024	500,000	18.098	(9,049,000)
2024070403536	B	USDMXN	07/08/2024	450,000	18.095	(8,142,750)
2024070403548	B	USDMXN	07/08/2024	105,460	18.09704	(1,908,514)
2024070503004	BO	USDMXN	07/08/2024	1,000,000	18.1662	(18,166,203)
2024070503855	S	USDMXN	07/09/2024	(218,111)	18.10491	3,948,880
2024070503712	B	USDMXN	07/09/2024	154,400	18.08973	(2,793,054)
2024070803125	S	USDMXN	07/10/2024	(1,000,000)	18	18,000,000
2024070803134	S	USDMXN	07/10/2024	(1,000,000)	18.00033	18,000,330
2024070803142	S	USDMXN	07/10/2024	(1,000,000)	18.01355	18,013,550
2024070803253	S	USDMXN	07/10/2024	(1,000,000)	18.01343	18,013,430
2024070803467	S	USDMXN	07/10/2024	(100,000,000)	18	1,800,000,000
2024070803670	S	USDMXN	07/10/2024	(100,000,000)	17.995	1,799,500,000
2024070803422	B	USDMXN	07/10/2024	1,500,000	17.99	(26,985,000)
2024070803446	B	USDMXN	07/10/2024	2,750,000	17.99	(49,472,500)
2024070803572	B	USDMXN	07/10/2024	220,000	17.97925	(3,955,435)
2024070803674	B	USDMXN	07/10/2024	283,645	17.9972	(5,104,807)
2024070803671	B	USDMXN	07/17/2024	100,000,000	18.0147	(1,801,470,000)
2024070803468	B	USDMXN	08/09/2024	100,000,000	18.082	(1,808,200,000)
2024070903046	S	USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.92926	17,929,260
2024070903049	S	USDMXN	07/11/2024	(20,000,000)	17.948	358,960,000
2024070903079	S	USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.95	17,950,000
2024070903095	S	USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.95372	17,953,720
2024070903101	S	USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.95128	17,951,280
2024070903454	S	USDMXN	07/11/2024	(30,000,000)	17.935	538,050,000
2024070903547	S	USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.89859	17,898,590

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024070903548 S		USDMXN	07/11/2024	(1,000,000)	17.90018	17,900,180
2024070903674 S		USDMXN	07/11/2024	(246,281)	17.91099	4,411,131
2024070903043 B		USDMXN	07/11/2024	1,000,000	17.94547	(17,945,470)
2024070903059 B		USDMXN	07/11/2024	1,000,000	17.92152	(17,921,520)
2024070903110 B		USDMXN	07/11/2024	50,000,000	17.95	(897,500,000)
2024070903200 B		USDMXN	07/11/2024	2,000,000	17.94	(35,880,000)
2024070903385 B		USDMXN	07/11/2024	2,000,000	17.93	(35,860,000)
2024070903111 S		USDMXN	07/12/2024	(50,000,000)	17.95275	897,637,500
2024070903192 S		USDMXN	07/25/2024	(100,000,000)	17.9994	1,799,940,000
2024070903193 B		USDMXN	08/01/2024	100,000,000	18.0194	(1,801,940,000)
2024070903518 BO		USDMXN	08/14/2024	59,040	18.00909	(1,063,257)
2024070903517 BO		USDMXN	09/11/2024	28,796	18.08864	(520,881)
2024070903707 BO		USDMXN	11/27/2024	244,108	18.31568	(4,471,003)
2024070903050 B		USDMXN	04/11/2025	20,000,000	18.733	(374,660,000)
2024070903455 B		USDMXN	07/11/2025	30,000,000	18.988	(569,640,000)
2024071003093 S		USDMXN	07/12/2024	(1,000,000)	17.84027	17,840,270
2024071003095 S		USDMXN	07/12/2024	(1,000,000)	17.84061	17,840,610
2024071003601 S		USDMXN	07/12/2024	(1,000,000)	17.83	17,830,000
2024071003050 B		USDMXN	07/12/2024	2,000,000	17.815	(35,630,000)
2024071003053 B		USDMXN	07/12/2024	2,000,000	17.815	(35,630,000)
2024071003061 B		USDMXN	07/12/2024	2,000,000	17.815	(35,630,000)
2024071003107 B		USDMXN	07/12/2024	100,000,000	17.85	(1,785,000,000)
2024071003289 B		USDMXN	07/12/2024	1,000,000	17.82069	(17,820,690)
2024071003347 B		USDMXN	07/12/2024	50,000,000	17.828	(891,400,000)
2024071003566 B		USDMXN	07/12/2024	1,000,000	17.84	(17,840,000)
2024071003699 B		USDMXN	07/12/2024	132,806	17.80655	(2,364,810)
2024071003349 S		USDMXN	07/15/2024	(50,000,000)	17.83615	891,807,500
2024071003360 B		USDMXN	07/15/2024	50,000,000	17.828	(891,400,000)
2024071003108 S		USDMXN	07/19/2024	(100,000,000)	17.8693	1,786,930,000
2024071003361 S		USDMXN	08/12/2024	(50,000,000)	17.906	895,300,000
2024071003588 BO		USDMXN	08/21/2024	44,200	17.9423	(793,050)
2024071003587 BO		USDMXN	09/04/2024	57,200	17.9815	(1,028,542)
2024071003603 SO		USDMXN	11/15/2024	(250,000)	18.17765	4,544,411
2024071003590 BO		USDMXN	11/15/2024	250,000	18.18506	(4,546,264)
2024071103761 B		USDMXN	07/15/2024	789,539	17.79558	(14,050,313)
2024071103643 BO		USDMXN	07/19/2024	658,098	17.77378	(11,696,886)
2024071103653 BO		USDMXN	07/22/2024	50,000	17.84971	(892,485)
2024071103587 BO		USDMXN	07/24/2024	49,000	17.78335	(871,384)
2024071103678 BO		USDMXN	07/24/2024	69,600	17.78815	(1,238,055)
2024071103566 BO		USDMXN	07/29/2024	150,000	17.79276	(2,668,914)
2024071103657 BO		USDMXN	07/29/2024	50,000	17.86944	(893,472)
2024071103567 BO		USDMXN	07/30/2024	150,000	17.79552	(2,669,327)
2024071103671 BO		USDMXN	07/30/2024	100,000	17.80562	(1,780,562)
2024071103670 BO		USDMXN	08/01/2024	100,000	17.81113	(1,781,113)
2024071103674 BO		USDMXN	08/01/2024	1,665,500	17.81077	(29,663,836)
2024071103654 BO		USDMXN	08/05/2024	50,000	17.88888	(894,444)
2024071103581 BO		USDMXN	08/06/2024	50,000	17.81911	(890,956)
2024071103655 BO		USDMXN	08/12/2024	50,000	17.90827	(895,413)
2024071103659 BO		USDMXN	08/19/2024	50,000	17.92766	(896,383)
2024071103645 BO		USDMXN	08/21/2024	50,000	17.86544	(893,272)
2024071103679 BO		USDMXN	08/21/2024	82,350	17.86543	(1,471,218)
2024071103656 BO		USDMXN	08/26/2024	50,000	17.94707	(897,354)
2024071103681 BO		USDMXN	08/28/2024	82,350	17.88468	(1,472,803)
2024071103658 BO		USDMXN	09/03/2024	50,000	17.9692	(898,460)
2024071103680 BO		USDMXN	09/04/2024	81,700	17.9039	(1,462,749)
2024071103663 BO		USDMXN	09/09/2024	50,000	17.9858	(899,290)
2024071103662 BO		USDMXN	09/17/2024	50,000	18.00793	(900,396)
2024071103660 BO		USDMXN	09/23/2024	50,000	18.0258	(901,290)
2024071103673 BO		USDMXN	09/26/2024	100,000	17.96676	(1,796,676)
2024071103664 BO		USDMXN	09/30/2024	50,000	18.04568	(902,284)
2024071103672 BO		USDMXN	10/02/2024	100,000	17.98334	(1,798,334)
2024071103665 BO		USDMXN	10/07/2024	50,000	18.06524	(903,262)
2024071103661 BO		USDMXN	10/15/2024	50,000	18.0876	(904,380)
2024071103667 BO		USDMXN	10/21/2024	50,000	18.10473	(905,237)
2024071103666 BO		USDMXN	10/28/2024	50,000	18.12473	(906,236)
2024071203769 S		USDMXN	07/16/2024	(8,100)	17.61211	142,650
2024071203774 S		USDMXN	07/16/2024	(500,000)	17.6111	8,805,550
2024071203682 BO		USDMXN	07/31/2024	54,000	17.66568	(953,947)
2024071203764 BO		USDMXN	07/31/2024	54,000	17.65889	(953,580)
2024071203767 SO		USDMXN	08/05/2024	(280,000)	17.66509	4,946,224
2024071203738 BO		USDMXN	08/07/2024	68,900	17.6928	(1,219,034)
2024071203736 BO		USDMXN	08/14/2024	38,650	17.71191	(684,565)
2024071203735 BO		USDMXN	08/21/2024	16,400	17.72521	(290,693)
2024071203375 BO		USDMXN	11/15/2024	250,000	18.02857	(4,507,144)
2024071203765 BO		USDMXN	07/09/2025	250,000	18.62318	(4,655,794)
2024071203766 BO		USDMXN	08/13/2025	450,000	18.7367	(8,431,515)
2024071503053 B		USDMXN	07/17/2024	2,000,000	17.845	(35,690,000)
2024071503054 B		USDMXN	07/17/2024	3,000,000	17.845	(53,535,000)
2024071503538 B		USDMXN	07/17/2024	184,606	17.77995	(3,282,285)
2024071503499 BO		USDMXN	07/31/2024	10,000	17.84234	(178,423)
2024071503405 SO		USDMXN	08/05/2024	(120,000)	17.90522	2,148,627
2024071503406 SO		USDMXN	08/05/2024	(158,000)	17.90521	2,829,023
2024071503067 BO		USDMXN	01/22/2025	750,000	18.36696	(13,775,222)
2024071503094 BO		USDMXN	03/26/2025	750,000	18.54553	(13,909,144)
2024071603307 S		USDMXN	07/18/2024	(1,000,000)	17.68	17,680,000
2024071603471 S		USDMXN	07/18/2024	(50,000,000)	17.68	884,000,000
2024071603556 S		USDMXN	07/18/2024	(1,000,000)	17.6605	17,660,500
2024071603698 S		USDMXN	07/18/2024	(3,709,743)	17.64783	65,468,922
2024071603064 B		USDMXN	07/18/2024	2,000,000	17.695	(35,390,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024071603255	B	USDMXN	07/18/2024	1,000,000	17.6582	(17,658,200)
2024071603485	B	USDMXN	07/18/2024	2,000,000	17.66421	(35,328,420)
2024071603856	B	USDMXN	07/18/2024	285,304	17.66383	(5,039,561)
2024071603472	B	USDMXN	07/25/2024	50,000,000	17.6995	(884,975,000)
2024071603430	BO	USDMXN	08/21/2024	77,000	17.77867	(1,368,957)
2024071603479	BO	USDMXN	05/28/2025	150,000	18.55741	(2,783,611)
2024071603480	BO	USDMXN	07/23/2025	350,000	18.71892	(6,551,622)
2024071703109	S	USDMXN	07/19/2024	(1,000,000)	17.73175	17,731,750
2024071703120	S	USDMXN	07/19/2024	(3,000,000)	17.73437	53,203,110
2024071703125	S	USDMXN	07/19/2024	(2,000,000)	17.75	35,500,000
2024071703126	S	USDMXN	07/19/2024	(2,000,000)	17.75	35,500,000
2024071703318	S	USDMXN	07/19/2024	(50,000,000)	17.754	887,700,000
2024071703558	S	USDMXN	07/19/2024	(1,000,000)	17.71	17,710,000
2024071703559	S	USDMXN	07/19/2024	(674,000)	17.71102	11,937,227
2024071703615	S	USDMXN	07/19/2024	(100,000)	17.70579	1,770,579
2024071703043	B	USDMXN	07/19/2024	1,000,000	17.75561	(17,755,610)
2024071703077	B	USDMXN	07/19/2024	1,000,000	17.75063	(17,750,630)
2024071703357	B	USDMXN	07/19/2024	2,000,000	17.735	(35,470,000)
2024071703372	B	USDMXN	07/19/2024	1,000,000	17.73	(17,730,000)
2024071703491	B	USDMXN	07/19/2024	1,000,000	17.7075	(17,707,500)
2024071703530	B	USDMXN	07/19/2024	1,860,060	17.70856	(32,938,987)
2024071703373	BO	USDMXN	07/25/2024	51,476	17.74826	(913,610)
2024071703616	B	USDMXN	07/25/2024	100,000	17.72264	(1,772,264)
2024071703319	B	USDMXN	10/21/2024	50,000,000	18.017	(900,850,000)
2024071703470	S	USDMXN	04/21/2025	(20,000,000)	18.4975	369,950,000
2024071703471	B	USDMXN	07/21/2025	20,000,000	18.7625	(375,250,000)
2024071803037	B	USDMXN	07/19/2024	112,214,554	17.823	(2,000,000,000)
2024071803317	B	USDMXN	07/19/2024	35,000,000	17.931	(627,585,000)
2024071803038	S	USDMXN	07/22/2024	(112,162,950)	17.8312	2,000,000,000
2024071803042	S	USDMXN	07/22/2024	(51,924)	17.85015	926,849
2024071803044	S	USDMXN	07/22/2024	(1,000,000)	17.84719	17,847,190
2024071803052	S	USDMXN	07/22/2024	(1,000,000)	17.86045	17,860,450
2024071803063	S	USDMXN	07/22/2024	(1,000,000)	17.85432	17,854,320
2024071803318	S	USDMXN	07/22/2024	(35,000,000)	17.9392	627,872,000
2024071803338	S	USDMXN	07/22/2024	(2,000,000)	17.98504	35,970,080
2024071803340	S	USDMXN	07/22/2024	(5,000,000)	17.9915	89,957,500
2024071803353	S	USDMXN	07/22/2024	(3,000,000)	17.99	53,970,000
2024071803473	S	USDMXN	07/22/2024	(2,000,000)	17.99801	35,995,020
2024071803205	B	USDMXN	07/22/2024	1,000,000	17.87536	(17,875,360)
2024071803206	B	USDMXN	07/22/2024	1,000,000	17.88071	(17,880,710)
2024071803208	B	USDMXN	07/22/2024	1,000,000	17.88307	(17,883,070)
2024071803329	B	USDMXN	07/22/2024	5,000,000	17.95179	(89,758,950)
2024071803400	B	USDMXN	07/22/2024	466,935	18.01164	(8,410,259)
2024071803439	B	USDMXN	07/22/2024	200,000,000	17.978	(3,595,600,000)
2024071803443	B	USDMXN	07/22/2024	2,000,000	17.96549	(35,930,980)
2024071803608	B	USDMXN	07/22/2024	18,211	17.98629	(327,552)
2024071803440	S	USDMXN	07/23/2024	(200,000,000)	17.9807	3,596,140,000
2024071803388	SO	USDMXN	12/30/2024	(200,000)	18.482	3,696,400
2024071903460	BO	USDMXN	07/19/2024	5,000,000	18.02805	(90,140,250)
2024071903026	S	USDMXN	07/23/2024	(1,000,000)	17.90067	17,900,670
2024071903176	B	USDMXN	07/23/2024	1,000,000	17.95	(17,950,000)
2024071903459	B	USDMXN	07/23/2024	25,000	18.0186	(450,465)
2024071903490	B	USDMXN	07/23/2024	3,000,000	18.07022	(54,210,660)
2024071903502	B	USDMXN	07/23/2024	3,000,000	18.0698	(54,209,400)
2024071903561	B	USDMXN	07/23/2024	20,000,000	18.09	(361,800,000)
2024071903642	B	USDMXN	07/23/2024	1,000,000	18.07731	(18,077,310)
2024071903645	B	USDMXN	07/23/2024	2,000,000	18.07657	(36,153,140)
2024071903706	B	USDMXN	07/23/2024	364,090	18.08575	(6,584,833)
2024071903562	S	USDMXN	07/23/2025	(20,000,000)	19.155	383,100,000
2024072203589	B	USDMXN	07/23/2024	30,000,000	17.936	(538,080,000)
2024072203068	S	USDMXN	07/24/2024	(2,000,000)	17.92883	35,857,660
2024072203085	S	USDMXN	07/24/2024	(1,000,000)	17.9111	17,911,100
2024072203139	S	USDMXN	07/24/2024	(1,000,000)	17.9342	17,934,200
2024072203590	S	USDMXN	07/24/2024	(30,000,000)	17.93875	538,162,500
2024072203061	B	USDMXN	07/24/2024	1,000,000	17.94988	(17,949,880)
2024072203270	B	USDMXN	07/24/2024	3,000,000	17.9	(53,700,000)
2024072203533	B	USDMXN	07/24/2024	50,000,000	17.933	(896,650,000)
2024072203072	BO	USDMXN	08/23/2024	700,000	18.02163	(12,615,138)
2024072203534	S	USDMXN	10/24/2024	(50,000,000)	18.1935	909,675,000
2024072203591	BO	USDMXN	11/15/2024	200,000	18.26365	(3,652,730)
2024072303494	S	USDMXN	07/25/2024	(5,000,000)	18.155	90,775,000
2024072303701	S	USDMXN	07/25/2024	(400,000)	18.17435	7,269,740
2024072303151	B	USDMXN	07/25/2024	50,000,000	18.055	(902,750,000)
2024072303153	B	USDMXN	07/25/2024	50,000,000	18.06	(903,000,000)
2024072303507	B	USDMXN	07/25/2024	411,516	18.15611	(7,471,530)
2024072303722	B	USDMXN	07/25/2024	199,401	18.17049	(3,623,207)
2024072303668	SO	USDMXN	07/31/2024	(2,500,000)	18.17621	45,440,515
2024072303154	S	USDMXN	08/26/2024	(50,000,000)	18.1502	907,510,000
2024072303570	SO	USDMXN	09/30/2024	(142,167)	18.32728	2,605,534
2024072303571	SO	USDMXN	10/15/2024	(141,889)	18.37338	2,606,980
2024072303569	SO	USDMXN	10/23/2024	(621,355)	18.39249	11,428,264
2024072303152	S	USDMXN	10/25/2024	(50,000,000)	18.3165	915,825,000
2024072303572	SO	USDMXN	10/29/2024	(141,589)	18.41269	2,607,034
2024072403199	S	USDMXN	07/26/2024	(1,000,000)	18.39	18,390,000
2024072403202	S	USDMXN	07/26/2024	(8,000,000)	18.39	147,120,000
2024072403504	S	USDMXN	07/26/2024	(20,000,000)	18.2975	365,950,000
2024072403486	SO	USDMXN	08/15/2024	(3,000,000)	18.40962	55,228,848
2024072403505	B	USDMXN	04/28/2025	20,000,000	19.111	(382,220,000)
2024072503058	S	USDMXN	07/29/2024	(4,000,000)	18.4	73,600,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024072503244	S	USDMXN	07/29/2024	(1,000,000)	18.3208	18,320,800
2024072503252	S	USDMXN	07/29/2024	(1,000,000)	18.35	18,350,000
2024072503326	S	USDMXN	07/29/2024	(1,000,000)	18.38994	18,389,940
2024072503330	S	USDMXN	07/29/2024	(1,000,000)	18.40335	18,403,350
2024072503665	S	USDMXN	07/29/2024	(1,000,000)	18.45	18,450,000
2024072503666	S	USDMXN	07/29/2024	(2,000,000)	18.455	36,910,000
2024072503003	B	USDMXN	07/29/2024	2,000,000	18.34372	(36,687,440)
2024072503008	B	USDMXN	07/29/2024	2,000,000	18.34954	(36,699,080)
2024072503114	B	USDMXN	07/29/2024	1,000,000	18.36537	(18,365,370)
2024072503143	B	USDMXN	07/29/2024	1,000,000	18.35824	(18,358,240)
2024072503555	B	USDMXN	07/29/2024	2,000,000	18.45468	(36,909,360)
2024072503624	B	USDMXN	07/29/2024	206,003	18.43382	(3,797,419)
2024072503714	B	USDMXN	07/29/2024	77,471	18.45665	(1,429,850)
2024072503760	B	USDMXN	07/30/2024	29,560	18.4602	(545,684)
2024072603025	S	USDMXN	07/30/2024	(30,000,000)	18.399	551,970,000
2024072603032	S	USDMXN	07/30/2024	(1,000,000)	18.47223	18,472,230
2024072603038	S	USDMXN	07/30/2024	(50,000,000)	18.4375	921,875,000
2024072603115	S	USDMXN	07/30/2024	(1,000,000)	18.45	18,450,000
2024072603212	S	USDMXN	07/30/2024	(1,000,000)	18.37705	18,377,050
2024072603213	S	USDMXN	07/30/2024	(1,000,000)	18.37076	18,370,760
2024072603740	S	USDMXN	07/30/2024	(1,000,000)	18.46284	18,462,840
2024072603035	B	USDMXN	07/30/2024	1,000,000	18.45001	(18,450,010)
2024072603041	B	USDMXN	07/30/2024	50,000,000	18.4375	(921,875,000)
2024072603062	B	USDMXN	07/30/2024	2,000,000	18.46076	(36,921,520)
2024072603081	B	USDMXN	07/30/2024	1,000,000	18.45516	(18,455,160)
2024072603175	B	USDMXN	07/30/2024	30,000,000	18.46	(553,800,000)
2024072603181	B	USDMXN	07/30/2024	50,000,000	18.46	(923,000,000)
2024072603482	B	USDMXN	07/30/2024	2,000,000	18.44413	(36,888,260)
2024072603526	B	USDMXN	07/30/2024	1,000,000	18.44063	(18,440,630)
2024072603733	B	USDMXN	07/30/2024	54,720	18.45777	(1,010,009)
2024072603176	S	USDMXN	08/30/2024	(30,000,000)	18.5491	556,473,000
2024072603182	S	USDMXN	08/30/2024	(50,000,000)	18.5491	927,455,000
2024072603026	B	USDMXN	09/30/2024	30,000,000	18.5785	(557,355,000)
2024072603039	B	USDMXN	09/30/2024	50,000,000	18.6175	(930,875,000)
2024072603042	S	USDMXN	10/30/2024	(50,000,000)	18.7065	935,325,000
2024072903067	S	USDMXN	07/31/2024	(1,000,000)	18.66305	18,663,050
2024072903146	S	USDMXN	07/31/2024	(2,000,000)	18.645	37,290,000
2024072903326	S	USDMXN	07/31/2024	(1,000,000)	18.69348	18,693,480
2024072903509	S	USDMXN	07/31/2024	(2,000,000)	18.63447	37,268,940
2024072903749	S	USDMXN	07/31/2024	(715,611)	18.63976	13,338,817
2024072903076	B	USDMXN	07/31/2024	1,000,000	18.63	(18,630,000)
2024072903134	B	USDMXN	07/31/2024	1,000,000	18.61869	(18,618,690)
2024072903137	B	USDMXN	07/31/2024	1,000,000	18.6169	(18,616,900)
2024072903358	B	USDMXN	07/31/2024	2,000,000	18.71973	(37,439,460)
2024072903472	B	USDMXN	07/31/2024	1,000,000	18.65365	(18,653,650)
2024072903693	SO	USDMXN	08/07/2024	(23,169)	18.6401	431,872
2024072903692	SO	USDMXN	08/08/2024	(32,479)	18.64265	605,495
2024073003202	S	USDMXN	08/01/2024	(2,000,000)	18.785	37,570,000
2024073003301	S	USDMXN	08/01/2024	(1,000,000)	18.80205	18,802,050
2024073003383	S	USDMXN	08/01/2024	(1,000,000)	18.79965	18,799,650
2024073003385	S	USDMXN	08/01/2024	(1,000,000)	18.8029	18,802,900
2024073003505	S	USDMXN	08/01/2024	(1,000,000)	18.75247	18,752,470
2024073003818	S	USDMXN	08/01/2024	(881,003)	18.74615	16,515,413
2024073003126	B	USDMXN	08/01/2024	1,000,000	18.75743	(18,757,430)
2024073003176	B	USDMXN	08/01/2024	1,000,000	18.7633	(18,763,300)
2024073003337	B	USDMXN	08/01/2024	1,000,000	18.7835	(18,783,500)
2024073003418	B	USDMXN	08/01/2024	2,000,000	18.78	(37,560,000)
2024073003477	B	USDMXN	08/01/2024	1,000,000	18.75675	(18,756,750)
2024073003627	B	USDMXN	08/01/2024	100,000,000	18.772	(1,877,200,000)
2024073003854	B	USDMXN	08/01/2024	99,626	18.75374	(1,868,366)
2024073003628	S	USDMXN	08/08/2024	(100,000,000)	18.7926	1,879,260,000
2024073003361	SO	USDMXN	08/20/2024	(145,000)	18.75734	2,719,814
2024073003888	BO	USDMXN	09/04/2024	19,900	18.84973	(375,110)
2024073003211	SO	USDMXN	08/29/2025	(200,000)	19.96385	3,992,769
2024073103034	S	USDMXN	08/02/2024	(2,000,000)	18.67017	37,340,340
2024073103035	S	USDMXN	08/02/2024	(1,000,000)	18.69	18,690,000
2024073103039	S	USDMXN	08/02/2024	(1,000,000)	18.65335	18,653,350
2024073103780	S	USDMXN	08/02/2024	(142,196)	18.64024	2,650,576
2024073103004	B	USDMXN	08/02/2024	1,000,000	18.69797	(18,697,970)
2024073103005	B	USDMXN	08/02/2024	1,000,000	18.70547	(18,705,470)
2024073103006	B	USDMXN	08/02/2024	1,000,000	18.70081	(18,700,810)
2024073103030	B	USDMXN	08/02/2024	1,000,000	18.69635	(18,696,350)
2024073103123	B	USDMXN	08/02/2024	1,000,000	18.62	(18,620,000)
2024073103134	B	USDMXN	08/02/2024	100,000	18.607	(1,860,700)
2024073103894	BO	USDMXN	08/21/2024	54,530	18.65923	(1,017,488)
2024080103464	S	USDMXN	08/01/2024	(200,000,000)	18.83	3,766,000,000
2024080103493	S	USDMXN	08/01/2024	(150,000,000)	18.83	2,824,500,000
2024080103501	S	USDMXN	08/01/2024	(100,000,000)	18.83	1,883,000,000
2024080103509	S	USDMXN	08/01/2024	(50,000,000)	18.83	941,500,000
2024080103513	S	USDMXN	08/01/2024	(100,000,000)	18.83	1,883,000,000
2024080103517	S	USDMXN	08/01/2024	(100,000,000)	18.83	1,883,000,000
2024080103376	B	USDMXN	08/01/2024	150,000,000	18.84	(2,826,000,000)
2024080103410	B	USDMXN	08/01/2024	100,000,000	18.815	(1,881,500,000)
2024080103422	B	USDMXN	08/01/2024	100,000,000	18.815	(1,881,500,000)
2024080103411	S	USDMXN	08/02/2024	(100,000,000)	18.81775	1,881,775,000
2024080103423	S	USDMXN	08/02/2024	(100,000,000)	18.81775	1,881,775,000
2024080103494	B	USDMXN	08/02/2024	150,000,000	18.83265	(2,824,897,500)
2024080103502	B	USDMXN	08/02/2024	100,000,000	18.83265	(1,883,265,000)
2024080103510	B	USDMXN	08/02/2024	50,000,000	18.83265	(941,632,500)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024080103040	S	USDMXN	08/05/2024	(2,000,000)	18.51207	37,024,140
2024080103059	S	USDMXN	08/05/2024	(23,000,000)	18.61	428,030,000
2024080103330	S	USDMXN	08/05/2024	(1,000,000)	18.80262	18,802,620
2024080103377	S	USDMXN	08/05/2024	(150,000,000)	18.8514	2,827,710,000
2024080103523	S	USDMXN	08/05/2024	(2,000,000)	18.81	37,620,000
2024080103526	S	USDMXN	08/05/2024	(2,000,000)	18.81	37,620,000
2024080103034	B	USDMXN	08/05/2024	1,000,000	18.47335	(18,473,350)
2024080103071	B	USDMXN	08/05/2024	15,000,000	18.6098	(279,147,000)
2024080103182	B	USDMXN	08/05/2024	25,000,000	18.643	(466,075,000)
2024080103194	B	USDMXN	08/05/2024	1,000,000	18.6658	(18,665,800)
2024080103196	B	USDMXN	08/05/2024	1,000,000	18.66146	(18,661,460)
2024080103384	B	USDMXN	08/05/2024	1,000,000	18.80618	(18,806,180)
2024080103397	B	USDMXN	08/05/2024	200,000,000	18.83	(3,766,000,000)
2024080103650	B	USDMXN	08/05/2024	76,002	18.79526	(1,428,481)
2024080103671	B	USDMXN	08/05/2024	10,000,000	18.795	(187,950,000)
2024080103403	SON	USDMXN	10/30/2024	(200,000,000)	19.081	3,816,200,000
2024080103470	BON	USDMXN	10/30/2024	200,000,000	19.0865	(3,817,300,000)
2024080103528	BON	USDMXN	10/30/2024	100,000,000	19.0865	(1,908,650,000)
2024080103532	BON	USDMXN	10/30/2024	100,000,000	19.0865	(1,908,650,000)
2024080103183	S	USDMXN	05/05/2025	(25,000,000)	19.4455	486,137,500
2024080103072	S	USDMXN	08/05/2025	(15,000,000)	19.69224	295,383,555
2024080103672	S	USDMXN	08/05/2025	(10,000,000)	19.89	198,900,000
2024080103060	B	USDMXN	08/05/2025	23,000,000	19.6845	(452,743,500)
2024080203042	SO	USDMXN	02/07/2025	(200,000)	19.60731	3,921,461
2024080503016	S	USDMXN	08/05/2024	(100,000,000)	19.58	1,958,000,000
2024080503153	S	USDMXN	08/05/2024	(1,940,000)	19.5265	37,881,413
2024080503092	B	USDMXN	08/05/2024	27,940,000	19.63	(548,462,200)
2024080503143	B	USDMXN	08/05/2024	39,000,000	19.5815	(763,678,500)
2024080503093	S	USDMXN	08/06/2024	(27,940,000)	19.6331	548,548,814
2024080503144	S	USDMXN	08/06/2024	(39,000,000)	19.58465	763,801,350
2024080503154	B	USDMXN	08/06/2024	1,940,000	19.52969	(37,887,594)
2024080503168	S	USDMXN	08/07/2024	(418,835)	19.5811	8,201,248
2024080503665	S	USDMXN	08/07/2024	(52,350)	19.38608	1,014,861
2024080503017	B	USDMXN	08/07/2024	100,000,000	19.5857	(1,958,570,000)
2024080503757	B	USDMXN	08/08/2024	11,170	19.27468	(215,298)
2024080603418	S	USDMXN	08/06/2024	(50,000,000)	19.41	970,500,000
2024080603424	B	USDMXN	08/06/2024	50,000,000	19.425	(971,250,000)
2024080603407	S	USDMXN	08/07/2024	(150,000,000)	19.41	2,911,500,000
2024080603425	S	USDMXN	08/07/2024	(50,000,000)	19.4279	971,395,000
2024080603403	B	USDMXN	08/07/2024	150,000,000	19.41	(2,911,500,000)
2024080603176	S	USDMXN	08/08/2024	(2,000,000)	19.28143	38,562,860
2024080603252	S	USDMXN	08/08/2024	(2,000,000)	19.32	38,640,000
2024080603120	B	USDMXN	08/08/2024	1,000,000	19.36351	(19,363,510)
2024080603142	B	USDMXN	08/08/2024	1,000,000	19.33808	(19,338,080)
2024080603283	B	USDMXN	08/08/2024	2,000,000	19.35604	(38,712,080)
2024080603419	B	USDMXN	08/08/2024	50,000,000	19.4156	(970,780,000)
2024080603404	S	USDMXN	08/09/2024	(150,000,000)	19.4162	2,912,430,000
2024080603706	S	USDMXN	08/09/2024	(500,000)	19.56348	9,781,740
2024080603408	B	USDMXN	08/09/2024	150,000,000	19.4156	(2,912,340,000)
2024080603670	B	USDMXN	08/09/2024	261,903	19.66001	(5,149,020)
2024080703105	S	USDMXN	08/09/2024	(1,000,000)	19.12028	19,120,280
2024080703113	S	USDMXN	08/09/2024	(2,000,000)	19.14	38,280,000
2024080703172	S	USDMXN	08/09/2024	(15,000,000)	19.173	287,595,000
2024080703241	S	USDMXN	08/09/2024	(1,000,000)	19.20715	19,207,150
2024080703289	S	USDMXN	08/09/2024	(50,000,000)	19.212	960,600,000
2024080703296	S	USDMXN	08/09/2024	(1,000,000)	19.1996	19,199,600
2024080703411	S	USDMXN	08/09/2024	(2,000,000)	19.25083	38,501,660
2024080703051	B	USDMXN	08/09/2024	300,000	19.2248	(5,767,440)
2024080703080	B	USDMXN	08/09/2024	1,000,000	19.19589	(19,195,890)
2024080703085	B	USDMXN	08/09/2024	1,000,000	19.18905	(19,189,050)
2024080703098	B	USDMXN	08/09/2024	1,000,000	19.17446	(19,174,460)
2024080703314	B	USDMXN	08/09/2024	2,000,000	19.28159	(38,563,180)
2024080703564	B	USDMXN	08/09/2024	1,587,380	19.28723	(30,616,161)
2024080703621	B	USDMXN	08/09/2024	183,270	19.28925	(3,535,141)
2024080703388	BO	USDMXN	08/16/2024	1,763,348	19.27121	(33,981,850)
2024080703691	BO	USDMXN	08/21/2024	20,550	19.3113	(396,847)
2024080703290	B	USDMXN	08/23/2024	50,000,000	19.2544	(962,720,000)
2024080703496	SO	USDMXN	08/29/2024	(436,000)	19.32117	8,424,028
2024080703692	BO	USDMXN	09/11/2024	38,850	19.37264	(752,627)
2024080703390	BO	USDMXN	10/17/2024	508,215	19.45134	(9,885,460)
2024080703173	B	USDMXN	05/09/2025	15,000,000	19.998	(299,970,000)
2024080803287	S	USDMXN	08/08/2024	(9,000,000)	19.1	171,900,000
2024080803312	S	USDMXN	08/08/2024	(50,000,000)	19.1	955,000,000
2024080803294	B	USDMXN	08/08/2024	50,000,000	19.11	(955,500,000)
2024080803354	BO	USDMXN	08/08/2024	1,000,000	19.07903	(19,079,034)
2024080803295	S	USDMXN	08/09/2024	(50,000,000)	19.11295	955,647,500
2024080803310	S	USDMXN	08/09/2024	(150,000,000)	19.1	2,865,000,000
2024080803288	B	USDMXN	08/09/2024	9,000,000	19.1028	(171,925,200)
2024080803481	B	USDMXN	08/09/2024	120,000,000	19.065	(2,287,800,000)
2024080803070	S	USDMXN	08/12/2024	(20,000,000)	19.15	383,000,000
2024080803118	S	USDMXN	08/12/2024	(3,000,000)	19.10066	57,301,980
2024080803408	S	USDMXN	08/12/2024	(2,000,000)	19.1	38,200,000
2024080803412	S	USDMXN	08/12/2024	(3,000,000)	19.105	57,315,000
2024080803462	S	USDMXN	08/12/2024	(2,000,000)	19.07	38,140,000
2024080803469	S	USDMXN	08/12/2024	(1,500,000)	19.07	28,605,000
2024080803482	S	USDMXN	08/12/2024	(120,000,000)	19.0741	2,288,892,000
2024080803041	B	USDMXN	08/12/2024	1,000,000	19.1627	(19,162,700)
2024080803069	B	USDMXN	08/12/2024	1,000,000	19.14948	(19,149,480)
2024080803285	B	USDMXN	08/12/2024	150,000,000	19.11	(2,866,500,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024080803313 B		USDMXN	08/12/2024	50,000,000	19.1112	(955,560,000)
2024080803395 B		USDMXN	08/12/2024	2,000,000	19.0972	(38,194,400)
2024080803477 B		USDMXN	08/12/2024	761,328	19.08094	(14,526,847)
2024080803495 B		USDMXN	08/12/2024	500,000	19.06845	(9,534,225)
2024080803564 B		USDMXN	08/12/2024	1,000,000	19.05011	(19,050,110)
2024080803772 B		USDMXN	08/12/2024	77,284	18.92366	(1,462,500)
2024080803839 B		USDMXN	08/12/2024	30,412	18.8655	(573,739)
2024080803286 S		USDMXN	08/13/2024	(150,000,000)	19.113	2,866,950,000
2024080803311 B		USDMXN	08/13/2024	150,000,000	19.1112	(2,866,680,000)
2024080803071 B		USDMXN	11/12/2024	20,000,000	19.425	(388,500,000)
2024080803032 BO		USDMXN	12/20/2024	265,000	19.56518	(5,184,773)
2024080903165 S		USDMXN	08/13/2024	(1,000,000)	18.84	18,840,000
2024080903082 B		USDMXN	08/13/2024	1,000,000	18.81069	(18,810,690)
2024080903822 B		USDMXN	08/13/2024	500,000	18.83713	(9,418,565)
2024080903823 B		USDMXN	08/13/2024	200,000	18.8366	(3,767,320)
2024080903706 BO		USDMXN	08/29/2024	214,031	18.89934	(4,045,044)
2024080903540 SO		USDMXN	09/03/2024	(286,000)	18.89109	5,402,852
2024080903091 BO		USDMXN	09/13/2024	300,000	18.89702	(5,669,106)
2024080903711 BO		USDMXN	09/13/2024	184,907	18.93759	(3,501,693)
2024080903625 SO		USDMXN	10/11/2024	(1,128,476)	19.01601	21,459,106
2024080903710 BO		USDMXN	10/31/2024	294,600	19.08015	(5,621,012)
2024080903708 BO		USDMXN	11/01/2024	152,000	19.08499	(2,900,918)
2024080903454 BO		USDMXN	11/08/2024	250,000	19.08318	(4,770,795)
2024080903735 BO		USDMXN	02/07/2025	364,500	19.35179	(7,053,726)
2024081203470 S		USDMXN	08/12/2024	(20,000,000)	19.08	381,600,000
2024081203608 S		USDMXN	08/12/2024	(50,000,000)	19.07	953,500,000
2024081203605 B		USDMXN	08/12/2024	50,000,000	19.068	(953,400,000)
2024081203409 S		USDMXN	08/13/2024	(150,000,000)	19.04	2,856,000,000
2024081203405 B		USDMXN	08/13/2024	150,000,000	19.042	(2,856,300,000)
2024081203471 B		USDMXN	08/13/2024	20,000,000	19.08295	(381,659,000)
2024081203090 S		USDMXN	08/14/2024	(2,000,000)	18.895	37,790,000
2024081203146 S		USDMXN	08/14/2024	(1,000,000)	18.92645	18,926,450
2024081203159 S		USDMXN	08/14/2024	(1,000,000)	18.94	18,940,000
2024081203160 S		USDMXN	08/14/2024	(2,000,000)	18.941	37,882,000
2024081203161 S		USDMXN	08/14/2024	(3,000,000)	18.945	56,835,000
2024081203406 S		USDMXN	08/14/2024	(150,000,000)	19.04485	2,856,727,500
2024081203606 S		USDMXN	08/14/2024	(50,000,000)	19.0734	953,670,000
2024081203197 B		USDMXN	08/14/2024	3,000,000	19.02085	(57,062,550)
2024081203477 B		USDMXN	08/14/2024	100,000,000	19.1	(1,910,000,000)
2024081203609 B		USDMXN	08/14/2024	50,000,000	19.075	(953,750,000)
2024081203675 B		USDMXN	08/14/2024	271,533	19.0746	(5,179,383)
2024081203410 B		USDMXN	09/03/2024	150,000,000	19.0967	(2,864,505,000)
2024081203478 S		USDMXN	09/04/2024	(100,000,000)	19.1606	1,916,060,000
2024081303190 SO		USDMXN	08/13/2024	(1,000,000)	19.06361	19,063,610
2024081303239 SO		USDMXN	08/13/2024	(1,000,000)	19.06361	19,063,610
2024081303581 S		USDMXN	08/13/2024	(50,000,000)	18.98	949,000,000
2024081303540 B		USDMXN	08/13/2024	50,000,000	18.99	(949,500,000)
2024081303541 S		USDMXN	08/14/2024	(50,000,000)	18.99285	949,642,500
2024081303603 B		USDMXN	08/14/2024	90,000,000	18.989	(1,709,010,000)
2024081303042 S		USDMXN	08/15/2024	(1,000,000)	19.07955	19,079,550
2024081303044 S		USDMXN	08/15/2024	(1,000,000)	19.07665	19,076,650
2024081303083 S		USDMXN	08/15/2024	(2,000,000)	19.048	38,096,000
2024081303389 S		USDMXN	08/15/2024	(10,000,000)	19.02	190,200,000
2024081303438 S		USDMXN	08/15/2024	(2,000,000)	19.01	38,020,000
2024081303440 S		USDMXN	08/15/2024	(2,000,000)	19.01	38,020,000
2024081303441 S		USDMXN	08/15/2024	(1,000,000)	19.0099	19,009,900
2024081303604 S		USDMXN	08/15/2024	(90,000,000)	18.99185	1,709,266,500
2024081303782 S		USDMXN	08/15/2024	(97,984)	19.01477	1,863,140
2024081303050 B		USDMXN	08/15/2024	2,000,000	19.05	(38,100,000)
2024081303053 B		USDMXN	08/15/2024	1,000,000	19.02667	(19,026,670)
2024081303054 B		USDMXN	08/15/2024	1,000,000	19.02718	(19,027,180)
2024081303205 B		USDMXN	08/15/2024	100,000,000	19.075	(1,907,500,000)
2024081303474 B		USDMXN	08/15/2024	1,000,000	19.01087	(19,010,870)
2024081303743 B		USDMXN	08/15/2024	1,000,000	19.009	(19,009,000)
2024081303206 S		USDMXN	08/22/2024	(100,000,000)	19.0951	1,909,510,000
2024081303582 B		USDMXN	09/03/2024	50,000,000	19.0367	(951,835,000)
2024081303390 B		USDMXN	08/15/2025	10,000,000	20.099	(200,990,000)
2024081303375 BO		USDMXN	11/14/2025	165,000	20.344	(3,356,760)
2024081403775 BO		USDMXN	08/14/2024	3,000,000	18.8251	(56,475,300)
2024081403204 S		USDMXN	08/16/2024	(2,000,000)	18.85	37,700,000
2024081403316 S		USDMXN	08/16/2024	(2,000,000)	18.845	37,690,000
2024081403318 S		USDMXN	08/16/2024	(1,000,000)	18.85	18,850,000
2024081403345 S		USDMXN	08/16/2024	(1,000,000)	18.85947	18,859,470
2024081403368 S		USDMXN	08/16/2024	(1,000,000)	18.86	18,860,000
2024081403446 S		USDMXN	08/16/2024	(2,000,000)	18.865	37,730,000
2024081403529 S		USDMXN	08/16/2024	(1,000,000)	18.85864	18,858,640
2024081403795 S		USDMXN	08/16/2024	(30,000,000)	18.823	564,690,000
2024081403086 B		USDMXN	08/16/2024	2,000,000	18.83	(37,660,000)
2024081403254 B		USDMXN	08/16/2024	1,000,000	18.82124	(18,821,240)
2024081403539 B		USDMXN	08/16/2024	50,000,000	18.861	(943,050,000)
2024081403638 B		USDMXN	08/16/2024	50,000,000	18.85	(942,500,000)
2024081403640 B		USDMXN	08/16/2024	50,000,000	18.85	(942,500,000)
2024081403681 B		USDMXN	08/16/2024	1,000,000	18.84	(18,840,000)
2024081403689 B		USDMXN	08/16/2024	312,664	18.82995	(5,887,450)
2024081403842 BO		USDMXN	09/13/2024	100,000	18.89217	(1,889,217)
2024081403540 S		USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	18.9532	947,660,000
2024081403639 S		USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	18.9423	947,115,000
2024081403641 S		USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	18.9424	947,120,000
2024081403796 B		USDMXN	10/16/2024	30,000,000	19.001	(570,030,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024081503686	B	USDMXN	08/15/2024	20,000,000	18.656	(373,120,000)
2024081503687	S	USDMXN	08/16/2024	(20,000,000)	18.6587	373,174,000
2024081503004	S	USDMXN	08/19/2024	(5,000,000)	18.68	93,400,000
2024081503233	S	USDMXN	08/19/2024	(2,000,000)	18.645	37,290,000
2024081503323	S	USDMXN	08/19/2024	(30,000,000)	18.654	559,620,000
2024081503384	SON	USDMXN	08/19/2024	(50,000,000)	17.0365	851,825,000
2024081503386	SO	USDMXN	08/19/2024	0	18.6515	80,750,000
2024081503521	S	USDMXN	08/19/2024	(1,000,000)	18.66	18,660,000
2024081503572	S	USDMXN	08/19/2024	(340,000)	18.65415	6,342,411
2024081503685	S	USDMXN	08/19/2024	(1,000,000)	18.655	18,655,000
2024081503087	B	USDMXN	08/19/2024	1,000,000	18.65639	(18,656,390)
2024081503143	B	USDMXN	08/19/2024	1,000,000	18.66	(18,660,000)
2024081503383	BON	USDMXN	08/19/2024	50,000,000	17.0423	(852,115,000)
2024081503385	BO	USDMXN	08/19/2024	0	18.6515	(80,460,000)
2024081503772	B	USDMXN	08/19/2024	407,391	18.65145	(7,598,439)
2024081503820	B	USDMXN	08/19/2024	2,000,000	18.66	(37,320,000)
2024081503829	B	USDMXN	08/19/2024	195,159	18.66059	(3,641,777)
2024081503324	B	USDMXN	11/19/2024	30,000,000	18.923	(567,690,000)
2024081603711	BO	USDMXN	08/16/2024	5,000,000	18.62668	(93,133,400)
2024081603052	S	USDMXN	08/20/2024	(3,000,000)	18.65	55,950,000
2024081603061	S	USDMXN	08/20/2024	(1,000,000)	18.6792	18,679,200
2024081603074	S	USDMXN	08/20/2024	(1,000,000)	18.68716	18,687,160
2024081603388	S	USDMXN	08/20/2024	(2,000,000)	18.645	37,290,000
2024081603015	B	USDMXN	08/20/2024	1,000,000	18.61641	(18,616,410)
2024081603034	B	USDMXN	08/20/2024	1,000,000	18.6214	(18,621,400)
2024081603035	B	USDMXN	08/20/2024	1,000,000	18.62425	(18,624,250)
2024081603038	B	USDMXN	08/20/2024	500,000	18.61071	(9,305,355)
2024081603167	B	USDMXN	08/20/2024	1,400,000	18.65	(26,110,000)
2024081603169	B	USDMXN	08/20/2024	1,600,000	18.655	(29,848,000)
2024081603186	B	USDMXN	08/20/2024	15,000,000	18.68	(280,200,000)
2024081603212	B	USDMXN	08/20/2024	1,000,000	18.62799	(18,627,990)
2024081603215	B	USDMXN	08/20/2024	1,000,000	18.62593	(18,625,930)
2024081603417	B	USDMXN	08/20/2024	72,901	18.65596	(1,360,041)
2024081603539	B	USDMXN	08/20/2024	30,000,000	18.64	(559,200,000)
2024081603676	B	USDMXN	08/20/2024	261,826	18.63003	(4,877,826)
2024081603207	BO	USDMXN	09/11/2024	42,361	18.70122	(792,202)
2024081603209	BO	USDMXN	10/02/2024	35,670	18.76273	(669,267)
2024081603171	BO	USDMXN	10/16/2024	640,000	18.80999	(12,038,391)
2024081603210	BO	USDMXN	10/16/2024	35,670	18.80378	(670,731)
2024081603540	S	USDMXN	11/20/2024	(30,000,000)	18.909	567,270,000
2024081603175	BO	USDMXN	11/20/2024	874,000	18.91039	(16,527,681)
2024081603187	S	USDMXN	01/21/2025	(15,000,000)	19.13	286,950,000
2024081903115	S	USDMXN	08/21/2024	(1,000,000)	18.73708	18,737,080
2024081903265	S	USDMXN	08/21/2024	(1,000,000)	18.70686	18,706,860
2024081903276	S	USDMXN	08/21/2024	(2,000,000)	18.70364	37,407,280
2024081903278	S	USDMXN	08/21/2024	(1,000,000)	18.7045	18,704,500
2024081903473	S	USDMXN	08/21/2024	(1,000,000)	18.7	18,700,000
2024081903075	B	USDMXN	08/21/2024	1,000,000	18.77769	(18,777,690)
2024081903122	B	USDMXN	08/21/2024	1,000,000	18.74209	(18,742,090)
2024081903131	B	USDMXN	08/21/2024	1,000,000	18.73703	(18,737,030)
2024081903152	B	USDMXN	08/21/2024	1,000,000	18.73191	(18,731,910)
2024081903233	B	USDMXN	08/21/2024	1,000,000	18.74597	(18,745,970)
2024082003042	S	USDMXN	08/22/2024	(1,000,000)	18.78898	18,788,980
2024082003063	S	USDMXN	08/22/2024	(1,000,000)	18.83377	18,833,770
2024082003067	S	USDMXN	08/22/2024	(1,000,000)	18.8612	18,861,200
2024082003416	S	USDMXN	08/22/2024	(1,000,000)	18.93	18,930,000
2024082003424	S	USDMXN	08/22/2024	(500,000)	18.95726	9,478,630
2024082003636	S	USDMXN	08/22/2024	(2,000,000)	18.98	37,960,000
2024082003659	S	USDMXN	08/22/2024	(3,000,000)	18.985	56,955,000
2024082003660	S	USDMXN	08/22/2024	(3,000,000)	18.99	56,970,000
2024082003034	B	USDMXN	08/22/2024	1,000,000	18.76316	(18,763,160)
2024082003073	B	USDMXN	08/22/2024	2,000,000	18.91216	(37,824,320)
2024082003765	B	USDMXN	08/22/2024	423,929	19.0024	(8,055,672)
2024082103050	S	USDMXN	08/23/2024	(1,000,000)	19.2292	19,229,200
2024082103080	S	USDMXN	08/23/2024	(1,000,000)	19.21645	19,216,450
2024082103102	S	USDMXN	08/23/2024	(2,000,000)	19.17184	38,343,680
2024082103242	S	USDMXN	08/23/2024	(3,000,000)	19.26	57,780,000
2024082103244	S	USDMXN	08/23/2024	(2,000,000)	19.26442	38,528,840
2024082103330	S	USDMXN	08/23/2024	(2,000,000)	19.32952	38,659,040
2024082103347	S	USDMXN	08/23/2024	(20,000,000)	19.223	384,460,000
2024082103592	S	USDMXN	08/23/2024	(442,730)	19.33935	8,562,119
2024082103043	B	USDMXN	08/23/2024	1,000,000	19.24833	(19,248,330)
2024082103046	B	USDMXN	08/23/2024	1,000,000	19.24909	(19,249,090)
2024082103052	B	USDMXN	08/23/2024	1,000,000	19.2251	(19,225,100)
2024082103053	B	USDMXN	08/23/2024	1,000,000	19.21656	(19,216,560)
2024082103197	B	USDMXN	08/23/2024	2,000,000	19.21719	(38,434,380)
2024082103202	B	USDMXN	08/23/2024	2,000,000	19.21368	(38,427,360)
2024082103363	B	USDMXN	08/23/2024	20,000,000	19.223	(384,460,000)
2024082103250	SO	USDMXN	11/06/2024	(585,216)	19.48992	11,405,813
2024082103393	SO	USDMXN	03/25/2025	(100,000)	19.95354	1,995,354
2024082103051	SO	USDMXN	03/28/2025	(100,000)	19.87004	1,987,004
2024082103364	S	USDMXN	05/23/2025	(20,000,000)	20.048	400,960,000
2024082103348	B	USDMXN	05/23/2025	20,000,000	20.048	(400,960,000)
2024082203037	BO	USDMXN	08/22/2024	3,000,000	19.44055	(58,321,650)
2024082203339	S	USDMXN	08/26/2024	(2,000,000)	19.455	38,910,000
2024082203469	S	USDMXN	08/26/2024	(2,000,000)	19.455	38,910,000
2024082203584	S	USDMXN	08/26/2024	(2,000,000)	19.48	38,960,000
2024082203590	S	USDMXN	08/26/2024	(1,000,000)	19.48	19,480,000
2024082203666	S	USDMXN	08/26/2024	(69,327)	19.46383	1,349,360

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024082203035 B		USDMXN	08/26/2024	2,000,000	19.46586	(38,931,720)
2024082203043 B		USDMXN	08/26/2024	1,000,000	19.43753	(19,437,530)
2024082203052 B		USDMXN	08/26/2024	1,000,000	19.42153	(19,421,530)
2024082203190 B		USDMXN	08/26/2024	382,343	19.43993	(7,432,730)
2024082203223 B		USDMXN	08/26/2024	10,000,000	19.44	(194,400,000)
2024082203438 B		USDMXN	08/26/2024	10,000,000	19.44	(194,400,000)
2024082203534 B		USDMXN	08/26/2024	50,000,000	19.46	(973,000,000)
2024082203665 B		USDMXN	08/26/2024	34,663	19.471	(674,928)
2024082203775 B		USDMXN	08/26/2024	243,892	19.53297	(4,763,927)
2024082203661 B		USDMXN	10/28/2024	50,000,000	19.6535	(982,675,000)
2024082203535 S		USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	19.74	987,000,000
2024082203662 S		USDMXN	11/26/2024	(50,000,000)	19.7405	987,025,000
2024082203224 S		USDMXN	08/26/2025	(10,000,000)	20.551	205,510,000
2024082203439 S		USDMXN	08/26/2025	(10,000,000)	20.555	205,550,000
2024082303061 S		USDMXN	08/27/2024	(1,000,000)	19.06548	19,065,480
2024082303064 S		USDMXN	08/27/2024	(1,000,000)	19.04675	19,046,750
2024082303086 S		USDMXN	08/27/2024	(2,000,000)	19.13183	38,263,660
2024082303509 S		USDMXN	08/27/2024	(1,000,000)	19.08	19,080,000
2024082303681 S		USDMXN	08/27/2024	(63,783)	19.07264	1,216,509
2024082303057 B		USDMXN	08/27/2024	1,000,000	19.12368	(19,123,680)
2024082303059 B		USDMXN	08/27/2024	1,000,000	19.12535	(19,125,350)
2024082303145 B		USDMXN	08/27/2024	2,000,000	19.08027	(38,160,540)
2024082303147 B		USDMXN	08/27/2024	100,000,000	19.08	(1,908,000,000)
2024082303354 B		USDMXN	08/27/2024	1,000,000	19.03725	(19,037,250)
2024082303765 B		USDMXN	08/27/2024	100,007	19.11119	(1,911,259)
2024082303148 S		USDMXN	09/03/2024	(100,000,000)	19.1013	1,910,130,000
2024082303745 BO		USDMXN	09/25/2024	38,250	19.1784	(733,574)
2024082603063 S		USDMXN	08/28/2024	(1,000,000)	19.37423	19,374,230
2024082603078 S		USDMXN	08/28/2024	(1,000,000)	19.36513	19,365,130
2024082603454 S		USDMXN	08/28/2024	(1,000,000)	19.30218	19,302,180
2024082603457 S		USDMXN	08/28/2024	(1,000,000)	19.3005	19,300,500
2024082603525 S		USDMXN	08/28/2024	(50,000,000)	19.317	965,850,000
2024082603118 B		USDMXN	08/28/2024	2,000,000	19.40806	(38,816,120)
2024082603373 B		USDMXN	08/28/2024	2,000,000	19.32457	(38,649,140)
2024082603578 B		USDMXN	08/28/2024	111,529	19.32893	(2,155,734)
2024082603646 B		USDMXN	08/28/2024	1,000,000	19.405	(19,405,000)
2024082603704 S		USDMXN	08/29/2024	(32,727)	19.38989	634,572
2024082603702 B		USDMXN	08/29/2024	800,000	19.42341	(15,538,728)
2024082603526 B		USDMXN	09/30/2024	50,000,000	19.417	(970,850,000)
2024082703451 B		USDMXN	08/27/2024	400,000	19.68009	(7,872,035)
2024082703217 S		USDMXN	08/29/2024	(50,000,000)	19.666	983,300,000
2024082703428 S		USDMXN	08/29/2024	(1,250,000)	19.67	24,587,500
2024082703429 S		USDMXN	08/29/2024	(25,112)	19.67124	493,982
2024082703448 S		USDMXN	08/29/2024	(1,000)	19.67954	19,678
2024082703452 S		USDMXN	08/29/2024	(400,000)	19.68571	7,874,284
2024082703487 S		USDMXN	08/29/2024	(257,107)	19.68609	5,061,439
2024082703876 S		USDMXN	08/29/2024	(406,850)	19.77497	8,045,447
2024082703283 B		USDMXN	08/29/2024	1,000,000	19.65889	(19,658,890)
2024082703531 B		USDMXN	08/29/2024	2,000,000	19.675	(39,350,000)
2024082703535 B		USDMXN	08/29/2024	3,000,000	19.675	(59,025,000)
2024082703539 B		USDMXN	08/29/2024	606,908	19.67455	(11,940,645)
2024082703436 SO		USDMXN	08/30/2024	(200,000)	19.52085	3,904,171
2024082703603 BO		USDMXN	09/12/2024	28,671	19.74039	(565,977)
2024082703877 SO		USDMXN	09/13/2024	(200,000)	19.81306	3,962,613
2024082703878 SO		USDMXN	09/27/2024	(100,000)	19.85581	1,985,581
2024082703879 SO		USDMXN	10/11/2024	(200,000)	19.89865	3,979,730
2024082703880 SO		USDMXN	10/25/2024	(100,000)	19.94084	1,994,084
2024082703239 SO		USDMXN	10/30/2024	(1,000,000)	19.74562	19,745,619
2024082703315 SO		USDMXN	11/12/2024	(191,070)	19.89858	3,802,022
2024082703881 SO		USDMXN	11/14/2024	(200,000)	20.00258	4,000,515
2024082703882 SO		USDMXN	11/27/2024	(100,000)	20.04309	2,004,309
2024082703536 BO		USDMXN	11/27/2024	1,567,751	19.9635	(31,297,802)
2024082703218 B		USDMXN	11/29/2024	50,000,000	19.948	(997,400,000)
2024082703883 SO		USDMXN	12/06/2024	(100,000)	20.06974	2,006,974
2024082703884 SO		USDMXN	12/13/2024	(200,000)	20.09016	4,018,032
2024082703039 SO		USDMXN	02/24/2025	(200,000)	20.16427	4,032,853
2024082703500 BO		USDMXN	11/28/2025	160,000	21.068	(3,370,880)
2024082703503 BO		USDMXN	11/28/2025	160,000	21.068	(3,370,880)
2024082803139 S		USDMXN	08/28/2024	(150,000,000)	19.477	2,921,550,000
2024082803314 S		USDMXN	08/29/2024	(150,000,000)	19.477	2,921,550,000
2024082803140 B		USDMXN	08/29/2024	150,000,000	19.4801	(2,922,015,000)
2024082803560 S		USDMXN	08/30/2024	(50,000,000)	19.6795	983,975,000
2024082803771 S		USDMXN	08/30/2024	(561,560)	19.64595	11,032,375
2024082803315 B		USDMXN	08/30/2024	150,000,000	19.4801	(2,922,015,000)
2024082803402 B		USDMXN	08/30/2024	100,000,000	19.65	(1,965,000,000)
2024082803561 B		USDMXN	09/13/2024	50,000,000	19.72276	(986,138,150)
2024082803403 S		USDMXN	09/30/2024	(100,000,000)	19.7445	1,974,450,000
2024082803364 SO		USDMXN	11/20/2024	(575,758)	19.8474	11,427,301
2024082803367 SO		USDMXN	12/30/2024	(385,482)	19.98412	7,703,518
2024082803368 SO		USDMXN	01/15/2025	(384,366)	20.07221	7,715,075
2024082803374 SO		USDMXN	02/12/2025	(576,025)	20.15181	11,607,946
2024082803376 SO		USDMXN	02/26/2025	(574,884)	20.20892	11,617,785
2024082803383 SO		USDMXN	03/12/2025	(558,466)	20.26087	11,315,009
2024082803385 SO		USDMXN	03/25/2025	(556,903)	20.30358	11,307,127
2024082803379 SO		USDMXN	04/09/2025	(571,288)	20.32458	11,611,188
2024082903403 S		USDMXN	09/03/2024	(23,000,000)	19.845	456,435,000
2024082903449 S		USDMXN	09/03/2024	(25,000,000)	19.782	494,550,000
2024082903669 S		USDMXN	09/03/2024	(20,000,000)	19.822	396,440,000
2024082903716 S		USDMXN	09/03/2024	(10,000,000)	19.827	198,270,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024082903813	S	USDMXN	09/03/2024	(662,431)	19.83535	13,139,551
2024082903815	S	USDMXN	09/03/2024	(1,040,561)	19.83307	20,637,519
2024082903596	SO	USDMXN	09/09/2024	(255,555)	19.86579	5,076,801
2024082903439	BO	USDMXN	10/17/2024	1,155,309	19.9171	(23,010,410)
2024082903445	BO	USDMXN	10/24/2024	126,527	19.94139	(2,523,124)
2024082903450	B	USDMXN	06/03/2025	25,000,000	20.636	(515,900,000)
2024082903404	B	USDMXN	09/03/2025	23,000,000	20.9925	(482,827,500)
2024082903717	B	USDMXN	12/03/2025	10,000,000	21.2645	(212,645,000)
2024082903670	B	USDMXN	03/03/2026	20,000,000	21.552	(431,040,000)
2024083003305	BO	USDMXN	08/30/2024	5,000,000	19.62598	(98,129,900)
2024083003432	S	USDMXN	09/04/2024	(50,000,000)	19.71	985,500,000
2024083003434	S	USDMXN	09/04/2024	(10,000,000)	19.662	196,620,000
2024083003967	S	USDMXN	09/04/2024	(240,000)	19.7127	4,731,048
2024083003901	B	USDMXN	09/04/2024	245,118	19.70429	(4,829,883)
2024083003433	B	USDMXN	09/11/2024	50,000,000	19.7324	(986,620,000)
2024083003435	B	USDMXN	09/04/2025	10,000,000	20.797	(207,970,000)
2024090303141	S	USDMXN	09/03/2024	(100,000,000)	19.8	1,980,000,000
2024090303431	B	USDMXN	09/03/2024	100,000,000	19.865	(1,986,500,000)
2024090303625	BO	USDMXN	09/03/2024	3,000,000	19.86127	(59,583,810)
2024090303650	BO	USDMXN	09/03/2024	3,000,000	19.8448	(59,534,400)
2024090303804	BO	USDMXN	09/03/2024	5,000,000	19.83867	(99,193,350)
2024090303432	S	USDMXN	09/04/2024	(100,000,000)	19.8679	1,986,790,000
2024090303080	S	USDMXN	09/05/2024	(1,000,000)	19.80527	19,805,270
2024090303108	S	USDMXN	09/05/2024	(2,000,000)	19.8	39,600,000
2024090303435	S	USDMXN	09/05/2024	(203,792)	19.86751	4,048,840
2024090303567	S	USDMXN	09/05/2024	(250,000)	19.87265	4,968,163
2024090303697	S	USDMXN	09/05/2024	(3,000,000)	19.85	59,550,000
2024090303700	S	USDMXN	09/05/2024	(2,000,000)	19.86	39,720,000
2024090303719	S	USDMXN	09/05/2024	(500,000)	19.86	9,930,000
2024090303045	B	USDMXN	09/05/2024	1,000,000	19.87286	(19,872,860)
2024090303052	B	USDMXN	09/05/2024	1,000,000	19.87124	(19,871,240)
2024090303061	B	USDMXN	09/05/2024	1,000,000	19.84087	(19,840,870)
2024090303762	B	USDMXN	09/05/2024	81,790	19.87087	(1,625,236)
2024090303142	B	USDMXN	09/17/2024	100,000,000	19.8392	(1,983,920,000)
2024090303753	BO	USDMXN	12/16/2024	120,000	20.1983	(2,423,795)
2024090403547	BO	USDMXN	09/04/2024	1,000,000	19.89778	(19,897,780)
2024090403043	S	USDMXN	09/06/2024	(1,000,000)	19.71151	19,711,510
2024090403106	S	USDMXN	09/06/2024	(15,000,000)	19.73	295,950,000
2024090403108	S	USDMXN	09/06/2024	(10,000,000)	19.73	197,300,000
2024090403336	S	USDMXN	09/06/2024	(1,000,000)	19.87144	19,871,440
2024090403356	S	USDMXN	09/06/2024	(500,000)	19.89247	9,946,235
2024090403539	S	USDMXN	09/06/2024	(8,529)	19.9092	169,814
2024090403038	B	USDMXN	09/06/2024	1,000,000	19.76517	(19,765,170)
2024090403699	B	USDMXN	09/06/2024	102,868	19.93818	(2,051,008)
2024090403811	B	USDMXN	09/09/2024	1,000,000	19.95438	(19,954,380)
2024090403465	SO	USDMXN	09/26/2024	(310,000)	20.00111	6,200,344
2024090403466	SO	USDMXN	02/28/2025	(150,000)	20.4785	3,071,775
2024090403107	B	USDMXN	05/06/2025	15,000,000	20.485	(307,275,000)
2024090403109	B	USDMXN	09/08/2025	10,000,000	20.8775	(208,775,000)
2024090503093	BO	USDMXN	09/05/2024	3,000,000	19.92392	(59,771,760)
2024090503377	B	USDMXN	09/05/2024	2,593,880	20	(51,877,603)
2024090503378	S	USDMXN	09/06/2024	(2,593,880)	20.0029	51,885,126
2024090503272	S	USDMXN	09/09/2024	(1,000,000)	19.98822	19,988,220
2024090503349	S	USDMXN	09/09/2024	(1,000,000)	19.98213	19,982,130
2024090503594	S	USDMXN	09/09/2024	(2,000,000)	19.967	39,934,000
2024090503596	S	USDMXN	09/09/2024	(2,000,000)	19.96515	39,930,300
2024090503693	S	USDMXN	09/09/2024	(20,000,000)	19.96	399,200,000
2024090503083	B	USDMXN	09/09/2024	1,000,000	19.92	(19,920,000)
2024090503394	B	USDMXN	09/09/2024	2,000,000	20.0417	(40,083,400)
2024090503578	B	USDMXN	09/09/2024	2,000,000	19.965	(39,930,000)
2024090503817	B	USDMXN	09/09/2024	1,000,000	19.8801	(19,880,100)
2024090503687	BO	USDMXN	09/13/2024	230,433	19.96382	(4,600,323)
2024090503804	BO	USDMXN	10/02/2024	28,200	19.96117	(562,905)
2024090503803	BO	USDMXN	10/09/2024	19,400	19.98207	(387,652)
2024090503717	SO	USDMXN	10/17/2024	(318,497)	20.05111	6,386,218
2024090503714	SO	USDMXN	10/24/2024	(122,393)	20.07821	2,457,432
2024090503694	B	USDMXN	06/09/2025	20,000,000	20.824	(416,480,000)
2024090603093	B	USDMXN	09/10/2024	1,000,000	19.99041	(19,990,410)
2024090603548	B	USDMXN	09/10/2024	224,661	20.00949	(4,495,348)
2024090603527	SO	USDMXN	09/27/2024	(293,000)	20.13298	5,898,964
2024090603528	SO	USDMXN	09/30/2024	(155,000)	20.14262	3,122,107
2024090903457	S	USDMXN	09/11/2024	(3,000,000)	19.88	59,640,000
2024090903459	S	USDMXN	09/11/2024	(1,000,000)	19.88	19,880,000
2024090903498	S	USDMXN	09/11/2024	(2,000,000)	19.87	39,740,000
2024090903503	S	USDMXN	09/11/2024	(2,000,000)	19.875	39,750,000
2024090903517	S	USDMXN	09/11/2024	(1,000,000)	19.88	19,880,000
2024090903525	S	USDMXN	09/11/2024	(1,000,000)	19.88199	19,881,990
2024090903689	B	USDMXN	09/11/2024	414,640	19.88146	(8,243,647)
2024091003089	S	USDMXN	09/12/2024	(204,200)	20.05138	4,094,492
2024091003406	S	USDMXN	09/12/2024	(1,301,884)	20.041	26,091,057
2024091003408	S	USDMXN	09/12/2024	(1,000,000)	20.04457	20,044,570
2024091003411	S	USDMXN	09/12/2024	(4,323,780)	20.05	86,691,789
2024091003708	S	USDMXN	09/12/2024	(392,905)	20.08642	7,892,052
2024091003755	S	USDMXN	09/12/2024	(5,000,000)	19.9975	99,987,500
2024091003016	B	USDMXN	09/12/2024	2,000,000	20.09	(40,180,000)
2024091003017	B	USDMXN	09/12/2024	1,000,000	20.09	(20,090,000)
2024091003032	B	USDMXN	09/12/2024	2,000,000	20.09	(40,180,000)
2024091003062	B	USDMXN	09/12/2024	1,000,000	20.08841	(20,088,410)
2024091003067	B	USDMXN	09/12/2024	1,000,000	20.06766	(20,067,660)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024091003087 B		USDMXN	09/12/2024	288,621	20.05844	(5,789,286)
2024091003715 B		USDMXN	09/12/2024	150,000	20.09268	(3,013,902)
2024091103040 S		USDMXN	09/13/2024	(3,000,000)	19.92	59,760,000
2024091103041 S		USDMXN	09/13/2024	(3,000,000)	19.925	59,775,000
2024091103051 S		USDMXN	09/13/2024	(2,000,000)	19.93379	39,867,580
2024091103113 S		USDMXN	09/13/2024	(1,000,000)	19.94977	19,949,770
2024091103522 S		USDMXN	09/13/2024	(2,000,000)	19.8	39,600,000
2024091103196 B		USDMXN	09/13/2024	1,000,000	19.91	(19,910,000)
2024091103198 B		USDMXN	09/13/2024	1,000,000	19.9	(19,900,000)
2024091103199 B		USDMXN	09/13/2024	2,000,000	19.9	(39,800,000)
2024091103226 B		USDMXN	09/13/2024	133,085	19.85638	(2,642,588)
2024091103386 B		USDMXN	09/13/2024	1,000,000	19.82757	(19,827,570)
2024091103731 B		USDMXN	09/13/2024	1,000,000	19.79	(19,790,000)
2024091103736 B		USDMXN	09/13/2024	1,000,000	19.785	(19,785,000)
2024091103775 B		USDMXN	09/13/2024	356,390	19.79	(7,052,949)
2024091103146 SON		USDMXN	09/18/2024	(200,000,000)	19.94	3,988,000,000
2024091103231 SON		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	19.94	1,994,000,000
2024091103236 SON		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	19.94	1,994,000,000
2024091103794 SON		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	19.94	1,994,000,000
2024091103131 BON		USDMXN	09/18/2024	200,000,000	19.9385	(3,987,700,000)
2024091103133 SON		USDMXN	12/17/2024	(200,000,000)	20.212	4,042,400,000
2024091103149 BON		USDMXN	12/17/2024	200,000,000	20.2105	(4,042,100,000)
2024091103234 BON		USDMXN	12/17/2024	100,000,000	20.2105	(2,021,050,000)
2024091103241 BON		USDMXN	12/17/2024	100,000,000	20.2105	(2,021,050,000)
2024091203254 BO		USDMXN	09/13/2024	5,000,000	19.5891	(97,945,500)
2024091203358 B		USDMXN	09/13/2024	50,000,000	19.65	(982,500,000)
2024091203498 BO		USDMXN	09/13/2024	10,000,000	19.5671	(195,671,000)
2024091203501 BO		USDMXN	09/13/2024	5,000,000	19.5621	(97,810,495)
2024091203059 S		USDMXN	09/17/2024	(2,000,000)	19.66472	39,329,440
2024091203128 S		USDMXN	09/17/2024	(100,000,000)	19.67	1,967,000,000
2024091203309 S		USDMXN	09/17/2024	(100,000,000)	19.543	1,954,300,000
2024091203359 S		USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	19.663	983,150,000
2024091203442 S		USDMXN	09/17/2024	(2,000,000)	19.56272	39,125,440
2024091203465 S		USDMXN	09/17/2024	(158,213)	19.59084	3,099,531
2024091203466 S		USDMXN	09/17/2024	(160,441)	19.58889	3,142,861
2024091203615 S		USDMXN	09/17/2024	(58,959)	19.51532	1,150,603
2024091203027 B		USDMXN	09/17/2024	1,000,000	19.77554	(19,775,540)
2024091203033 B		USDMXN	09/17/2024	1,000,000	19.76061	(19,760,610)
2024091203194 B		USDMXN	09/17/2024	750,000	19.65636	(14,742,270)
2024091203634 B		USDMXN	09/17/2024	100,000,000	19.525	(1,952,500,000)
2024091203715 B		USDMXN	09/17/2024	100,000	19.49	(1,949,000)
2024091203716 B		USDMXN	09/17/2024	1,900,000	19.49	(37,031,000)
2024091203717 B		USDMXN	09/17/2024	853,768	19.49282	(16,642,346)
2024091203828 B		USDMXN	09/17/2024	660,000	19.52	(12,883,200)
2024091203635 S		USDMXN	10/17/2024	(100,000,000)	19.6165	1,961,650,000
2024091203129 B		USDMXN	10/17/2024	100,000,000	19.757	(1,975,700,000)
2024091203310 B		USDMXN	12/17/2024	100,000,000	19.819	(1,981,900,000)
2024091203113 SO		USDMXN	03/25/2025	(375,346)	20.248	7,600,000
2024091203115 SO		USDMXN	03/25/2025	(375,346)	20.248	7,600,000
2024091203117 SO		USDMXN	04/25/2025	(373,519)	20.347	7,600,000
2024091303729 B		USDMXN	09/17/2024	50,000,000	19.2523	(962,615,000)
2024091303085 SON		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	18.831	1,883,100,000
2024091303087 SO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	46,600,000
2024091303088 SON		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	18.831	1,883,100,000
2024091303090 SO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	46,600,000
2024091303089 SON		USDMXN	09/18/2024	(200,000,000)	19.9385	3,987,700,000
2024091303094 SO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	64,300,000
2024091303095 SO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	64,300,000
2024091303493 S		USDMXN	09/18/2024	(1,000,000)	19.22338	19,223,380
2024091303580 S		USDMXN	09/18/2024	(1,000,000)	19.225	19,225,000
2024091303615 S		USDMXN	09/18/2024	(100,000,000)	19.225	1,922,500,000
2024091303730 S		USDMXN	09/18/2024	(50,000,000)	19.25508	962,754,000
2024091303892 S		USDMXN	09/18/2024	(46,019)	19.21172	884,105
2024091303082 BON		USDMXN	09/18/2024	100,000,000	18.859	(1,885,900,000)
2024091303084 BO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	(43,800,000)
2024091303083 BON		USDMXN	09/18/2024	100,000,000	18.8605	(1,886,050,000)
2024091303086 BO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	(43,650,000)
2024091303092 BO		USDMXN	09/18/2024	0	19.297	(128,300,000)
2024091303091 BON		USDMXN	09/18/2024	100,000,000	19.94	(1,994,000,000)
2024091303093 BON		USDMXN	09/18/2024	100,000,000	19.94	(1,994,000,000)
2024091303127 B		USDMXN	09/18/2024	2,000,000	19.29498	(38,589,960)
2024091303144 B		USDMXN	09/18/2024	3,500,000	19.28553	(67,499,355)
2024091303221 B		USDMXN	09/18/2024	800,000	19.26449	(15,411,592)
2024091303245 B		USDMXN	09/18/2024	1,000,000	19.25035	(19,250,350)
2024091303396 B		USDMXN	09/18/2024	3,500,000	19.25	(67,375,000)
2024091303411 B		USDMXN	09/18/2024	2,500,000	19.252	(48,130,000)
2024091303415 B		USDMXN	09/18/2024	3,946,056	19.252	(75,969,473)
2024091303424 B		USDMXN	09/18/2024	4,053,944	19.255	(78,058,689)
2024091303474 B		USDMXN	09/18/2024	1,000,000	19.24953	(19,249,530)
2024091303690 B		USDMXN	09/18/2024	1,000,000	19.26052	(19,260,520)
2024091303914 B		USDMXN	09/18/2024	1,500,000	19.20548	(28,808,220)
2024091303843 BO		USDMXN	10/16/2024	125,650	19.29952	(2,424,985)
2024091303616 B		USDMXN	11/19/2024	100,000,000	19.4125	(1,941,250,000)
2024091703183 S		USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	19.27	963,500,000
2024091703072 B		USDMXN	09/17/2024	44,000,000	19.28	(848,320,000)
2024091703073 S		USDMXN	09/18/2024	(44,000,000)	19.2831	848,456,400
2024091703147 B		USDMXN	09/18/2024	51,907,604	19.265	(1,000,000,000)
2024091703184 B		USDMXN	09/18/2024	50,000,000	19.2731	(963,655,000)
2024091703148 S		USDMXN	09/19/2024	(51,899,523)	19.268	1,000,000,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024091703198 S		USDMXN	09/19/2024	(3,000,000)	19.295	57,885,000
2024091703333 S		USDMXN	09/19/2024	(3,000,000)	19.28	57,840,000
2024091703528 S		USDMXN	09/19/2024	(1,509,050)	19.09961	28,822,266
2024091703716 S		USDMXN	09/19/2024	(10,000,000)	19.115	191,150,000
2024091703783 S		USDMXN	09/19/2024	(2,000,000)	19.125	38,250,000
2024091703029 B		USDMXN	09/19/2024	1,000,000	19.26671	(19,266,710)
2024091703031 B		USDMXN	09/19/2024	1,000,000	19.27608	(19,276,080)
2024091703153 B		USDMXN	09/19/2024	1,000,000	19.26551	(19,265,510)
2024091703893 B		USDMXN	09/19/2024	523,000	19.11976	(9,999,631)
2024091703929 S		USDMXN	09/20/2024	(1,000,000)	19.105	19,105,000
2024091703717 B		USDMXN	09/19/2025	10,000,000	20.211	(202,110,000)
2024091803152 S		USDMXN	09/19/2024	(78,102,627)	19.2055	1,500,000,000
2024091803534 S		USDMXN	09/19/2024	(10,000,000)	19.19065	191,906,488
2024091803027 B		USDMXN	09/19/2024	175,000,000	19.19	(3,358,250,000)
2024091803045 B		USDMXN	09/19/2024	75,777,032	19.22	(1,456,434,547)
2024091803058 B		USDMXN	09/19/2024	51,975,052	19.24	(1,000,000,000)
2024091803122 B		USDMXN	09/19/2024	78,102,627	19.2055	(1,500,000,000)
2024091803028 S		USDMXN	09/20/2024	(175,000,000)	19.1934	3,358,845,000
2024091803035 S		USDMXN	09/20/2024	(1,380,677)	19.21107	26,524,282
2024091803059 S		USDMXN	09/20/2024	(51,965,869)	19.2434	1,000,000,000
2024091803123 S		USDMXN	09/20/2024	(78,088,599)	19.20895	1,500,000,000
2024091803165 S		USDMXN	09/20/2024	(1,056,277)	19.22	20,301,644
2024091803174 S		USDMXN	09/20/2024	(1,000,000)	19.23	19,230,000
2024091803196 S		USDMXN	09/20/2024	(264,706)	19.26532	5,099,646
2024091803226 S		USDMXN	09/20/2024	(274,757)	19.28294	5,298,123
2024091803410 S		USDMXN	09/20/2024	(1,000,000)	19.36732	19,367,320
2024091803515 S		USDMXN	09/20/2024	(1,000,000)	19.18782	19,187,820
2024091803639 S		USDMXN	09/20/2024	(70,000,000)	19.26	1,348,200,000
2024091803033 B		USDMXN	09/20/2024	417,101,147	19.18	(8,000,000,000)
2024091803153 B		USDMXN	09/20/2024	78,088,599	19.20895	(1,500,000,000)
2024091803391 B		USDMXN	09/20/2024	481,870	19.37273	(9,335,139)
2024091803497 B		USDMXN	09/20/2024	1,000,000	19.2108	(19,210,800)
2024091803535 B		USDMXN	09/20/2024	10,000,000	19.1943	(191,943,000)
2024091803614 B		USDMXN	09/20/2024	439,339	19.2451	(8,455,116)
2024091803034 S		USDMXN	10/11/2024	(415,720,470)	19.2437	8,000,000,000
2024091803640 B		USDMXN	10/21/2024	70,000,000	19.356	(1,354,920,000)
2024091803046 S		USDMXN	12/18/2024	(74,720,755)	19.4917	1,456,434,547
2024091803176 SO		USDMXN	02/04/2025	(137,517)	19.64316	2,701,269
2024091903526 S		USDMXN	09/19/2024	(20,000,000)	19.315	386,300,000
2024091903024 S		USDMXN	09/20/2024	(42,336,460)	19.2645	815,590,729
2024091903029 S		USDMXN	09/20/2024	(83,002,620)	19.2765	1,600,000,000
2024091903074 S		USDMXN	09/20/2024	(125,000,000)	19.37	2,421,250,000
2024091903527 B		USDMXN	09/20/2024	20,000,000	19.3185	(386,370,000)
2024091903041 S		USDMXN	09/23/2024	(1,000,000)	19.38761	19,387,610
2024091903186 S		USDMXN	09/23/2024	(1,000,000)	19.24006	19,240,060
2024091903389 S		USDMXN	09/23/2024	(2,000,000)	19.285	38,570,000
2024091903393 S		USDMXN	09/23/2024	(2,000,000)	19.285	38,570,000
2024091903456 S		USDMXN	09/23/2024	(460,074)	19.3203	8,888,768
2024091903623 S		USDMXN	09/23/2024	(150,000,000)	19.3	2,895,000,000
2024091903640 S		USDMXN	09/23/2024	(5,000,000)	19.29	96,450,000
2024091903646 S		USDMXN	09/23/2024	(2,000,000)	19.29	38,580,000
2024091903659 S		USDMXN	09/23/2024	(672,168)	19.29134	12,967,021
2024091903030 B		USDMXN	09/23/2024	82,960,228	19.28635	(1,600,000,000)
2024091903053 B		USDMXN	09/23/2024	1,000,000	19.35	(19,350,000)
2024091903056 B		USDMXN	09/23/2024	584,948	19.34336	(11,314,860)
2024091903058 B		USDMXN	09/23/2024	1,000,000	19.33151	(19,331,510)
2024091903075 B		USDMXN	09/23/2024	125,000,000	19.37985	(2,422,481,250)
2024091903091 B		USDMXN	09/23/2024	117,903	19.35542	(2,282,068)
2024091903483 B		USDMXN	09/23/2024	309,000	19.31319	(5,967,776)
2024091903624 B		USDMXN	10/07/2024	150,000,000	19.3441	(2,901,615,000)
2024091903025 B		USDMXN	12/18/2024	41,751,512	19.5344	(815,590,729)
2024092003154 S		USDMXN	09/23/2024	(74,947,020)	19.347	1,450,000,000
2024092003395 S		USDMXN	09/23/2024	(100,000,000)	19.385	1,938,500,000
2024092003622 S		USDMXN	09/23/2024	(50,000,000)	19.376	968,800,000
2024092003156 S		USDMXN	09/24/2024	(1,000,000)	19.37	19,370,000
2024092003255 S		USDMXN	09/24/2024	(1,000,000)	19.37	19,370,000
2024092003282 S		USDMXN	09/24/2024	(10,000,000)	19.325	193,250,000
2024092003089 B		USDMXN	09/24/2024	1,000,000	19.33634	(19,336,340)
2024092003155 B		USDMXN	09/24/2024	74,934,045	19.35035	(1,450,000,000)
2024092003183 B		USDMXN	09/24/2024	1,000,000	19.33562	(19,335,620)
2024092003332 B		USDMXN	09/24/2024	25,000	19.3687	(484,218)
2024092003396 B		USDMXN	09/24/2024	100,000,000	19.3884	(1,938,840,000)
2024092003623 B		USDMXN	09/24/2024	50,000,000	19.3794	(968,970,000)
2024092003819 B		USDMXN	09/24/2024	15,000,000	19.413	(291,195,000)
2024092003823 B		USDMXN	09/24/2024	967,440	19.40827	(18,776,344)
2024092003820 S		USDMXN	06/24/2025	(15,000,000)	20.245	303,675,000
2024092003283 B		USDMXN	09/24/2025	10,000,000	20.4235	(204,235,000)
2024092303105 S		USDMXN	09/25/2024	(103,000,000)	19.36	1,994,080,000
2024092303268 S		USDMXN	09/25/2024	(2,000,000)	19.43319	38,866,380
2024092303669 S		USDMXN	09/25/2024	(173,135)	19.41504	3,361,430
2024092303103 B		USDMXN	09/25/2024	1,000,000	19.3547	(19,354,700)
2024092303204 B		USDMXN	09/25/2024	1,000,000	19.34587	(19,345,870)
2024092303106 B		USDMXN	10/16/2024	103,000,000	19.4255	(2,000,826,500)
2024092403038 S		USDMXN	09/26/2024	(50,000,000)	19.3475	967,375,000
2024092403043 S		USDMXN	09/26/2024	(1,000,000)	19.2976	19,297,600
2024092403111 S		USDMXN	09/26/2024	(1,000,000)	19.32295	19,322,950
2024092403148 S		USDMXN	09/26/2024	(1,000,000)	19.3138	19,313,800
2024092403203 S		USDMXN	09/26/2024	(1,000,000)	19.35447	19,354,470
2024092403768 S		USDMXN	09/26/2024	(1,250,852)	19.34319	24,195,468

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024092403014	B	USDMXN	09/26/2024	575,840	19.3531	(11,144,289)
2024092403025	B	USDMXN	09/26/2024	1,000,000	19.34898	(19,348,980)
2024092403445	B	USDMXN	09/26/2024	1,750,000	19.39844	(33,947,270)
2024092403446	B	USDMXN	09/26/2024	293,071	19.39558	(5,684,288)
2024092403552	B	USDMXN	09/26/2024	1,000,000	19.35466	(19,354,660)
2024092403766	B	USDMXN	09/26/2024	625,426	19.35471	(12,104,939)
2024092403039	B	USDMXN	11/26/2024	50,000,000	19.535	(976,750,000)
2024092403643	BO	USDMXN	12/26/2025	160,000	20.66	(3,305,600)
2024092503034	S	USDMXN	09/27/2024	(1,000,000)	19.45124	19,451,240
2024092503049	S	USDMXN	09/27/2024	(1,000,000)	19.48373	19,483,730
2024092503068	S	USDMXN	09/27/2024	(156,463)	19.61147	3,068,473
2024092503424	S	USDMXN	09/27/2024	(20,000,000)	19.5646	391,292,000
2024092503487	S	USDMXN	09/27/2024	(1,000,000)	19.61787	19,617,870
2024092503514	S	USDMXN	09/27/2024	(35,000,000)	19.6233	686,815,500
2024092503529	S	USDMXN	09/27/2024	(388,676)	19.61154	7,622,541
2024092503002	B	USDMXN	09/27/2024	1,000,000	19.42145	(19,421,450)
2024092503064	B	USDMXN	09/27/2024	1,000,000	19.57673	(19,576,730)
2024092503505	B	USDMXN	09/27/2024	100,000,000	19.62	(1,962,000,000)
2024092503702	B	USDMXN	09/27/2024	14,571	19.67238	(286,643)
2024092503094	S	USDMXN	10/04/2024	(100,000,000)	19.60658	1,960,658,100
2024092503095	B	USDMXN	10/11/2024	100,000,000	19.62848	(1,962,848,200)
2024092503515	B	USDMXN	10/11/2024	35,000,000	19.66724	(688,353,505)
2024092503506	S	USDMXN	10/18/2024	(100,000,000)	19.6851	1,968,510,000
2024092503425	B	USDMXN	11/27/2024	20,000,000	19.75177	(395,035,300)
2024092503485	S	USDMXN	08/27/2025	(15,000,000)	20.6291	309,436,500
2024092503486	B	USDMXN	12/29/2025	15,000,000	20.98718	(314,807,708)
2024092503334	S	USDMXN	03/27/2026	(8,000,000)	21.16	169,280,000
2024092503335	B	USDMXN	09/28/2026	8,000,000	21.678	(173,424,000)
2024092603479	S	USDMXN	09/26/2024	(8,500,000)	19.7	167,450,000
2024092603480	B	USDMXN	09/27/2024	8,500,000	19.7031	(167,476,350)
2024092603636	S	USDMXN	09/30/2024	(830,000)	19.66214	16,319,576
2024092603257	B	USDMXN	09/30/2024	63,851	19.59772	(1,251,334)
2024092603266	B	USDMXN	09/30/2024	112,000	19.60448	(2,195,702)
2024092603633	B	USDMXN	09/30/2024	415,000	19.66902	(8,162,643)
2024092603774	B	USDMXN	09/30/2024	417,538	19.62365	(8,193,624)
2024092603865	B	USDMXN	10/02/2024	194,000	19.69148	(3,820,147)
2024092603870	B	USDMXN	10/02/2024	966	19.70048	(19,021)
2024092603056	SO	USDMXN	10/03/2024	(10,000,000)	19.55398	195,539,800
2024092703236	S	USDMXN	09/27/2024	(150,000,000)	19.63	2,944,500,000
2024092703246	B	USDMXN	09/27/2024	150,000,000	19.63	(2,944,500,000)
2024092703480	BO	USDMXN	09/30/2024	5,000,000	19.6847	(98,423,500)
2024092703837	S	USDMXN	10/02/2024	(100,000)	19.69252	1,969,252
2024092703298	B	USDMXN	10/02/2024	61,090	19.73124	(1,205,381)
2024092703830	B	USDMXN	10/02/2024	262,129	19.70473	(5,165,181)
2024092703834	B	USDMXN	10/02/2024	235,200	19.70466	(4,634,536)
2024092703843	B	USDMXN	10/02/2024	310,000	19.7046	(6,108,426)
2024092703849	B	USDMXN	10/02/2024	365,828	19.69198	(7,203,882)
2024092703855	B	USDMXN	10/02/2024	76,000	19.70343	(1,497,461)
2024092703939	B	USDMXN	10/02/2024	47,460	19.68849	(934,416)
2024092703946	B	USDMXN	10/02/2024	257,300	19.68885	(5,065,941)
2024092703250	SON	USDMXN	12/26/2024	(150,000,000)	19.9018	2,985,270,000
2024092703242	BON	USDMXN	12/26/2024	150,000,000	19.897	(2,984,550,000)
2024093003344	S	USDMXN	09/30/2024	(20,000,000)	19.6247	392,493,980
2024093003365	S	USDMXN	09/30/2024	(20,000,000)	19.61141	392,228,260
2024093003144	BO	USDMXN	09/30/2024	3,000,000	19.57446	(58,723,383)
2024093003334	B	USDMXN	09/30/2024	20,000,000	19.6385	(392,770,080)
2024093003335	S	USDMXN	10/02/2024	(20,000,000)	19.64414	392,882,760
2024093003366	B	USDMXN	10/02/2024	20,000,000	19.61842	(392,368,420)
2024093003345	B	USDMXN	10/03/2024	20,000,000	19.635	(392,700,000)
2024093003463	B	USDMXN	10/03/2024	58,220	19.64999	(1,144,022)
2024093003865	B	USDMXN	10/03/2024	132,000	19.68853	(2,598,886)
2024093003870	B	USDMXN	10/03/2024	114,000	19.68664	(2,244,277)
2024072403068	BO	EURMXN	07/25/2024	3,000,000	19.96475	(59,894,235)
2024082003747	BO	EURMXN	08/21/2024	1,000,000	21.13757	(21,137,566)
2024082003758	SO	EURMXN	08/21/2024	(1,000,000)	21.12822	21,128,218
2024082303291	BO	EURMXN	08/26/2024	314,297	21.27411	(6,686,396)
2024082303204	SO	EURMXN	08/26/2024	(314,297)	21.35863	6,712,962
2024091103753	BO	EURMXN	10/22/2024	1,400,000	21.9755	(30,765,696)
2024091103755	BO	EURMXN	10/22/2024	1,400,000	21.9755	(30,765,696)
2024070103022	S	USDMXN	07/01/2024	(19,838,035)	18.399	365,000,000
2024070103024	S	USDMXN	07/01/2024	(16,305,234)	18.399	300,000,000
2024070103141	S	USDMXN	07/01/2024	(33,000,000)	18.397	607,101,000
2024070103145	S	USDMXN	07/01/2024	(856,731)	18.37214	15,739,989
2024070103023	B	USDMXN	07/02/2024	19,835,771	18.4011	(365,000,000)
2024070103025	B	USDMXN	07/02/2024	16,303,373	18.4011	(300,000,000)
2024070103142	B	USDMXN	07/02/2024	33,000,000	18.3992	(607,173,600)
2024070103146	B	USDMXN	07/02/2024	856,731	18.37419	(15,741,745)
2024070103152	B	USDMXN	07/02/2024	4,125	18.38587	(75,838)
2024070103153	S	USDMXN	07/03/2024	(4,125)	18.3871	75,843
2024070203595	S	USDMXN	07/05/2024	(20,000,000)	18.284	365,680,000
2024070203766	S	USDMXN	07/05/2024	(70,000,000)	18.254	1,277,780,000
2024070203043	B	USDMXN	07/05/2024	50,000,000	18.285	(914,250,000)
2024070203047	B	USDMXN	07/05/2024	30,000,000	18.304	(549,120,000)
2024070203059	B	USDMXN	07/05/2024	50,000,000	18.283	(914,150,000)
2024070203075	B	USDMXN	07/05/2024	50,000,000	18.27	(913,500,000)
2024070203134	B	USDMXN	07/05/2024	100,000,000	18.245	(1,824,500,000)
2024070203576	B	USDMXN	07/05/2024	30,000,000	18.285	(548,550,000)
2024070203764	B	USDMXN	07/05/2024	30,000,000	18.249	(547,470,000)
2024070203135	S	USDMXN	07/12/2024	(100,000,000)	18.2633	1,826,330,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024070203060	S	USDMXN	07/19/2024	(50,000,000)	18.321	916,050,000
2024070203076	S	USDMXN	07/26/2024	(50,000,000)	18.328	916,400,000
2024070203044	S	USDMXN	08/05/2024	(50,000,000)	18.3715	918,575,000
2024070203048	S	USDMXN	08/05/2024	(30,000,000)	18.3906	551,718,000
2024070203577	S	USDMXN	08/05/2024	(30,000,000)	18.3727	551,181,000
2024070203767	B	USDMXN	10/07/2024	70,000,000	18.525	(1,296,750,000)
2024070203765	S	USDMXN	12/05/2024	(30,000,000)	18.6925	560,775,000
2024070203596	B	USDMXN	01/06/2025	20,000,000	18.821	(376,420,000)
2024070303036	S	USDMXN	07/05/2024	(913,390)	18.14014	16,569,021
2024070303644	S	USDMXN	07/05/2024	(86,000,000)	18.183	1,563,738,000
2024070303413	S	USDMXN	07/08/2024	(100,000,000)	18.143	1,814,300,000
2024070303672	S	USDMXN	07/08/2024	(15,000,000)	18.193	272,895,000
2024070303037	B	USDMXN	07/08/2024	913,390	18.1482	(16,576,384)
2024070303645	B	USDMXN	07/08/2024	86,000,000	18.1905	(1,564,383,000)
2024070303414	B	USDMXN	07/15/2024	100,000,000	18.1623	(1,816,230,000)
2024070303673	B	USDMXN	04/08/2025	15,000,000	18.983	(284,745,000)
2024070503256	S	USDMXN	07/05/2024	(37,000,000)	18.093	669,441,000
2024070503548	S	USDMXN	07/08/2024	(33,000,000)	18.08	596,640,000
2024070503551	S	USDMXN	07/08/2024	(902,327)	18.06741	16,302,719
2024070503257	B	USDMXN	07/08/2024	37,000,000	18.1016	(669,759,200)
2024070503077	S	USDMXN	07/09/2024	(70,000,000)	18.13	1,269,100,000
2024070503149	S	USDMXN	07/09/2024	(30,000,000)	18.14	544,200,000
2024070503549	B	USDMXN	07/09/2024	33,000,000	18.08285	(596,734,050)
2024070503552	B	USDMXN	07/09/2024	902,327	18.071	(16,305,957)
2024070503078	B	USDMXN	08/09/2024	70,000,000	18.2187	(1,275,309,000)
2024070503150	B	USDMXN	08/09/2024	30,000,000	18.2285	(546,855,000)
2024070803367	S	USDMXN	07/09/2024	(229,859)	18.00157	4,137,829
2024070803637	S	USDMXN	07/09/2024	(21,000,000)	17.99	377,790,000
2024070803612	S	USDMXN	07/10/2024	(10,000,000)	17.981	179,810,000
2024070803368	B	USDMXN	07/10/2024	229,859	18.0045	(4,138,503)
2024070803434	B	USDMXN	07/10/2024	50,000,000	17.991	(899,550,000)
2024070803508	B	USDMXN	07/10/2024	20,000,000	17.987	(359,740,000)
2024070803638	B	USDMXN	07/10/2024	21,000,000	17.99285	(377,849,850)
2024070803435	S	USDMXN	10/10/2024	(50,000,000)	18.2525	912,625,000
2024070803509	S	USDMXN	04/10/2025	(20,000,000)	18.771	375,420,000
2024070803613	B	USDMXN	07/10/2025	10,000,000	19.034	(190,340,000)
2024070903249	B	USDMXN	07/10/2024	106,592	17.94634	(1,912,932)
2024070903567	B	USDMXN	07/10/2024	13,000,000	17.908	(232,804,000)
2024070903119	S	USDMXN	07/11/2024	(50,000,000)	17.953	897,650,000
2024070903250	S	USDMXN	07/11/2024	(106,592)	17.9488	1,913,194
2024070903434	S	USDMXN	07/11/2024	(20,000,000)	17.935	358,700,000
2024070903568	S	USDMXN	07/11/2024	(13,000,000)	17.9107	232,839,100
2024070903120	B	USDMXN	12/11/2024	50,000,000	18.3905	(919,525,000)
2024070903435	B	USDMXN	07/11/2025	20,000,000	18.988	(379,760,000)
2024071003205	B	USDMXN	07/11/2024	135,636	17.84276	(2,420,114)
2024071003517	B	USDMXN	07/11/2024	117,000,000	17.845	(2,087,865,000)
2024071003206	S	USDMXN	07/12/2024	(135,636)	17.8453	2,420,459
2024071003331	S	USDMXN	07/12/2024	(50,000,000)	17.818	890,900,000
2024071003518	S	USDMXN	07/12/2024	(117,000,000)	17.84765	2,088,175,050
2024071003511	B	USDMXN	07/12/2024	100,000,000	17.85	(1,785,000,000)
2024071003088	S	USDMXN	09/18/2024	(23,000,000)	18.0335	414,770,500
2024071003332	B	USDMXN	10/15/2024	50,000,000	18.0835	(904,175,000)
2024071003089	B	USDMXN	12/18/2024	23,000,000	18.2917	(420,709,100)
2024071003512	S	USDMXN	01/13/2025	(100,000,000)	18.369	1,836,900,000
2024071103559	S	USDMXN	07/11/2024	(5,200,000)	17.752	92,310,400
2024071103132	B	USDMXN	07/12/2024	46,000,000	17.84	(820,640,000)
2024071103140	B	USDMXN	07/12/2024	153,598	17.83245	(2,739,031)
2024071103495	B	USDMXN	07/12/2024	36,000,000	17.83	(641,880,000)
2024071103497	B	USDMXN	07/12/2024	30,000,000	17.833	(534,990,000)
2024071103133	S	USDMXN	07/15/2024	(46,000,000)	17.84815	821,014,900
2024071103141	S	USDMXN	07/15/2024	(153,598)	17.8402	2,740,221
2024071103475	S	USDMXN	07/15/2024	(100,000,000)	17.77	1,777,000,000
2024071103496	S	USDMXN	07/15/2024	(36,000,000)	17.83815	642,173,400
2024071103498	S	USDMXN	07/15/2024	(30,000,000)	17.8411	535,233,000
2024071103560	B	USDMXN	07/15/2024	5,200,000	17.76325	(92,368,900)
2024071103476	B	USDMXN	09/17/2024	100,000,000	17.9463	(1,794,630,000)
2024071203324	B	USDMXN	07/15/2024	147,994	17.62899	(2,608,992)
2024071203385	B	USDMXN	07/15/2024	85,000,000	17.63	(1,498,550,000)
2024071203325	S	USDMXN	07/16/2024	(147,994)	17.6315	2,609,364
2024071203386	S	USDMXN	07/16/2024	(85,000,000)	17.6327	1,498,779,500
2024071203420	B	USDMXN	07/16/2024	15,000,000	17.673	(265,095,000)
2024071203425	B	USDMXN	07/16/2024	10,000,000	17.63	(176,300,000)
2024071203428	B	USDMXN	07/16/2024	50,000,000	17.629	(881,450,000)
2024071203400	B	USDMXN	07/17/2024	20,000,000	17.655	(353,100,000)
2024071203401	S	USDMXN	08/23/2024	(20,000,000)	17.7562	355,124,000
2024071203429	S	USDMXN	09/17/2024	(50,000,000)	17.8005	890,025,000
2024071203421	S	USDMXN	07/16/2025	(15,000,000)	18.693	280,395,000
2024071203426	S	USDMXN	07/16/2025	(10,000,000)	18.65	186,500,000
2024071503176	S	USDMXN	07/16/2024	(495,780)	17.78617	8,818,031
2024071503624	S	USDMXN	07/16/2024	(51,000,000)	17.778	906,678,000
2024071503177	B	USDMXN	07/17/2024	495,780	17.789	(8,819,432)
2024071503625	B	USDMXN	07/17/2024	51,000,000	17.7808	(906,820,800)
2024071603070	S	USDMXN	07/17/2024	(940,801)	17.68264	16,635,846
2024071603699	S	USDMXN	07/17/2024	(84,000,000)	17.656	1,483,104,000
2024071603273	S	USDMXN	07/18/2024	(30,000,000)	17.656	529,680,000
2024071603406	S	USDMXN	07/18/2024	(80,000,000)	17.688	1,415,040,000
2024071603071	B	USDMXN	07/18/2024	940,801	17.6856	(16,638,629)
2024071603114	B	USDMXN	07/18/2024	20,000,000	17.683	(353,660,000)
2024071603268	B	USDMXN	07/18/2024	30,000,000	17.656	(529,680,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024071603408	B	USDMXN	07/18/2024	97,000,000	17.688	(1,715,736,000)
2024071603700	B	USDMXN	07/18/2024	84,000,000	17.6588	(1,483,339,200)
2024071603269	S	USDMXN	08/19/2024	(30,000,000)	17.7444	532,332,000
2024071603275	S	USDMXN	09/18/2024	(30,000,000)	17.8267	534,801,000
2024071603274	B	USDMXN	10/18/2024	30,000,000	17.9118	(537,354,000)
2024071603276	B	USDMXN	10/18/2024	30,000,000	17.9118	(537,354,000)
2024071603409	S	USDMXN	12/18/2024	(97,000,000)	18.1145	1,757,106,500
2024071603407	B	USDMXN	01/21/2025	80,000,000	18.2095	(1,456,760,000)
2024071603115	S	USDMXN	07/18/2025	(20,000,000)	18.7195	374,390,000
2024071703198	S	USDMXN	07/17/2024	(30,000,000)	17.76	532,800,000
2024071703295	S	USDMXN	07/18/2024	(86,372)	17.75632	1,533,650
2024071703443	S	USDMXN	07/18/2024	(38,000,000)	17.73	673,740,000
2024071703199	B	USDMXN	07/18/2024	30,000,000	17.76278	(532,883,250)
2024071703012	S	USDMXN	07/19/2024	(30,000,000)	17.785	533,550,000
2024071703067	S	USDMXN	07/19/2024	(30,000,000)	17.753	532,590,000
2024071703409	S	USDMXN	07/19/2024	(10,000,000)	17.745	177,450,000
2024071703296	B	USDMXN	07/19/2024	86,372	17.7592	(1,533,899)
2024071703444	B	USDMXN	07/19/2024	38,000,000	17.73275	(673,844,500)
2024071703458	B	USDMXN	07/19/2024	30,000,000	17.722	(531,660,000)
2024071703466	B	USDMXN	07/19/2024	30,000,000	17.722	(531,660,000)
2024071703459	S	USDMXN	08/19/2024	(30,000,000)	17.8083	534,249,000
2024071703467	S	USDMXN	08/19/2024	(30,000,000)	17.8083	534,249,000
2024071703073	B	USDMXN	09/18/2024	50,000,000	17.9235	(896,175,000)
2024071703013	B	USDMXN	09/19/2024	30,000,000	17.957	(538,710,000)
2024071703068	B	USDMXN	09/19/2024	30,000,000	17.925	(537,750,000)
2024071703074	S	USDMXN	09/25/2024	(50,000,000)	17.9435	897,175,000
2024071703410	B	USDMXN	07/21/2025	10,000,000	18.786	(187,860,000)
2024071803187	S	USDMXN	07/18/2024	(18,200,000)	17.85	324,870,000
2024071803225	S	USDMXN	07/18/2024	(36,800,000)	17.905	658,904,000
2024071803188	B	USDMXN	07/19/2024	18,200,000	17.8528	(324,920,960)
2024071803226	B	USDMXN	07/19/2024	36,800,000	17.90783	(659,007,960)
2024071803245	B	USDMXN	07/19/2024	836,273	17.92279	(14,988,350)
2024071803263	B	USDMXN	07/19/2024	24,000,000	17.94	(430,560,000)
2024071803246	S	USDMXN	07/22/2024	(836,273)	17.9306	14,994,883
2024071803264	S	USDMXN	07/22/2024	(24,000,000)	17.9482	430,756,800
2024071803271	S	USDMXN	07/22/2024	(10,000,000)	17.92	179,200,000
2024071803529	S	USDMXN	07/22/2024	(20,000,000)	18.01	360,200,000
2024071803045	B	USDMXN	01/22/2025	100,000,000	18.38	(1,838,000,000)
2024071803046	S	USDMXN	04/22/2025	(100,000,000)	18.641	1,864,100,000
2024071803272	B	USDMXN	07/22/2025	10,000,000	18.979	(189,790,000)
2024071803530	B	USDMXN	07/22/2025	20,000,000	19.07	(381,400,000)
2024071903173	S	USDMXN	07/19/2024	(27,894,000)	17.925	499,999,950
2024071903190	S	USDMXN	07/19/2024	(7,106,000)	17.95	127,552,700
2024071903360	S	USDMXN	07/22/2024	(163,727)	18.03724	2,953,177
2024071903174	B	USDMXN	07/22/2024	27,894,000	17.9332	(500,228,681)
2024071903191	B	USDMXN	07/22/2024	7,106,000	17.9585	(127,613,101)
2024071903264	S	USDMXN	07/23/2024	(90,000,000)	18.022	1,621,980,000
2024071903714	S	USDMXN	07/23/2024	(30,000,000)	18.09	542,700,000
2024071903031	B	USDMXN	07/23/2024	60,000,000	17.895	(1,073,700,000)
2024071903315	B	USDMXN	07/23/2024	30,000,000	18.036	(541,080,000)
2024071903361	B	USDMXN	07/23/2024	163,727	18.0402	(2,953,661)
2024071903708	B	USDMXN	07/23/2024	30,000,000	18.09	(542,700,000)
2024071903776	B	USDMXN	07/23/2024	30,000,000	18.09	(542,700,000)
2024071903133	BO	USDMXN	08/01/2024	9,600,000	17.962	(172,435,200)
2024071903135	BO	USDMXN	08/01/2024	9,600,000	17.962	(172,435,200)
2024071903032	S	USDMXN	01/23/2025	(60,000,000)	18.416	1,104,960,000
2024071903316	S	USDMXN	01/23/2025	(30,000,000)	18.561	556,830,000
2024071903709	S	USDMXN	01/23/2025	(30,000,000)	18.619	558,570,000
2024071903777	S	USDMXN	01/23/2025	(30,000,000)	18.619	558,570,000
2024071903265	B	USDMXN	04/23/2025	90,000,000	18.815	(1,693,350,000)
2024071903715	B	USDMXN	04/23/2025	30,000,000	18.885	(566,550,000)
2024072203050	B	USDMXN	07/23/2024	601,943	17.95087	(10,805,393)
2024072203320	B	USDMXN	07/23/2024	48,000,000	17.9	(859,200,000)
2024072203051	S	USDMXN	07/24/2024	(601,943)	17.9536	10,807,037
2024072203304	S	USDMXN	07/24/2024	(15,000,000)	17.9175	268,762,500
2024072203321	S	USDMXN	07/24/2024	(48,000,000)	17.90275	859,332,000
2024072203558	S	USDMXN	07/24/2024	(30,000,000)	17.934	538,020,000
2024072203307	B	USDMXN	07/24/2024	10,000,000	17.916	(179,160,000)
2024072203298	B	USDMXN	01/24/2025	30,000,000	18.4435	(553,305,000)
2024072203305	B	USDMXN	01/24/2025	15,000,000	18.4435	(276,652,500)
2024072203559	B	USDMXN	01/24/2025	30,000,000	18.457	(553,710,000)
2024072203308	S	USDMXN	04/24/2025	(10,000,000)	18.699	186,990,000
2024072203299	S	USDMXN	07/24/2025	(30,000,000)	18.9725	569,175,000
2024072303160	S	USDMXN	07/23/2024	(52,616,000)	18.08	951,297,280
2024072303163	B	USDMXN	07/23/2024	52,616,000	18.08	(951,297,280)
2024072303164	S	USDMXN	07/24/2024	(52,616,000)	18.08275	951,441,974
2024072303131	B	USDMXN	07/24/2024	125,011	18.06568	(2,258,415)
2024072303161	B	USDMXN	07/24/2024	52,616,000	18.08275	(951,441,974)
2024072303231	B	USDMXN	07/24/2024	19,000,000	18.0685	(343,301,500)
2024072303128	S	USDMXN	07/25/2024	(185,000)	18.06959	3,342,874
2024072303132	S	USDMXN	07/25/2024	(125,011)	18.0683	2,258,743
2024072303232	S	USDMXN	07/25/2024	(19,000,000)	18.07128	343,354,225
2024072303009	BO	USDMXN	08/15/2024	20,000,000	18.082	(361,640,000)
2024072303011	BO	USDMXN	08/15/2024	20,000,000	18.082	(361,640,000)
2024072303082	BO	USDMXN	08/15/2024	20,185,820	18.082	(365,000,000)
2024072403401	S	USDMXN	07/25/2024	(527,610)	18.28874	9,649,316
2024072403733	S	USDMXN	07/25/2024	(61,000,000)	18.37	1,120,570,000
2024072403063	S	USDMXN	07/26/2024	(15,000,000)	18.366	275,490,000
2024072403065	S	USDMXN	07/26/2024	(10,000,000)	18.364	183,640,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024072403724 S		USDMXN	07/26/2024	(20,000,000)	18.37	367,400,000
2024072403402 B		USDMXN	07/26/2024	527,610	18.2918	(9,650,933)
2024072403734 B		USDMXN	07/26/2024	61,000,000	18.37285	(1,120,743,850)
2024072403725 B		USDMXN	01/27/2025	20,000,000	18.91	(378,200,000)
2024072403064 B		USDMXN	07/28/2025	15,000,000	19.461	(291,915,000)
2024072403066 B		USDMXN	07/28/2025	10,000,000	19.459	(194,590,000)
2024072503708 S		USDMXN	07/26/2024	(4,400,000)	18.45696	81,210,611
2024072503115 B		USDMXN	07/26/2024	621,273	18.35649	(11,404,400)
2024072503605 B		USDMXN	07/26/2024	83,000,000	18.45	(1,531,350,000)
2024072503116 S		USDMXN	07/29/2024	(621,273)	18.3644	11,409,313
2024072503606 S		USDMXN	07/29/2024	(83,000,000)	18.45845	1,532,051,350
2024072503191 B		USDMXN	07/29/2024	150,000,000	18.347	(2,752,050,000)
2024072503253 B		USDMXN	07/29/2024	30,000,000	18.332	(549,960,000)
2024072503619 B		USDMXN	07/29/2024	50,000,000	18.437	(921,850,000)
2024072503709 B		USDMXN	07/29/2024	4,400,000	18.466	(81,250,400)
2024072503192 S		USDMXN	08/05/2024	(150,000,000)	18.3672	2,755,080,000
2024072503620 S		USDMXN	09/30/2024	(50,000,000)	18.621	931,050,000
2024072503254 S		USDMXN	01/29/2025	(30,000,000)	18.872	566,160,000
2024072603271 S		USDMXN	07/29/2024	(138,000,000)	18.405	2,539,890,000
2024072603275 S		USDMXN	07/29/2024	(798,535)	18.43062	14,717,500
2024072603272 B		USDMXN	07/30/2024	138,000,000	18.40788	(2,540,286,750)
2024072603276 B		USDMXN	07/30/2024	798,535	18.4336	(14,719,882)
2024072903422 S		USDMXN	07/30/2024	(699,475)	18.70056	13,080,580
2024072903465 S		USDMXN	07/30/2024	(100,000,000)	18.705	1,870,500,000
2024072903423 B		USDMXN	07/31/2024	699,475	18.7036	(13,082,708)
2024072903466 B		USDMXN	07/31/2024	100,000,000	18.70788	(1,870,787,500)
2024072903638 B		USDMXN	07/31/2024	21,000	18.62421	(391,108)
2024072903564 BO		USDMXN	08/15/2024	8,096,437	18.6815	(151,253,592)
2024072903569 BO		USDMXN	08/15/2024	8,096,437	18.6815	(151,253,592)
2024073003119 S		USDMXN	07/31/2024	(378,428)	18.75324	7,096,752
2024073003781 S		USDMXN	07/31/2024	(86,000,000)	18.735	1,611,210,000
2024073003231 S		USDMXN	08/01/2024	(50,000,000)	18.786	939,300,000
2024073003120 B		USDMXN	08/01/2024	378,428	18.7561	(7,097,835)
2024073003177 B		USDMXN	08/01/2024	50,000,000	18.755	(937,750,000)
2024073003222 B		USDMXN	08/01/2024	50,000,000	18.782	(939,100,000)
2024073003782 B		USDMXN	08/01/2024	86,000,000	18.73793	(1,611,461,550)
2024073003846 B		USDMXN	08/01/2024	50,000,000	18.757	(937,850,000)
2024073003848 B		USDMXN	08/01/2024	50,000,000	18.756	(937,800,000)
2024073003232 B		USDMXN	08/22/2024	50,000,000	18.8478	(942,390,000)
2024073003178 S		USDMXN	09/03/2024	(50,000,000)	18.851	942,550,000
2024073003223 S		USDMXN	09/03/2024	(50,000,000)	18.8783	943,915,000
2024073003606 BO		USDMXN	09/10/2024	2,000,000	18.87775	(37,755,502)
2024073003847 S		USDMXN	11/01/2024	(50,000,000)	19.028	951,400,000
2024073003849 S		USDMXN	11/01/2024	(50,000,000)	19.027	951,350,000
2024073103259 S		USDMXN	08/01/2024	(161,000,000)	18.6345	3,000,154,500
2024073103398 S		USDMXN	08/01/2024	(665,353)	18.54223	12,337,119
2024073103423 S		USDMXN	08/01/2024	(144,000,000)	18.557	2,672,208,000
2024073103197 S		USDMXN	08/02/2024	(5,434,760)	18.62	101,195,240
2024073103102 B		USDMXN	08/02/2024	15,000,000	18.669	(280,035,000)
2024073103260 B		USDMXN	08/02/2024	161,000,000	18.63745	(3,000,629,450)
2024073103399 B		USDMXN	08/02/2024	665,353	18.5453	(12,339,162)
2024073103424 B		USDMXN	08/02/2024	144,000,000	18.55998	(2,672,636,400)
2024073103739 B		USDMXN	08/02/2024	50,000,000	18.563	(928,150,000)
2024073103140 BO		USDMXN	08/09/2024	5,428,784	18.6405	(101,195,240)
2024073103198 B		USDMXN	08/09/2024	5,428,784	18.6405	(101,195,240)
2024073103740 S		USDMXN	10/02/2024	(50,000,000)	18.739	936,950,000
2024073103103 S		USDMXN	05/02/2025	(15,000,000)	19.478	292,170,000
2024080103200 S		USDMXN	08/02/2024	(162,000,000)	18.62	3,016,440,000
2024080103236 S		USDMXN	08/02/2024	(190,000,000)	18.7	3,553,000,000
2024080103241 S		USDMXN	08/02/2024	(487,715)	18.7692	9,154,013
2024080103080 B		USDMXN	08/05/2024	10,000,000	18.62	(186,200,000)
2024080103201 B		USDMXN	08/05/2024	162,000,000	18.6287	(3,017,849,400)
2024080103237 B		USDMXN	08/05/2024	190,000,000	18.70875	(3,554,662,500)
2024080103242 B		USDMXN	08/05/2024	487,715	18.7789	(9,158,744)
2024080103081 S		USDMXN	08/05/2025	(10,000,000)	19.7015	197,015,000
2024080203380 S		USDMXN	08/02/2024	(90,474,024)	19.035	1,722,173,050
2024080203426 S		USDMXN	08/02/2024	(84,214,959)	18.999	1,600,000,000
2024080203559 S		USDMXN	08/02/2024	(40,000,000)	19.105	764,200,000
2024080203061 B		USDMXN	08/02/2024	90,474,024	19.035	(1,722,173,050)
2024080203440 B		USDMXN	08/02/2024	17,106,163	18.999	(325,000,000)
2024080203449 B		USDMXN	08/02/2024	47,002,474	18.999	(893,000,000)
2024080203483 B		USDMXN	08/02/2024	90,580,346	19.05	(1,725,555,583)
2024080203543 B		USDMXN	08/02/2024	20,000,000	19.105	(382,100,000)
2024080203553 B		USDMXN	08/02/2024	20,000,000	19.105	(382,100,000)
2024080203062 S		USDMXN	08/05/2024	(90,432,217)	19.0438	1,722,173,050
2024080203441 S		USDMXN	08/05/2024	(17,098,244)	19.0078	325,000,000
2024080203450 S		USDMXN	08/05/2024	(46,980,713)	19.0078	893,000,000
2024080203484 S		USDMXN	08/05/2024	(90,580,346)	19.0587	1,726,343,632
2024080203544 S		USDMXN	08/05/2024	(20,000,000)	19.1137	382,274,000
2024080203554 S		USDMXN	08/05/2024	(20,000,000)	19.1137	382,274,000
2024080203591 S		USDMXN	08/05/2024	(562,443)	19.16598	10,779,766
2024080203712 S		USDMXN	08/05/2024	(104,000,000)	19.15	1,991,600,000
2024080203714 S		USDMXN	08/05/2024	(86,000,000)	19.15	1,646,900,000
2024080203381 B		USDMXN	08/05/2024	90,432,217	19.0438	(1,722,173,050)
2024080203427 B		USDMXN	08/05/2024	84,175,970	19.0078	(1,600,000,000)
2024080203560 B		USDMXN	08/05/2024	40,000,000	19.114	(764,560,000)
2024080203592 B		USDMXN	08/06/2024	562,443	19.1691	(10,781,522)
2024080203713 B		USDMXN	08/06/2024	104,000,000	19.153	(1,991,912,000)
2024080203715 B		USDMXN	08/06/2024	86,000,000	19.15303	(1,647,160,150)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024080503071 S		USDMXN	08/05/2024	(150,000,000)	19.65	2,947,500,000
2024080503147 S		USDMXN	08/05/2024	(1,940,000)	19.5265	37,881,413
2024080503069 B		USDMXN	08/05/2024	150,000,000	19.65	(2,947,500,000)
2024080503088 B		USDMXN	08/05/2024	27,940,000	19.63	(548,462,200)
2024080503070 S		USDMXN	08/06/2024	(150,000,000)	19.6531	2,947,965,000
2024080503089 S		USDMXN	08/06/2024	(27,940,000)	19.6331	548,548,814
2024080503314 S		USDMXN	08/06/2024	(72,000,000)	19.395	1,396,440,000
2024080503320 S		USDMXN	08/06/2024	(252,304)	19.32674	4,876,208
2024080503072 B		USDMXN	08/06/2024	150,000,000	19.6531	(2,947,965,000)
2024080503148 B		USDMXN	08/06/2024	1,940,000	19.52969	(37,887,594)
2024080503315 B		USDMXN	08/07/2024	72,000,000	19.39825	(1,396,674,000)
2024080503321 B		USDMXN	08/07/2024	252,304	19.3303	(4,877,107)
2024080503378 B		USDMXN	08/07/2024	58,000	19.31673	(1,120,370)
2024080603242 S		USDMXN	08/07/2024	(902,773)	19.2923	17,416,559
2024080603497 S		USDMXN	08/07/2024	(92,000,000)	19.4	1,784,800,000
2024080603243 B		USDMXN	08/08/2024	902,773	19.2958	(17,419,718)
2024080603498 B		USDMXN	08/08/2024	92,000,000	19.4032	(1,785,094,400)
2024080703196 S		USDMXN	08/08/2024	(139,000,000)	19.14	2,660,460,000
2024080703199 S		USDMXN	08/08/2024	(96,980)	19.1251	1,854,746
2024080703430 S		USDMXN	08/09/2024	(50,000,000)	19.2605	963,025,000
2024080703446 S		USDMXN	08/09/2024	(150,000,000)	19.265	2,889,750,000
2024080703197 B		USDMXN	08/09/2024	139,000,000	19.1431	(2,660,890,900)
2024080703200 B		USDMXN	08/09/2024	96,980	19.1284	(1,855,066)
2024080703386 B		USDMXN	08/09/2024	50,000,000	19.267	(963,350,000)
2024080703447 B		USDMXN	08/16/2024	150,000,000	19.2863	(2,892,945,000)
2024080703431 B		USDMXN	08/23/2024	50,000,000	19.303	(965,150,000)
2024080703387 S		USDMXN	09/09/2024	(50,000,000)	19.3595	967,975,000
2024080803402 S		USDMXN	08/08/2024	(88,935,000)	19.115	1,699,992,525
2024080803392 B		USDMXN	08/08/2024	88,935,000	19.115	(1,699,992,525)
2024080803229 S		USDMXN	08/09/2024	(485,300)	19.10039	9,269,418
2024080803393 S		USDMXN	08/09/2024	(88,935,000)	19.11795	1,700,254,883
2024080803403 B		USDMXN	08/09/2024	88,935,000	19.11795	(1,700,254,883)
2024080803188 S		USDMXN	08/12/2024	(50,000,000)	19.135	956,750,000
2024080803194 S		USDMXN	08/12/2024	(50,000,000)	19.115	955,750,000
2024080803719 S		USDMXN	08/12/2024	(10,000,000)	18.95	189,500,000
2024080803721 S		USDMXN	08/12/2024	(10,000,000)	18.95	189,500,000
2024080803230 B		USDMXN	08/12/2024	485,300	19.11	(9,274,081)
2024080803189 B		USDMXN	08/26/2024	50,000,000	19.1772	(958,860,000)
2024080803195 B		USDMXN	09/12/2024	50,000,000	19.2075	(960,375,000)
2024080803720 B		USDMXN	08/12/2025	10,000,000	20.01	(200,100,000)
2024080803722 B		USDMXN	08/12/2025	10,000,000	20.005	(200,050,000)
2024080903419 B		USDMXN	08/12/2024	53,000,000	18.83	(997,990,000)
2024080903424 B		USDMXN	08/12/2024	321,593	18.82743	(6,054,771)
2024080903594 B		USDMXN	08/12/2024	43,000,000	18.83	(809,690,000)
2024080903420 S		USDMXN	08/13/2024	(53,000,000)	18.8329	998,143,700
2024080903425 S		USDMXN	08/13/2024	(321,593)	18.8302	6,055,661
2024080903595 S		USDMXN	08/13/2024	(43,000,000)	18.8329	809,814,700
2024081203244 B		USDMXN	08/13/2024	35,000,000	19.02	(665,700,000)
2024081203247 B		USDMXN	08/13/2024	3,139,092	19.04605	(59,787,297)
2024081203245 S		USDMXN	08/14/2024	(35,000,000)	19.0229	665,801,500
2024081203248 S		USDMXN	08/14/2024	(3,139,092)	19.0488	59,795,939
2024081303184 B		USDMXN	08/14/2024	661,537	19.07363	(12,617,912)
2024081303456 B		USDMXN	08/14/2024	105,290,000	18.995	(1,999,983,550)
2024081303534 B		USDMXN	08/14/2024	710,000	18.99273	(13,484,838)
2024081303185 S		USDMXN	08/15/2024	(661,537)	19.0762	12,619,612
2024081303394 S		USDMXN	08/15/2024	(15,000,000)	19.015	285,225,000
2024081303424 S		USDMXN	08/15/2024	(20,000,000)	19.02	380,400,000
2024081303457 S		USDMXN	08/15/2024	(105,290,000)	18.9979	2,000,288,891
2024081303535 S		USDMXN	08/15/2024	(710,000)	18.9953	13,486,663
2024081303679 B		USDMXN	08/16/2024	9,000,000	18.998	(170,982,000)
2024081303068 B		USDMXN	08/30/2024	52,429,862	19.0731	(1,000,000,000)
2024081303680 S		USDMXN	09/20/2024	(9,000,000)	19.1	171,900,000
2024081303069 S		USDMXN	11/15/2024	(51,815,888)	19.2991	1,000,000,000
2024081303395 B		USDMXN	08/15/2025	15,000,000	20.095	(301,425,000)
2024081303425 B		USDMXN	08/15/2025	20,000,000	20.099	(401,980,000)
2024081403489 B		USDMXN	08/15/2024	128,000,000	18.855	(2,413,440,000)
2024081403495 B		USDMXN	08/15/2024	302,421	18.86229	(5,704,349)
2024081403490 S		USDMXN	08/16/2024	(128,000,000)	18.85783	2,413,801,600
2024081403496 S		USDMXN	08/16/2024	(302,421)	18.8649	5,705,138
2024081403762 B		USDMXN	08/16/2024	15,000,000	18.845	(282,675,000)
2024081403763 S		USDMXN	08/18/2025	(15,000,000)	19.927	298,905,000
2024081503055 S		USDMXN	08/16/2024	(37,638,876)	18.65	701,965,028
2024081503325 S		USDMXN	08/16/2024	(102,326)	18.64428	1,907,792
2024081503347 S		USDMXN	08/16/2024	(170,000,000)	18.6595	3,172,115,000
2024081503141 S		USDMXN	08/19/2024	(33,000,000)	18.66	615,780,000
2024081503056 B		USDMXN	08/19/2024	37,621,628	18.65855	(701,965,028)
2024081503144 B		USDMXN	08/19/2024	25,000,000	18.66	(466,500,000)
2024081503326 B		USDMXN	08/19/2024	102,326	18.6537	(1,908,756)
2024081503348 B		USDMXN	08/19/2024	170,000,000	18.6681	(3,173,577,000)
2024081503142 B		USDMXN	05/19/2025	33,000,000	19.461	(642,213,000)
2024081503145 S		USDMXN	08/19/2025	(25,000,000)	19.729	493,225,000
2024081603189 S		USDMXN	08/19/2024	(831,776)	18.64287	15,506,691
2024081603533 S		USDMXN	08/19/2024	(118,000,000)	18.64	2,199,520,000
2024081603066 S		USDMXN	08/20/2024	(10,000,000)	18.623	186,230,000
2024081603070 S		USDMXN	08/20/2024	(10,000,000)	18.64	186,400,000
2024081603072 S		USDMXN	08/20/2024	(5,000,000)	18.623	93,115,000
2024081603190 B		USDMXN	08/20/2024	831,776	18.6458	(15,509,129)
2024081603534 B		USDMXN	08/20/2024	118,000,000	18.64285	(2,199,856,300)
2024081603067 B		USDMXN	08/20/2025	10,000,000	19.696	(196,960,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024081603071 B		USDMXN	08/20/2025	10,000,000	19.715	(197,150,000)
2024081603073 B		USDMXN	08/20/2025	5,000,000	19.696	(98,480,000)
2024081903110 S		USDMXN	08/20/2024	(561,031)	18.74639	10,517,314
2024081903403 S		USDMXN	08/20/2024	(122,000,000)	18.691	2,280,302,000
2024081903100 S		USDMXN	08/21/2024	(30,000,000)	18.775	563,250,000
2024081903111 B		USDMXN	08/21/2024	561,031	18.7493	(10,518,945)
2024081903404 B		USDMXN	08/21/2024	122,000,000	18.69383	(2,280,646,650)
2024081903101 B		USDMXN	09/23/2024	30,000,000	18.8705	(566,115,000)
2024082003043 S		USDMXN	08/21/2024	(100,428)	18.78932	1,886,977
2024082003732 S		USDMXN	08/21/2024	(53,000,000)	18.976	1,005,728,000
2024082003833 S		USDMXN	08/21/2024	(23,000,000)	18.98281	436,604,561
2024082003624 S		USDMXN	08/22/2024	(50,000,000)	19.003	950,150,000
2024082003044 B		USDMXN	08/22/2024	100,428	18.7922	(1,887,266)
2024082003733 B		USDMXN	08/22/2024	53,000,000	18.97893	(1,005,883,025)
2024082003736 B		USDMXN	08/22/2024	50,000,000	19	(950,000,000)
2024082003834 B		USDMXN	08/22/2024	23,000,000	18.9859	(436,675,700)
2024082003737 S		USDMXN	08/29/2024	(50,000,000)	19.0202	951,010,000
2024082003625 B		USDMXN	09/23/2024	50,000,000	19.0974	(954,870,000)
2024082103297 B		USDMXN	08/22/2024	2,474,952	19.29533	(47,755,018)
2024082103237 S		USDMXN	08/23/2024	(50,000,000)	19.182	959,100,000
2024082103298 S		USDMXN	08/23/2024	(2,474,952)	19.2983	47,762,369
2024082103281 B		USDMXN	08/23/2024	15,000,000	19.221	(288,315,000)
2024082103238 B		USDMXN	09/23/2024	50,000,000	19.2755	(963,775,000)
2024082103282 S		USDMXN	05/23/2025	(15,000,000)	20.047	300,705,000
2024082203225 S		USDMXN	08/23/2024	(32,000,000)	19.44	622,080,000
2024082203231 S		USDMXN	08/23/2024	(314,297)	19.42792	6,106,144
2024082203113 S		USDMXN	08/26/2024	(50,000,000)	19.426	971,300,000
2024082203220 B		USDMXN	08/26/2024	10,000,000	19.44	(194,400,000)
2024082203226 B		USDMXN	08/26/2024	32,000,000	19.4494	(622,380,800)
2024082203232 B		USDMXN	08/26/2024	314,297	19.4379	(6,109,282)
2024082203405 B		USDMXN	08/26/2024	10,000,000	19.415	(194,150,000)
2024082203114 B		USDMXN	10/28/2024	50,000,000	19.6185	(980,925,000)
2024082203406 S		USDMXN	05/27/2025	(10,000,000)	20.253	202,530,000
2024082203221 S		USDMXN	08/26/2025	(10,000,000)	20.551	205,510,000
2024082303445 S		USDMXN	08/26/2024	(125,000,000)	19.0735	2,384,187,500
2024082303469 S		USDMXN	08/26/2024	(597,848)	19.0445	11,385,716
2024082303446 B		USDMXN	08/27/2024	125,000,000	19.0766	(2,384,575,000)
2024082303470 B		USDMXN	08/27/2024	597,848	19.0477	(11,387,628)
2024082603224 S		USDMXN	08/27/2024	(228,000,000)	19.3885	4,420,578,000
2024082603230 S		USDMXN	08/27/2024	(78,374)	19.4233	1,522,278
2024082603225 B		USDMXN	08/28/2024	228,000,000	19.39165	(4,421,296,200)
2024082603231 B		USDMXN	08/28/2024	78,374	19.4266	(1,522,537)
2024082703253 S		USDMXN	08/28/2024	(184,000,000)	19.665	3,618,360,000
2024082703261 S		USDMXN	08/28/2024	(837,415)	19.6658	16,468,434
2024082703040 B		USDMXN	08/28/2024	41,199,669	19.631	(808,790,697)
2024082703132 S		USDMXN	08/29/2024	(686,000)	19.67995	13,500,446
2024082703511 S		USDMXN	08/29/2024	(100,000,000)	19.685	1,968,500,000
2024082703514 S		USDMXN	08/29/2024	(50,000,000)	19.685	984,250,000
2024082703518 S		USDMXN	08/29/2024	(660,000)	19.68539	12,992,357
2024082703665 S		USDMXN	08/29/2024	(50,000,000)	19.726	986,300,000
2024082703220 B		USDMXN	08/29/2024	100,000,000	19.67	(1,967,000,000)
2024082703254 B		USDMXN	08/29/2024	184,000,000	19.6682	(3,618,948,800)
2024082703262 B		USDMXN	08/29/2024	837,415	19.6695	(16,471,529)
2024082703470 B		USDMXN	08/29/2024	203,252,033	19.68	(4,000,000,000)
2024082703118 S		USDMXN	09/18/2024	(76,104)	19.71	1,500,000
2024082703471 S		USDMXN	09/19/2024	(202,591,141)	19.7442	4,000,000,000
2024082703221 S		USDMXN	09/30/2024	(100,000,000)	19.7684	1,976,840,000
2024082703512 B		USDMXN	09/30/2024	100,000,000	19.7833	(1,978,330,000)
2024082703515 B		USDMXN	09/30/2024	50,000,000	19.7833	(989,165,000)
2024082703666 B		USDMXN	11/29/2024	50,000,000	20.009	(1,000,450,000)
2024082703041 S		USDMXN	12/18/2024	(40,496,230)	19.972	808,790,697
2024082703119 B		USDMXN	12/18/2024	75,049	19.987	(1,500,000)
2024082803244 S		USDMXN	08/29/2024	(70,000,000)	19.543	1,368,010,000
2024082803310 S		USDMXN	08/29/2024	(356,993)	19.5985	6,996,528
2024082803620 S		USDMXN	08/30/2024	(50,000,000)	19.665	983,250,000
2024082803622 S		USDMXN	08/30/2024	(30,000,000)	19.665	589,950,000
2024082803245 B		USDMXN	08/30/2024	70,000,000	19.54615	(1,368,230,500)
2024082803311 B		USDMXN	08/30/2024	356,993	19.6019	(6,997,742)
2024082803621 B		USDMXN	09/30/2024	50,000,000	19.76	(988,000,000)
2024082803623 B		USDMXN	09/30/2024	30,000,000	19.76	(592,800,000)
2024082903361 S		USDMXN	08/30/2024	(60,000,000)	19.86	1,191,600,000
2024082903435 S		USDMXN	08/30/2024	(233,564)	19.76206	4,615,706
2024082903727 S		USDMXN	08/30/2024	(15,000,000)	19.86	297,900,000
2024082903600 S		USDMXN	09/03/2024	(50,000,000)	19.85	992,500,000
2024082903362 B		USDMXN	09/03/2024	60,000,000	19.87305	(1,192,383,000)
2024082903436 B		USDMXN	09/03/2024	233,564	19.776	(4,618,963)
2024082903728 B		USDMXN	09/03/2024	15,000,000	19.8735	(298,102,500)
2024082903601 B		USDMXN	01/03/2025	50,000,000	20.228	(1,011,400,000)
2024083003294 S		USDMXN	09/03/2024	(943,090)	19.63061	18,513,424
2024083003316 S		USDMXN	09/03/2024	(18,000,000)	19.64	353,520,000
2024083003295 B		USDMXN	09/04/2024	943,090	19.6345	(18,517,096)
2024083003317 B		USDMXN	09/04/2024	18,000,000	19.6439	(353,590,200)
2024090303186 S		USDMXN	09/04/2024	(75,000,000)	19.82	1,486,500,000
2024090303188 S		USDMXN	09/04/2024	(74,000,000)	19.82	1,466,680,000
2024090303191 S		USDMXN	09/04/2024	(93,688)	19.82079	1,856,975
2024090303072 B		USDMXN	09/04/2024	245,855,195	19.865	(4,883,913,447)
2024090303143 B		USDMXN	09/04/2024	100,857,287	19.83	(2,000,000,000)
2024090303056 S		USDMXN	09/05/2024	(30,000,000)	19.89	596,700,000
2024090303073 S		USDMXN	09/05/2024	(245,813,741)	19.86835	4,883,913,447

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024090303144	S	USDMXN	09/05/2024	(100,839,997)	19.8334	2,000,000,000
2024090303193	S	USDMXN	09/05/2024	(60,000)	19.83109	1,189,865
2024090303290	S	USDMXN	09/05/2024	(70,000,000)	19.815	1,387,050,000
2024090303187	B	USDMXN	09/05/2024	75,000,000	19.8234	(1,486,755,000)
2024090303189	B	USDMXN	09/05/2024	74,000,000	19.8234	(1,466,931,600)
2024090303192	B	USDMXN	09/05/2024	93,688	19.8243	(1,857,304)
2024090303291	B	USDMXN	09/19/2024	70,000,000	19.8591	(1,390,137,000)
2024090303057	B	USDMXN	10/07/2024	30,000,000	19.9895	(599,685,000)
2024090403637	S	USDMXN	09/05/2024	(720,454)	19.94202	14,367,302
2024090403136	B	USDMXN	09/05/2024	60,861,955	19.715	(1,199,893,447)
2024090403553	B	USDMXN	09/05/2024	957,655	19.90599	(19,063,069)
2024090403567	B	USDMXN	09/05/2024	100,411,688	19.918	(2,000,000,000)
2024090403571	B	USDMXN	09/05/2024	75,308,766	19.918	(1,500,000,000)
2024090403631	B	USDMXN	09/05/2024	67,000,000	19.913	(1,334,171,000)
2024090403137	S	USDMXN	09/06/2024	(60,851,924)	19.71825	1,199,893,447
2024090403554	S	USDMXN	09/06/2024	(957,655)	19.9089	19,065,861
2024090403568	S	USDMXN	09/06/2024	(100,396,062)	19.9211	2,000,000,000
2024090403572	S	USDMXN	09/06/2024	(75,297,047)	19.9211	1,500,000,000
2024090403583	S	USDMXN	09/06/2024	(10,000,000)	19.9	199,000,000
2024090403632	S	USDMXN	09/06/2024	(67,000,000)	19.9161	1,334,378,700
2024090403639	S	USDMXN	09/06/2024	(38,000)	19.94491	757,907
2024090403352	B	USDMXN	09/06/2024	20,000,000	19.855	(397,100,000)
2024090403638	B	USDMXN	09/06/2024	720,454	19.9453	(14,369,668)
2024090403584	B	USDMXN	06/06/2025	10,000,000	20.7645	(207,645,000)
2024090403353	S	USDMXN	09/08/2025	(20,000,000)	21.007	420,140,000
2024090503268	S	USDMXN	09/06/2024	(247,329)	19.97382	4,940,104
2024090503261	B	USDMXN	09/06/2024	140,964,234	19.97	(2,815,055,747)
2024090503372	B	USDMXN	09/06/2024	115,000,000	19.989	(2,298,735,000)
2024090503374	B	USDMXN	09/06/2024	968,524	20.00205	(19,372,471)
2024090503373	S	USDMXN	09/09/2024	(115,000,000)	19.9985	2,299,827,500
2024090503484	S	USDMXN	09/09/2024	(100,000,000)	20.018	2,001,800,000
2024090503488	S	USDMXN	09/09/2024	(100,000,000)	20.018	2,001,800,000
2024090503704	S	USDMXN	09/09/2024	(10,000,000)	19.9615	199,615,000
2024090503262	S	USDMXN	09/17/2024	(140,716,905)	20.0051	2,815,055,747
2024090503485	B	USDMXN	09/17/2024	100,000,000	20.0432	(2,004,320,000)
2024090503489	B	USDMXN	09/17/2024	100,000,000	20.0432	(2,004,320,000)
2024090503375	S	USDMXN	09/18/2024	(968,524)	20.03851	19,407,784
2024090503705	B	USDMXN	09/09/2025	10,000,000	21.1115	(211,115,000)
2024090603492	B	USDMXN	09/09/2024	265,000,000	19.964	(5,290,460,000)
2024090603496	B	USDMXN	09/09/2024	704,548	20.00541	(14,094,771)
2024090603493	S	USDMXN	09/10/2024	(265,000,000)	19.96705	5,291,268,250
2024090603497	S	USDMXN	09/10/2024	(704,548)	20.0083	14,096,807
2024090903243	B	USDMXN	09/10/2024	207,000,000	19.89	(4,117,230,000)
2024090903250	B	USDMXN	09/10/2024	525,531	19.87618	(10,445,552)
2024090903244	S	USDMXN	09/11/2024	(207,000,000)	19.89318	4,117,887,225
2024090903251	S	USDMXN	09/11/2024	(525,531)	19.8792	10,447,140
2024090903176	SO	USDMXN	09/25/2024	(381,277)	19.933	7,600,000
2024090903179	SO	USDMXN	09/25/2024	(381,277)	19.933	7,600,000
2024090903187	SO	USDMXN	10/25/2024	(379,554)	20.0235	7,600,000
2024090903627	SO	USDMXN	10/28/2024	(881,923)	20.0375	17,671,532
2024090903193	SO	USDMXN	11/25/2024	(377,762)	20.1185	7,600,000
2024090903628	SO	USDMXN	11/26/2024	(1,200,960)	20.1252	24,169,560
2024090903200	SO	USDMXN	12/26/2024	(375,962)	20.2148	7,600,000
2024090903629	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.21626	8,188,615
2024090903697	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.2203	8,190,253
2024090903699	SO	USDMXN	12/26/2024	(405,051)	20.2203	8,190,253
2024090903202	SO	USDMXN	01/27/2025	(374,099)	20.3155	7,600,000
2024091003063	B	USDMXN	09/11/2024	39,601,920	20.0815	(795,265,962)
2024091003174	B	USDMXN	09/11/2024	30,000,000	20.062	(601,860,000)
2024091003178	B	USDMXN	09/11/2024	37,000,000	20.062	(742,294,000)
2024091003195	B	USDMXN	09/11/2024	39,601,920	20.0815	(795,265,962)
2024091003347	B	USDMXN	09/11/2024	30,000,000	20.072	(602,160,000)
2024091003352	B	USDMXN	09/11/2024	701,326	20.04064	(14,055,029)
2024091003175	S	USDMXN	09/12/2024	(30,000,000)	20.0652	601,956,000
2024091003179	S	USDMXN	09/12/2024	(37,000,000)	20.0652	742,412,400
2024091003348	S	USDMXN	09/12/2024	(30,000,000)	20.07515	602,254,500
2024091003353	S	USDMXN	09/12/2024	(701,326)	20.0438	14,057,243
2024091003363	S	USDMXN	09/12/2024	(50,000,000)	20.04	1,002,000,000
2024091003370	S	USDMXN	09/12/2024	(584,000)	20.02448	11,694,296
2024091003402	S	USDMXN	09/12/2024	(100,000,000)	20.028	2,002,800,000
2024091003377	B	USDMXN	09/12/2024	15,000,000	20.038	(300,570,000)
2024091003415	B	USDMXN	09/12/2024	100,000,000	20.028	(2,002,800,000)
2024091003469	B	USDMXN	09/12/2024	50,000,000	20.061	(1,003,050,000)
2024091003608	B	USDMXN	09/12/2024	10,000,000	20.079	(200,790,000)
2024091003416	S	USDMXN	09/26/2024	(100,000,000)	20.0712	2,007,120,000
2024091003403	B	USDMXN	09/26/2024	100,000,000	20.0712	(2,007,120,000)
2024091003470	S	USDMXN	10/15/2024	(50,000,000)	20.162	1,008,100,000
2024091003364	B	USDMXN	12/13/2024	50,000,000	20.323	(1,016,150,000)
2024091003064	S	USDMXN	12/18/2024	(39,601,920)	20.3823	807,178,219
2024091003196	S	USDMXN	12/18/2024	(39,017,479)	20.3823	795,265,962
2024091003609	S	USDMXN	06/12/2025	(10,000,000)	20.9365	209,365,000
2024091003378	S	USDMXN	09/12/2025	(15,000,000)	21.176	317,640,000
2024091103447	B	USDMXN	09/12/2024	2,515,849	19.75652	(49,704,414)
2024091103448	S	USDMXN	09/13/2024	(2,515,849)	19.7595	49,711,917
2024091103455	B	USDMXN	09/13/2024	25,000,000	19.768	(494,200,000)
2024091103826	SO	USDMXN	02/25/2025	(374,200)	20.31	7,600,000
2024091103841	BO	USDMXN	02/25/2025	374,200	20.32765	(7,606,606)
2024091103843	BO	USDMXN	02/25/2025	374,200	20.32765	(7,606,606)
2024091103456	S	USDMXN	03/13/2025	(25,000,000)	20.321	508,025,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2024092303607	B	USDMXN	09/23/2024	30,911,901	19.41	(600,000,000)
2024092303498	S	USDMXN	09/24/2024	(409,591)	19.4181	7,953,486
2024092303608	S	USDMXN	09/24/2024	(30,905,055)	19.4143	600,000,000
2024092303614	S	USDMXN	09/24/2024	(102,000,000)	19.407	1,979,514,000
2024092303618	S	USDMXN	09/24/2024	(150,000,000)	19.407	2,911,050,000
2024092303499	B	USDMXN	09/25/2024	409,591	19.4216	(7,954,918)
2024092303615	B	USDMXN	09/25/2024	102,000,000	19.4105	(1,979,871,000)
2024092303619	B	USDMXN	09/25/2024	150,000,000	19.4105	(2,911,575,000)
2024092303339	B	USDMXN	10/25/2024	100,000,000	19.56	(1,956,000,000)
2024092303340	S	USDMXN	12/26/2024	(100,000,000)	19.7465	1,974,650,000
2024092303369	S	USDMXN	06/25/2025	(30,000,000)	20.168	605,040,000
2024092303373	S	USDMXN	06/25/2025	(50,000,000)	20.263	1,013,150,000
2024092303085	B	USDMXN	06/25/2025	100,000,000	20.172	(2,017,200,000)
2024092303086	S	USDMXN	09/25/2025	(100,000,000)	20.444	2,044,400,000
2024092303370	B	USDMXN	09/25/2025	30,000,000	20.44	(613,200,000)
2024092303374	B	USDMXN	09/25/2025	50,000,000	20.5345	(1,026,725,000)
2024092403237	S	USDMXN	09/25/2024	(15,000,000)	19.348	290,220,000
2024092403301	S	USDMXN	09/25/2024	(91,000,000)	19.354	1,761,214,000
2024092403325	S	USDMXN	09/25/2024	(437,358)	19.35031	8,463,020
2024092403046	B	USDMXN	09/25/2024	15,966,181	19.3454	(308,872,158)
2024092403137	S	USDMXN	09/26/2024	(25,000,000)	19.285	482,125,000
2024092403316	S	USDMXN	09/26/2024	(20,000,000)	19.35	387,000,000
2024092403744	S	USDMXN	09/26/2024	(210,000)	19.34491	4,062,431
2024092403133	B	USDMXN	09/26/2024	33,000,000	19.285	(636,405,000)
2024092403238	B	USDMXN	09/26/2024	15,000,000	19.35145	(290,271,750)
2024092403302	B	USDMXN	09/26/2024	91,000,000	19.35755	(1,761,537,050)
2024092403326	B	USDMXN	09/26/2024	437,358	19.354	(8,464,636)
2024092403436	B	USDMXN	09/26/2024	40,000,000	19.39	(775,600,000)
2024092403437	S	USDMXN	10/28/2024	(40,000,000)	19.4891	779,564,000
2024092403047	S	USDMXN	12/18/2024	(15,756,935)	19.6023	308,872,158
2024092403012	B	USDMXN	12/18/2024	24,000,000	19.59	(470,160,000)
2024092403134	S	USDMXN	06/26/2025	(33,000,000)	20.108	663,564,000
2024092403013	S	USDMXN	09/17/2025	(24,000,000)	20.405	489,720,000
2024092403138	B	USDMXN	09/26/2025	25,000,000	20.372	(509,300,000)
2024092403317	B	USDMXN	09/26/2025	20,000,000	20.4415	(408,830,000)
2024092503108	S	USDMXN	09/26/2024	(30,000,000)	19.6	588,000,000
2024092503111	S	USDMXN	09/26/2024	(225,556)	19.59185	4,419,052
2024092503005	S	USDMXN	09/27/2024	(30,000,000)	19.417	582,510,000
2024092503496	S	USDMXN	09/27/2024	(20,000,000)	19.621	392,420,000
2024092503499	S	USDMXN	09/27/2024	(15,000,000)	19.621	294,315,000
2024092503109	B	USDMXN	09/27/2024	30,000,000	19.6034	(588,102,000)
2024092503112	B	USDMXN	09/27/2024	225,556	19.5954	(4,419,852)
2024092503320	B	USDMXN	09/27/2024	100,000,000	19.585	(1,958,500,000)
2024092503327	B	USDMXN	09/27/2024	30,000,000	19.612	(588,360,000)
2024092503321	S	USDMXN	10/18/2024	(100,000,000)	19.6497	1,964,970,000
2024092503328	S	USDMXN	10/28/2024	(30,000,000)	19.707	591,210,000
2024092503006	B	USDMXN	12/27/2024	30,000,000	19.693	(590,790,000)
2024092503497	B	USDMXN	03/27/2025	20,000,000	20.171	(403,420,000)
2024092503500	B	USDMXN	03/27/2025	15,000,000	20.171	(302,565,000)
2024092603468	S	USDMXN	09/27/2024	(171,000,000)	19.728	3,373,488,000
2024092603474	S	USDMXN	09/27/2024	(614,027)	19.70638	12,100,259
2024092603219	B	USDMXN	09/27/2024	58,760,803	19.547	(1,148,597,424)
2024092603238	S	USDMXN	09/30/2024	(739,000)	19.55041	14,447,753
2024092603561	S	USDMXN	09/30/2024	(5,000,000)	19.723	98,615,000
2024092603469	B	USDMXN	09/30/2024	171,000,000	19.7375	(3,375,112,500)
2024092603475	B	USDMXN	09/30/2024	614,027	19.716	(12,106,165)
2024092603044	B	USDMXN	10/17/2024	35,000,000	19.58	(685,300,000)
2024092603049	B	USDMXN	10/17/2024	35,000,000	19.6	(686,000,000)
2024092603626	BO	USDMXN	11/14/2024	623,135	19.79823	(12,336,972)
2024092603628	BO	USDMXN	11/14/2024	623,135	19.79823	(12,336,972)
2024092603220	S	USDMXN	12/18/2024	(58,020,813)	19.7963	1,148,597,424
2024092603045	S	USDMXN	03/31/2025	(35,000,000)	20.075	702,625,000
2024092603050	S	USDMXN	03/31/2025	(35,000,000)	20.095	703,325,000
2024092603562	B	USDMXN	09/30/2025	5,000,000	20.8205	(104,102,500)
2024092703038	S	USDMXN	09/27/2024	(30,000,000)	19.655	589,650,000
2024092703196	S	USDMXN	09/30/2024	(93,000,000)	19.6	1,822,800,000
2024092703198	S	USDMXN	09/30/2024	(109,650)	19.61643	2,150,942
2024092703039	B	USDMXN	09/30/2024	30,000,000	19.6643	(589,929,000)
2024092703626	S	USDMXN	10/02/2024	(50,000,000)	19.6829	984,145,000
2024092703197	B	USDMXN	10/02/2024	93,000,000	19.60633	(1,823,388,225)
2024092703199	B	USDMXN	10/02/2024	109,650	19.6229	(2,151,652)
2024092703627	B	USDMXN	11/04/2024	50,000,000	19.7836	(989,180,000)
2024092703247	SON	USDMXN	12/26/2024	(150,000,000)	19.9018	2,985,270,000
2024093003203	S	USDMXN	09/30/2024	(50,000,000)	19.603	980,150,000
2024093003403	S	USDMXN	09/30/2024	(100,000,000)	19.62	1,962,000,000
2024093003065	S	USDMXN	10/02/2024	(30,014,417)	19.6457	589,654,230
2024093003424	S	USDMXN	10/02/2024	(100,000,000)	19.63	1,963,000,000
2024093003204	B	USDMXN	10/02/2024	50,000,000	19.6093	(980,465,000)
2024093003308	B	USDMXN	10/02/2024	3,840,790	19.66431	(75,526,488)
2024093003404	B	USDMXN	10/02/2024	100,000,000	19.6266	(1,962,660,000)
2024093003309	S	USDMXN	10/03/2024	(3,840,790)	19.6673	75,537,968
2024093003425	B	USDMXN	10/03/2024	100,000,000	19.63315	(1,963,315,000)
2024093003430	B	USDMXN	10/03/2024	358,000	19.6386	(7,030,619)
2024093003267	B	USDMXN	10/10/2024	100,000,000	19.695	(1,969,500,000)
2024093003268	S	USDMXN	12/03/2024	(100,000,000)	19.8615	1,986,150,000
2024093003066	B	USDMXN	12/18/2024	29,656,051	19.8831	(589,654,230)

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C75927	05/08/2026	Unwound		mxn/usd	319,702,425	16,950,000	
C75937	05/08/2026	Unwound		usd/mxn	16,950,000	319,702,425	
C95423	03/07/2025	Unwound		usd/mxn	1,000	18,297	
E85607	30/08/2024	Unwound	12,020,000	mxn			12,020,000
E85608	30/08/2024	Unwound	12,020,000	mxn			12,020,000
E90924	24/07/2024	Unwound	650,000	mxn			650,000
E90925	24/07/2024	Unwound	650,000	mxn			650,000
E93001	25/07/2024	Unwound	43,755,000	mxn			43,755,000
E93002	25/07/2024	Unwound	43,755,000	mxn			43,755,000
MNF304	18/10/2024	Unwound		mxn		193,000,000	
MVW600	21/02/2025	Unwound		mxn		171,591,840	
SDS468	18/10/2024	Unwound	193,000,000	mxn	193,000,000	193,000,000	
SDS935	18/10/2024	Unwound	193,000,000	mxn	193,000,000	193,000,000	
SDS944	18/10/2024	Unwound	193,000,000	mxn	193,000,000	193,000,000	
SDU078	21/12/2030	Unwound	72,000,000	mxn	72,000,000	72,000,000	
SDU767	04/09/2025	Unwound	81,472,136	mxn	81,472,136	81,472,136	
SDV050	16/04/2025	Unwound	16,089,000	mxn	16,089,000	16,089,000	
SDV072	16/04/2025	Unwound	14,203,900	mxn	14,203,900	14,203,900	
SDV078	16/04/2025	Unwound	16,089,000	mxn	16,089,000	16,089,000	
SDV085	16/04/2025	Unwound	14,203,900	mxn	14,203,900	14,203,900	
SGI985	25/05/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGI986	25/05/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGI987	25/05/2027	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	
SGT320	07/12/2026	Unwound	10,228,300	mxn	10,228,300	10,228,300	
SGT336	07/12/2026	Unwound	10,228,300	mxn	10,228,300	10,228,300	
SHC058	02/08/2027	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	
SHC481	21/02/2025	Unwound	171,591,840	mxn	171,591,840	171,591,840	
SHC485	21/02/2025	Unwound	171,591,840	mxn	171,591,840	171,591,840	
SHC488	21/02/2025	Unwound	171,591,840	mxn	171,591,840	171,591,840	
SHZ237	14/12/2028	Unwound	293,938,000	mxn	293,938,000	293,938,000	
SJF657	11/06/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	
SKJ441	18/12/2026	Unwound	10,508,404	mxn	10,508,404	10,508,404	
SKJ444	18/12/2026	Unwound	7,326,661	mxn	7,326,661	7,326,661	
SLO028	27/05/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negocio	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	286,832,406,343	Compra	Divisas	Divisas	240,231,908,080	280,596,167,534	285,323,069,824	1,509,336,520	-	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	(286,563,353,425)	Venta	Divisas	Divisas	(240,066,870,340)	(280,468,209,296)	(285,055,138,694)	(1,508,214,731)	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	920,700,500	Compra	Acción	Acción	42,614,992	93,336,742	742,440,000	178,260,500	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	822,240,000	Venta	Acción	Acción	(40,220,627)	(88,244,859)	742,440,000	79,800,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	10,991,845,906	Compra	Divisas	Divisas	557,592,388	658,787,714	8,571,711,398	2,420,134,509	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	10,952,461,706	Venta	Divisas	Divisas	(470,368,679)	(519,269,600)	8,640,633,748	2,311,827,959	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,159,476,700	Compra	Índice	Índice	255,733,356	308,417,560	14,626,700	4,144,850,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,869,913,400	Venta	Índice	Índice	(106,666,249)	(130,263,597)	29,253,400	1,840,660,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	43,963,955,225	Compra	Tasas	Tasas	784,754,800	436,938,162	1,650,000,000	36,983,736,446	5,330,218,779	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	43,772,626,525	Venta	Tasas	Tasas	(769,002,005)	(428,231,863)	1,810,000,000	36,822,120,829	5,140,505,696	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	49,230,250	Compra	Acción NE	Acción NE	312,376	(2,801,163)	-	49,230,250	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	49,230,250	Venta	Acción NE	Acción NE	(2,706,742)	(2,290,719)	-	49,230,250	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	186,913,400	Compra	Índice NE	Índice NE	27,209,969	20,344,759	29,253,400	157,660,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,443,891,700	Venta	Índice NE	Índice NE	(176,276,639)	(198,498,722)	14,626,700	2,429,265,000	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,404,136,425	Compra	Divisas NE	Divisas NE	48,634,764	84,211,644	341,559,633	1,062,576,792	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,404,136,425	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(136,290,189)	(214,569,512)	341,559,633	1,062,576,792	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	7,030,187,302	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	175,997,608	(291,622,026)	-	5,830,111,123	1,200,076,178	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	6,302,791,528	CCIRS / IRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES FIJA MXN	LIBOR USD / TASA DE INTERES FIJA MXN	(131,736,791)	(765,455,059)	-	3,375,432,918	2,927,358,610	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	83,323,597,663	CCIRS / IRS	/TASA DE INTERES TIIE MXN	/TASA DE INTERES TIIE MXN	2,264,235,066	564,860,117	580,000,000	61,787,636,347	20,955,961,317	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(247,710,000)	CCIRS	Reuters_SOFR / LIBOR USD	TASA DE INTERES / LIBOR USD	(104,098,722)	(245,355,453)	(247,710,000)	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	139,937,306	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	LIBOR USD / FIJA MXN	136,505,586	145,080,159	-	139,937,306	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	177,841,157,295	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD FIJA MXN	FIJA USD / LIBOR USD FIJA MXN	1,961,502,227	(2,141,791,810)	7,420,349,262	90,639,857,766	79,780,950,267	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	592,602,906,877	CCIRS / IRS	/TASA DE INTERES TIIE MXN	/TASA DE INTERES TIIE MXN	10,057,578,248	1,017,388,508	171,294,000,000	296,338,234,162	124,970,672,715	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	177,472,244,571	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	(2,057,575,210)	1,501,688,220	1,709,640,262	93,082,936,149	82,679,668,161	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	599,474,447,112	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(10,180,578,829)	(479,925,249)	179,649,800,184	288,915,216,878	130,909,430,051	-	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
10000000000			A C T I V O	877,879,643,641	803,211,649,996
100200001001			Efectivo y equivalentes de efectivo	43,216,208,295	58,749,807,423
100400001001			Cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	2,116,017,545	1,548,618,782
100600001001			INVERSIONES EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS	180,770,887,483	165,334,422,864
	100600102001		Instrumentos financieros negociables	74,951,978,059	74,832,124,655
	100600102002		Instrumentos financieros para cobrar o vender	100,765,941,203	85,655,159,961
	130600102003		Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)(neto)	5,052,968,221	4,847,138,248
		100600303009	Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	5,053,513,330	4,847,662,963
		100600303010	Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros para cobrar principal e interés (valores)	-545,109	-524,715
101000001001			Deudores por reporte	14,074,130,004	2,694,236,519
101200001001			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
101400001001			Instrumentos financieros derivados	59,878,121,602	48,471,629,015
	101400102001		Con fines de negociación	44,556,239,383	34,975,956,945
	101400102002		Con fines de cobertura	15,321,882,219	13,495,672,070
101600001001			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	-277,252,209	-1,252,235,797
	101800104001		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1	501,570,839,134	474,259,984,853
	101800105001		Créditos comerciales	232,297,746,503	238,757,736,034
		101800107001	Actividad empresarial o comercial	184,754,760,917	198,926,329,324
		101800107002	Entidades financieras	24,157,443,753	24,931,179,139
		101800107003	Entidades gubernamentales	23,385,541,833	14,900,227,571
	101800105002		Créditos de consumo	43,406,113,518	33,650,540,514
	101800105003		Créditos a la vivienda	225,866,979,113	201,851,708,305
		101800507023	Media y residencial	221,334,793,108	196,782,443,679
		101800507024	De interés social	3,673,174	4,253,800
		101800507025	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	4,528,512,831	5,065,010,826
		101800507026	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800507027	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800105004		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
	101800104002		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2	5,639,852,890	5,427,414,877
	101800205005		Créditos comerciales	334,506,844	1,429,102,071
		101800506007	Actividad empresarial o comercial	334,506,844	1,429,102,071
		101800506008	Entidades financieras	0	0
		101800506009	Entidades gubernamentales	0	0
	101800205006		Créditos de consumo	1,169,085,688	773,725,909
	101800205007		Créditos a la vivienda	4,136,260,358	3,224,586,897
		101800706018	Media y residencial	3,982,794,064	3,082,138,768
		101800706019	De interés social	0	0
		101800706020	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	153,466,294	142,448,129
		101800706021	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101800706022	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104003		Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	20,397,843,046	19,790,905,375
	101800305008		Créditos comerciales	7,893,908,733	9,363,459,192
		101800806023	Actividad empresarial o comercial	7,837,542,273	9,307,092,732
		101800806024	Entidades financieras	56,366,460	56,366,460
		101800806025	Entidades gubernamentales	0	0
	101800305009		Créditos de consumo	1,082,585,706	843,578,591
	101800305010		Créditos a la vivienda	11,421,348,607	9,583,867,592
		101801006034	Media y residencial	10,912,474,041	9,166,253,137
		101801006035	De interés social	8,419,150	9,276,308
		101801006036	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	500,455,416	408,338,147
		101801006037	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
		101801006038	Remodelación o mejoramiento con garantía de la subcuenta de vivienda	0	0
	101800104004		Cartera de crédito valuada a valor razonable	0	0
	101800405011		Créditos comerciales	0	0
		101801106039	Actividad empresarial o comercial	0	0
		101801106040	Entidades financieras	0	0
		101801106041	Entidades gubernamentales	0	0
	101800405012		Créditos de consumo	0	0
	101800405013		Créditos a la vivienda	0	0
		101801306050	Media y residencial	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

ESTADO DE SITUACIÓN FINANCIERA DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2024 Y 2023

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	527,608,535,070	499,478,305,105
	131800103002		Partidas diferidas	3,693,833,206	2,898,781,209
	101800103003		ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-14,761,650,176	-15,793,353,804
	131800102001		Cartera de crédito (neto)	516,540,718,100	486,583,732,510
	131800102002		Derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
131800001001			Total de cartera de crédito (neto)	516,540,718,100	486,583,732,510
102000001001			Activos virtuales	0	0
102200001001			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
132400001001			Otras cuentas por cobrar (neto)	38,765,185,585	20,020,459,069
132600001001			Bienes adjudicados (neto)	830,928,213	508,028,575
102800001001			Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	12,844,821	13,941,494
103000001001			Activos relacionados con operaciones discontinuadas	0	0
103200001001			Pagos anticipados y otros activos	1,987,796,090	2,341,942,861
133400001001			Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	5,372,268,163	4,998,163,967
133600001001			Activos por derechos de uso de propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,325,957,114	2,558,591,262
103800001001			INVERSIONES PERMANENTES	371,694,933	54,187,783
104000001001			Activo por impuestos a la utilidad diferidos	7,219,864,327	6,055,236,011
134200001001			Activos intangibles (neto)	4,674,273,575	4,530,887,658
134400001001			Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	0	0
104600001001			Crédito mercantil	0	0
200000000000			P A S I V O	791,474,144,167	722,087,501,144
200200001001			CAPTACIÓN TRADICIONAL	554,320,582,598	530,579,304,785
	200200102001		Depósitos de exigibilidad inmediata	290,767,635,943	269,967,441,042
	200200102002		Depósitos a plazo	232,733,717,497	248,675,460,664
		200200203003	Del público en general	207,470,482,163	207,458,589,061
		200200203004	Mercado de dinero	25,263,235,334	41,216,871,603
		200200203005	Fondos especiales	0	0
	200200102003		Títulos de crédito emitidos	29,349,904,002	10,677,211,141
	200200102004		Cuenta global de captación sin movimientos	1,469,325,156	1,259,191,938
200400001001			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	40,269,152,193	30,450,536,792
	200400102001		De exigibilidad inmediata	0	0
	200400102002		De corto plazo	16,148,818,369	21,617,705,212
	200400102003		De largo plazo	24,120,333,824	8,832,831,580
230600001001			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	21,099,449,340	8,614,245,665
200800001001			ACREEDORES POR REPORTO	55,415,151,416	60,089,470,621
201000001001			PRÉSTAMO DE VALORES	0	51,112
201200001001			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	0	1,029,960,454
	201200102001		Reportos	0	0
	201200102002		Préstamo de valores	0	1,029,960,454
	201200102003		Instrumentos financieros derivados	0	0
	201200102004		Otros colaterales vendidos	0	0
201400001001			Instrumentos financieros derivados	60,340,599,109	43,857,070,736
	201400102001		Con fines de negociación	44,281,726,803	34,786,196,061
	201400102002		Con fines de cobertura	16,058,872,306	9,070,874,675
201600001001			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	0	0
201800001001			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
202000001001			Pasivo por arrendamiento	2,544,928,682	2,690,839,439
202200001001			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
202400001001			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	38,748,862,183	27,509,094,622
	202400102001		Acreedores por liquidación de operaciones	27,841,827,736	13,510,013,675
	202400102002		Acreedores por cuentas de margen	1,713,651,590	2,302,255,158
	202400102003		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	1,878,624,784	5,867,290,415
	202400102004		Contribuciones por pagar	541,156,067	422,833,992
	202400102005		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	6,773,602,006	5,406,701,382
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: 2024

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 2024 Y 2023

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	9,104,335,363	9,101,670,737
	203000102001		OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,104,335,363	9,101,670,737
	203000102002		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	203000102003		Otros	0	0
203200001001			Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo	0	0
203400001001			Pasivo por impuestos a la utilidad	1,223,154,450	677,174,411
203600001001			Pasivo por beneficios a los empleados	7,162,191,839	6,420,664,751
203800001001			Créditos diferidos y cobros anticipados	1,245,736,994	1,067,417,019
400000000000			CAPITAL CONTABLE	86,405,499,474	81,124,148,852
440200001001			Participación controladora	86,404,183,330	81,122,773,916
	400200102001		CAPITAL CONTRIBUIDO	13,468,335,561	13,468,335,561
		400200103001	Capital social	9,420,300,433	9,420,300,433
		400200103002	Capital social no exhibido	0	0
		400200103003	Incremento por actualización del capital social pagado	1,250,665,369	1,250,665,369
		400200103004	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103005	Incremento por actualización de las aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
		400200103006	Prima en venta de acciones	2,716,852,485	2,716,852,485
		400200103007	Incremento por actualización de la prima en venta de acciones	80,517,274	80,517,274
		400200103008	Instrumentos financieros que califican como capital	0	0
		400200103009	Incremento por actualización de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	400200102002		CAPITAL GANADO	72,935,847,769	67,654,438,355
		400200203010	Reservas de capital	10,077,244,487	8,949,346,887
		400200203011	Incremento por actualización de reservas de capital	162,317,294	162,317,294
		400200203012	Resultados acumulados	62,905,970,405	58,288,818,747
		400201204003	Resultado de ejercicios anteriores	54,988,696,182	49,837,386,812
		400201204004	Incremento por actualización del resultado de ejercicios anteriores	0	0
		430201204005	Resultado neto	7,917,274,223	8,451,431,935
	400200203013		Otros resultados integrales	-217,542,392	255,794,311
		400201304006	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	-84,610,297	-762,964,559
		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	456,638,876	1,476,297,642
		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	-589,570,971	-457,538,772
		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	7,857,975	-1,838,884
	400200203015		Incremento por actualización de la participación en ORI de otras entidades	0	0
440400001001			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	1,316,144	1,374,936
	440400102001		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	130,875	135,120
	440400102002		Otra participación no controladora	1,185,269	1,239,816
	440400102003		Otros resultados integrales correspondientes a la participación no controladora	0	0
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	4,382,576,085,205	3,333,998,363,616
700200001001			Avales otorgados	0	0
700400001001			Activos y pasivos contingentes	0	0
700600001001			Compromisos crediticios	327,895,502,450	257,625,741,043
700800001001			Bienes en fideicomiso o mandato	498,323,728,835	450,990,946,600
	700800102001		Fideicomisos	468,959,283,345	421,919,956,989
	700800102002		Mandatos	29,364,445,490	29,070,989,611
701000001001			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
701200001001			Bienes en custodia o en administración	755,919,624,474	683,331,050,929
701400001001			Colaterales recibidos por la entidad	20,039,825,637	10,218,531,872
701600001001			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	0	1,029,960,454
701800001001			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	1,984,752,345	1,646,909,460
702000001001			Otras cuentas de registro	2,778,412,651,464	1,929,155,223,258

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03

AÑO: 2024

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

ESTADO DE RESULTADO INTEGRAL DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

CONSOLIDADO

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

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
500200101001	Ingresos por intereses	63,012,990,101	57,993,532,782
600400101002	Gastos por intereses	42,123,984,015	38,100,639,672
500600101003	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
330000000001	MARGEN FINANCIERO	20,889,006,086	19,892,893,110
600800201004	Estimación preventiva para riesgos crediticios	3,552,906,321	1,005,879,246
330000000002	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	17,336,099,765	18,887,013,864
501000301005	Comisiones y tarifas cobradas	4,139,976,095	3,602,122,350
601200301006	Comisiones y tarifas pagadas	319,995,441	334,915,856
501400301007	Resultado por intermediación	1,763,693,966	1,552,496,756
501600301008	Otros ingresos (egresos) de la operación	523,878,916	763,744,038
501800301009	Subsidios	0	0
602000301010	Gastos de administración y promoción	12,867,627,512	12,810,325,676
330000000003	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	10,576,025,789	11,660,135,476
502200401011	Participación en el resultado neto de otras entidades	168,402,432	168,135,720
330000000004	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	10,744,428,221	11,828,271,196
602400501012	Impuestos a la utilidad	2,827,023,123	3,378,704,141
330000000005	RESULTADO DE OPERACIONES CONTINUAS	7,917,405,098	8,451,567,055
502600601013	Operaciones discontinuadas	0	0
330000000006	RESULTADO NETO	7,917,405,098	8,451,567,055
502800701014	Otros Resultados Integrales	-208,094,750	242,284,381
502801402150	Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	16,403,561	-406,553,500
502801402151	Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	-245,759,312	624,308,722
502801402152	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0
502801402153	Remediación de beneficios definidos a los empleados	21,261,001	24,529,159
502801402154	Efecto acumulado por conversión	0	0
502801402155	Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
503000701015	Participación en ORI de otras entidades	9,336,529	265,189
330000000007	RESULTADO INTEGRAL	7,718,646,877	8,694,116,625
543200601016	Resultado neto atribuible a:	7,917,405,098	8,451,567,055
543201602158	Participación controladora	7,917,274,223	8,451,431,935
543201602159	Participación no controladora	130,875	135,120
543400701017	Resultado integral atribuible a:	7,718,646,877	8,694,116,625
543401702160	Participación controladora	7,718,646,877	8,694,116,625
543401702161	Participación no controladora	0	0
330000000008	UTILIDAD BÁSICA POR ACCIÓN ORDINARIA	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

ESTADO DE FLUJOS DE EFECTIVO DE INSTITUCIONES DE
CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2024 Y 2023

CONSOLIDADO
Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
		Actividades de operación		
851000102001		Resultado antes de impuestos a la utilidad	10,744,428,221	11,828,271,196
851000102002		Ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión:	1,306,369,813	-2,134,270,874
	851000203001	Depreciación de propiedades, mobiliario y equipo	818,481,348	802,109,702
	851000203002	Amortizaciones de activo intangibles	648,722,299	606,204,223
	851000203003	Pérdidas o reversión de pérdidas por deterioro de activos de larga duración	8,489,400	-20,623,438
	851000203004	Participación en el resultado neto de otras entidades	-168,402,432	-168,135,720
	851000203005	Otros ajustes por partidas asociadas con actividades de inversión	-920,802	-3,353,825,641
	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	412,533,720	1,383,514,549
	851000303001	Intereses asociados con préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000303002	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	412,533,720	1,383,514,549
	851000303003	Intereses asociados con instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000303004	Otros intereses	0	0
851000102004		Cambios en partidas de operación	-8,515,210,135	-10,558,620,982
	851000403001	Cambios de préstamos interbancarios y de otros organismos	3,464,845,574	-19,067,408,738
	851000403002	Cambio en cuentas de margen (instrumentos financieros derivados)	-733,450,599	659,274,600
	851000403003	Cambio en inversiones en instrumentos financieros (valores)(neto)	13,912,204,056	-35,357,918,906
	851000403004	Cambio en deudores por reporto (neto)	-6,065,481,472	530,256,489
	851000403005	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	851000403006	Cambio en instrumentos financieros derivados (activo)	-17,549,189,904	-4,824,784,203
	851000403007	Cambio de cartera de crédito (neto)	-13,076,747,326	-6,331,917,525
	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)	-11,980,180,262	-4,585,871,213
	851000403012	Cambio en bienes adjudicados (neto)	-245,701,050	-242,699,647
	851000403013	Cambio en otros activos operativos (neto)	3,983,535,046	618,503,704
	851000403014	Cambio en captación tradicional	12,763,575,503	45,113,650,985
	851000403015	Cambio en acreedores por reporto	-12,905,510,907	4,328,565,021
	851000403016	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	-57,595	-9,784
	851000403017	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	-8,384,487,076	-2,935,363,971
	851000403018	Cambio en instrumentos financieros derivados (pasivo)	20,513,755,211	9,072,976,921
	851000403019	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	1,570,591,155	44,755,822
	851000403020	Cambio en otros pasivos operativos	267,202,932	213,808,707
	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	891,664,110	809,604,359
	851000403023	Cambio en otras cuentas por pagar	6,915,096,699	6,724,316,181
	851000403024	Cambio en otras provisiones	795,925,372	0
	851000403025	Devoluciones de impuestos a la utilidad	0	0
	851000403026	Pagos de impuestos a la utilidad	-2,652,799,602	-5,328,359,784
851000001001		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	3,948,121,619	518,893,889
		Actividades de inversión		
	851000202001	Pagos por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202002	Cobros por instrumentos financieros a largo plazo	0	0
	851000202003	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-448,565,057	-590,222,466
	851000202004	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	1,450,000	17,241,826
	851000202005	Pagos por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202006	Cobros por operaciones discontinuadas	0	0
	851000202007	Pagos por adquisición de subsidiarias	0	0
	851000202008	Cobros por disposición de subsidiarias	0	0
	851000202009	Pagos por adquisición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202010	Cobros por disposición de asociadas, negocios conjuntos y otras inversiones permanentes	0	0
	851000202011	Cobros de dividendos en efectivo de inversiones permanentes	254,211,032	166,903,920
	851000202012	Pagos por adquisición de activos intangibles	-712,806,304	-549,208,822
	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: **2024**

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

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

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2024 Y 2023

**CONSOLIDADO
Impresión Final**

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
	851000202016	Otros cobros por actividades de inversión	0	0
	851000202017	Otros pagos por actividades de inversión	0	0
	851000001002	Flujos netos de efectivo de actividades de inversión	-905,710,329	-955,285,542
		Actividades de financiamiento		
	851000302001	Cobros por la obtención de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302002	Pagos de préstamos interbancarios y de otros organismos	0	0
	851000302003	Pagos de pasivo por arrendamiento	-548,984,183	-461,264,176
	851000302004	Cobros por emisión de acciones	0	0
	851000302005	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	851000302006	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302007	Pagos asociados a instrumentos financieros que califican como capital	0	0
	851000302008	Pagos de dividendos en efectivo	-4,999,990,635	-2,849,994,662
	851000302009	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	851000302010	Cobros por la emisión de instrumentos financieros que califican como pasivo	0	0
	851000302011	Pagos asociados con instrumentos financieros que califican como pasivo	-1,938,369,059	-1,383,514,549
	851000302012	Pagos por intereses por pasivo por arrendamiento	0	0
	851000302013	Cobros asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302014	Pagos asociados con instrumentos financieros derivados de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de financiamiento)	0	0
	851000302015	Otros cobros por actividades de financiamiento	0	0
	851000302016	Otros pagos por actividades de financiamiento	0	0
851000001003		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	-7,487,343,877	-4,694,773,387
	851000000000	Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	-4,444,932,587	-5,131,165,040
	851200000000	Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo	0	0
	851400000000	Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo	47,661,140,882	63,880,972,463
	100200001001	Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	43,216,208,295	58,749,807,423

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

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

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

ESTADO DE CAMBIOS EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE
 CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2024 Y 2023

(PESOS)

CONSOLIDADO
 Impresión Final

Concepto	Capital contribuido				Capital Ganado									Participación en ORI de otras entidades	Total participación de la controladora	Participación no controladora	Total capital contable
	Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Instrumentos financieros que califican como capital	Reservas de capital	Resultados acumulados	Valuación de Instrumentos financieros para cobrar o vender	Valuación de Instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	Remedaciones por beneficios definidos a los empleados	Efecto Acumulado por conversión	Resultado por tenencia de activos no monetarios					
Saldo al inicio del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596	
Ajustes retrospectivos por cambios contables	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Ajustes retrospectivos por correcciones de errores	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Saldo ajustado	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	9,111,664,181	56,116,362,815	-101,013,858	702,398,188	0	-610,831,972	0	0	-1,478,554	78,685,436,361	1,416,235	78,686,852,596	
MOVIMIENTOS DE PROPIETARIOS																	
Aportaciones de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Reembolsos de capital	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Decreto de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Capitalización de otros conceptos del capital contable	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Cambios en la participación controladora que no implican pérdida de control	0	0	0	0	0	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0	
Total	0	0	0	0	0	230,966	0	0	0	0	0	0	0	230,966	-230,966	0	
MOVIMIENTOS DE RESERVAS																	
Reservas de capital	0	0	0	0	1,127,897,600	-1,127,897,599	0	0	0	0	0	0	0	1	0	1	
RESULTADO INTEGRAL																	
Resultado neto	0	0	0	0	0	7,917,274,223	0	0	0	0	0	0	0	7,917,274,223	130,875	7,917,405,098	
Otros resultados integrales	0	0	0	0	0	0	16,403,561	-245,759,312	0	21,261,001	0	0	0	-208,094,750	0	-208,094,750	
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	0	0	0	0	0	0	16,403,561	0	0	0	0	0	0	16,403,561	0	16,403,561	
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	0	0	0	0	0	0	0	-245,759,312	0	0	0	0	0	-245,759,312	0	-245,759,312	
Ingresos y gastos relacionados con activos mantenidos para su disposición	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Remedición de beneficios definidos a los empleados	0	0	0	0	0	0	0	0	0	21,261,001	0	0	0	21,261,001	0	21,261,001	
Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Participación en ORI de otras entidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	9,336,529	9,336,529	0	9,336,529	
Total	0	0	0	0	0	7,917,274,223	16,403,561	-245,759,312	0	21,261,001	0	0	9,336,529	7,718,516,002	130,875	7,718,646,877	
Saldo al final del periodo	10,670,965,802	0	2,797,369,759	0	10,239,561,781	62,905,970,405	-84,610,297	456,638,876	0	-589,570,971	0	0	7,857,975	86,404,183,330	1,316,144	86,405,499,474	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

ANEXO

Scotiabank Inverlat

INDICADORES FINANCIEROS

Scotiabank-Indicadores Financieros T3 2023T4 2023T1 2024T2 2024T3 2024

ROE

(Resultado neto del trimestre anualizado / Capital contable promedio)14.8%14.2%13.1%
11.5%13.9%

ROA

(Resultado neto del trimestre anualizado / Activo total promedio)1.5%1.4%1.3%1.1%1.3%

MIN

(Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos
productivos promedio)3.3%3.1%3.0%2.9%3.0%

Eficiencia Operativa

(Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total
promedio)2.1%2.2%2.0%2.1%2.0%

Índice de Morosidad

(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del
trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)4.0%3.3%3.4%3.6%
3.9%

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.)79.8%77.4%
76.9%76.8%72.4%

Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito22.60%21.47%22.01%22.44%22.61%1)

Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales

(crédito, mercado y operacional)17.07%15.99%16.64%17.08%17.75%1)

Liquidez

(Activos líquidos / Pasivos líquidos)49.0%47.2%44.4%46.9%46.8%

1). Sujeto a aprobación de Banco Central

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

La utilidad neta al cierre del tercer trimestre alcanza \$2,947 millones, un incremento de \$11 millones respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores ingresos totales; compensados parcialmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; así como mayores gastos de administración y promoción. Respecto al trimestre anterior la utilidad neta mostró un incremento de \$587 millones o 25%, debido principalmente a mayores ingresos totales y una gestión eficiente de los gastos de administración y promoción.

La utilidad neta acumulada al cierre de septiembre de 2024 se ubicó en \$7,917 millones, una disminución de \$534 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por mayores requerimientos de reservas crediticias; compensadas parcialmente por mayores ingresos totales y menores impuestos. En el periodo el PTPP creció 12%, impulsado por mayores ingresos en el margen financiero y comisiones y tarifas (netas).

3 meses 9 meses

Scotiabank-Información Financiera 30-sep

202330-jun

202430-sep

2024A/A

Δ% 30-sep

202330-sep

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Ingresos por intereses 19,984 21,043 21,130 6% 57,994 63,013 9%

Gastos por intereses (13,250) (14,079) (13,980) 6% (38,101) (42,124) 11%

Margen Financiero 6,734 6,964 7,150 6% 19,893 20,889 5%

Comisiones 1,044 1,301 1,405 35% 3,267 3,820 17%

Resultado por Intermediación 430 467 541 26% 1,553 1,764 14%

Otros ingresos/egresos de la operación 273 872 25-18% 763 524-31%

Ingresos no Financieros 1,747 1,855 2,171 24% 5,583 6,108 9%

Total Ingresos 8,481 8,819 9,321 10% 25,476 26,997 6%

Gastos de Administración y Promoción (4,096) (4,467) (4,348) 6% (12,810) (12,868) 0%

PTPP 1) .4,385 4,352 4,973 13% 12,666 14,129 12%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (574) (1,316) (1,203) >+100% (1,006) (3,553)

>+100%

Resultado de la Operación 3,811 3,036 3,770 -1% 11,660 10,576 -9%

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

Controladora -285 370% 168 1680%

Resultado antes de Impuestos a la Utilidad 3,811 3,213 3,807 0% 11,828 10,744 -9%

Impuestos a la Utilidad (875) (961) (860) -2% (3,377) (2,827) -16%

Resultado Neto 2,936 2,362 2,947 0% 8,451 7,917 -6%

Otros Resultados Integrales

Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender (489) (253) (253) -48% (407) 16 >-100%

Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo 831 361 361 -57% 624 (245) >-100%

Remediación de beneficios definidos a los empleados 204 4-80% 252 2-12%

Participación en ORI de otras entidades -99 0%-90%

Resultado Integral 3,298 2,481 3,068 -7% 8,693 7,719 -11%

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

MARGEN FINANCIERO

El margen financiero fue de \$7,150 millones al cierre del tercer trimestre de 2024, un incremento de \$416 millones o 6% respecto al mismo trimestre del año pasado, principalmente por mayores ingresos en la cartera hipotecaria y sin garantía; compensados parcialmente con mayores volúmenes en depósitos de exigibilidad inmediata. Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró un incremento de \$186 millones o 3%; principalmente por mayores volúmenes de cartera hipotecaria y automotriz; así como una mejora en la mezcla de depósitos.

El margen financiero acumulado al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$20,889 millones, un incremento de \$996 millones o 5% respecto al mismo periodo de 2023, debido principalmente a mayores ingresos en la cartera hipotecaria y un día más de operación; compensados parcialmente con mayores intereses pagados en depósitos de exigibilidad inmediata y de plazo.

INGRESOS NO FINANCIEROS

El total de ingresos no financieros fue de \$2,171 millones en el tercer trimestre de 2024, un incremento de \$424 millones o 24% respecto al mismo periodo del año pasado, debido a mayores ingresos por comisiones y tarifas netas en colocación de créditos, operaciones de crédito, cartas de crédito, avalúos y manejo de cuenta; así como mayores ingresos por intermediación principalmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros y mercado cambiario; compensada parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de \$316 millones o 17%, debido a mayores ingresos por comisiones y tarifas pagadas por colocación de créditos, menores egresos por quebrantos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación; así como mayores ingresos en resultados por intermediación principalmente por una utilidad en inversiones en instrumentos financieros; compensada parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

El total de ingresos no financieros acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$6,108 millones, un incremento de \$525 millones o 9% respecto al año pasado debido a mayores ingresos en comisiones y tarifas netas principalmente en operaciones de crédito, avalúos, manejo de cuenta, colocación de créditos y cartas de crédito; así como mayores ingresos por intermediación; compensados parcialmente por mayores aportaciones al IPAB y quebrantos (ambos en Otros Ingresos/Egresos de la Operación). Los mayores ingresos por intermediación se debieron a una utilidad en mercado cambiario e inversiones en instrumentos financieros; compensados parcialmente por una pérdida en instrumentos financieros derivados.

3 meses 9 meses

Scotiabank-Comisiones y Tarifas (netas) 30-sep

202330-jun

202430-sep

2024A/A

Δ%30-sep

202430-sep

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Aceptaciones por Cuenta de Terceros-110%220%

Actividades Fiduciarias535744-17%166158-5%

Apertura de Cuenta655-17%1714-18%

Cartas de Crédito346778>+100%17022633%

Cheques Certificados1-10%220%

Cheques de caja---0%1--100%

Compraventa de instrumentos financieros(1)12>-100%24100%

Manejo de Cuenta8310611134%24832330%

Operaciones de Crédito40351250926%1,1811,41620%

Otras Comisiones y Tarifas39537346919%1,2591,139-10%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Servicios de Banca Electrónica 45154158 > +100% 141461 > +100%
Transferencia de Fondos 2525278 % 7875 -4%
Total de Comisiones y Tarifas (netas) 1,0441,3011,40535 % 3,2673,82017%

3 meses 9 meses

Scotiabank-

Otros Ingresos/Egresos de la operación

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

202330-jun

202430-sep

2024A/A

Δ% 30-sep

202330-sep

2024A/A

Δ%

Afectaciones a la Estimación de Pérdidas Crediticias Esperadas 9 (5) (6) > -100% 213 -86%

Aportaciones al IPAB (551) (603) (591) 7% (1,626) (1,776) 9%

Cancelación de Otras Cuentas de Pasivo 861475 % 5226 -50%

Donativos - (1) (3) 0% - (4) 0%

Estimación por pérdida y resultado en venta de bienes adjudicados 18 (13) 13 -28% 548 -85%

Ingresos por Arrendamiento 1113129 % 333712%

Intereses a favor Provenientes de Préstamos a funcionarios y empleados 53596217 % 150177
18%

Otras Partidas de los Ingresos/Egresos de la Operación 782724725 -7% 2,632,200 -3%

Pérdida por venta de cartera de crédito - (2) (2) 0% - (4) 0%

Quebrantos (73) (159) (45) -38% (211) (309) 46%

Recuperaciones 33 - -100% 143 -79%

Resultado en venta de propiedades, mobiliario y equipo 13 -1 -92% 131 -92%

Utilidad por venta de cartera de crédito -2150 % -190%

Resultado por adjudicación de bienes -63300 % -1430%

Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación 27387225 -18% 763524 -31%

ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS

En el tercer trimestre de 2024, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios ascendió a \$1,203 millones, un incremento de \$629 millones respecto al mismo periodo del año pasado. El incremento se debe principalmente a mayores volúmenes en la cartera de vivienda, consumo y automotriz, así como los requerimientos de reservas asociados a cartera en etapa 3.

Respecto al trimestre pasado, la Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios muestra una disminución de \$113 millones o 9%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera comercial debido a la gestión de riesgo. La mayoría de las provisiones se concentraron en la cartera de consumo y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de septiembre 2024 ascendió a \$3,553 millones, un incremento de \$2,547 millones respecto al acumulado del año anterior. Este incremento fue impulsado por mayores volúmenes en cartera de tarjeta de crédito, automotriz y consumo, así como por la acumulación de cartera de vivienda en etapa 3.

3 meses 9 meses

Scotiabank - Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios

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

202330-jun

202430-sep

2024A/A

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Δ%30-sep

202330-sep

2024A/A

Δ%

Total de Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios(574) (1,316) (1,203)> +100%

(1,006) (3,553)> +100%

GASTOS DE ADMINISTRACIÓN Y PROMOCIÓN

Los Gastos de Administración y Promoción se ubicaron en \$4,348 millones en el tercer trimestre de 2024, un incremento de \$252 millones o 6% respecto al mismo periodo del año pasado, debido principalmente a mayores gastos por compensación variable.

Respecto al trimestre anterior los Gastos de Administración y Promoción, disminuyeron \$119 millones o 3%, debido principalmente a menores honorarios.

Los gastos de Administración y Promoción acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendieron a \$12,868 millones, un incremento anual de \$58 millones, debido principalmente a mayores gastos de promoción y publicidad, IVA, procesadores, operación de tarjetas de crédito y amortizaciones; compensados parcialmente por una menor compensación variable.

3 meses9 meses

Scotiabank -

Gastos de Administración y Promoción

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

202330-jun

202430-sep

2024A/A

Δ%30-sep

202330-sep

2024A/A

Δ%

Gastos de Personal(1,799) (2,097) (2,094)16%(6,167) (5,959)-3%

Gastos de Operación(2,297) (2,370) (2,254)-2%(6,643) (6,909)4%

Total de Gastos de Administración y Promoción(4,096) (4,467) (4,348)6%(12,810) (12,868)0%

IMPUESTOS A LA UTILIDAD

En el tercer trimestre de 2024, se registró un impuesto neto a cargo de \$860 millones, una disminución de \$15 millones respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por una disminución en los gastos no deducibles del trimestre.

Respecto al trimestre inmediato anterior el impuesto disminuyó \$101 millones u 11%, principalmente por una mayor inflación compensada por una mayor utilidad en el trimestre.

Los impuestos netos acumulados al cierre de septiembre 2024 ascendieron a \$2,827 millones, una disminución anual de \$550 millones o 16%, principalmente por una menor utilidad y una mayor inflación en el periodo.

3 meses9 meses

Scotiabank - Impuestos30-sep

202330-jun

202430-sep

2024A/A

Δ%30-sep

202330-sep

2024A/A

Δ%

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)

Impuesto a la Utilidad Causado(1,103) (1,654) (1,453)32%(3,044) (3,817)25%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Impuesto a la Utilidad Diferido 228693593 > +100% (333) 990 > -100%
Total de Impuestos a la Utilidad (875) (961) (860) -2% (3,377) (2,827) -16%

BALANCE GENERAL

Al 30 de septiembre de 2024, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$877,880 millones, un incremento de \$74,668 millones o 9% respecto al cierre de septiembre de 2023. El incremento anual se debió principalmente a mayores volúmenes en cartera de crédito total, deudores por liquidación de operaciones (en otros activos), inversiones en instrumentos financieros (principalmente gubernamental), inversiones en instrumentos financieros derivados y deudores por reporto; compensados parcialmente por menores volúmenes de efectivo y equivalentes de efectivo.

Los activos totales incrementaron \$8,139 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en cartera de crédito total e instrumentos financieros derivados, compensados parcialmente por menores deudores por reporto.

El total del pasivo registró \$791,475 millones al 30 de septiembre de 2024, un incremento de \$69,386 millones o 10% respecto al cierre de septiembre de 2023. Este incremento se debe a mayores volúmenes en depósitos y en otros pasivos (instrumentos financieros derivados, acreedores por liquidación de operaciones y valores asignados por liquidar).

El pasivo total incrementó \$5,401 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en otros pasivos (instrumentos financieros derivados y valores asignados por liquidar); compensados parcialmente por menores volúmenes en depósitos.

Scotiabank - Cifras relevantes del Balance General
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202330 jun

202430 sep

2024A/A

Δ%

Efectivo, Equivalentes de Efectivo, Inversiones en Instrumentos Financieros, Derivados y valores 275,547304,283299,7789%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2479,687500,968507,2116%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 19,79118,56220,3983%

Partidas diferidas 2,8993,4293,69427%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,793) (14,252) (14,762) -7%

Otros Activos 41,08156,75161,56150%

Total Activo 803,212869,741877,8809%

Depósitos 530,579568,429554,3214%

Préstamos Bancarios y de Otros Organismos 30,45135,27840,26932%

Obligaciones Subordinadas en Circulación 9,1029,0579,1040%

Otros Pasivos 151,957173,310187,78124%

Total Pasivo 722,089786,074791,47510%

Capital 81,12383,66786,4057%

Total Pasivo y Capital 803,212869,741877,8809%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 1 Y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 30 de septiembre de 2024 alcanzó \$274,578 millones, un incremento anual de \$35,078 millones o 15% y de \$8,021 o 3% millones respecto al trimestre anterior. El incremento anual y trimestral fue impulsado principalmente por mayores créditos a la vivienda.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 30 de septiembre de 2024 se ubicó en \$232,633 millones, una disminución anual de \$7,554

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

millones y \$1,778 millones respecto al trimestre anterior. La disminución anual y trimestral se debió principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial.

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

202330 jun

202430 sep

2024A/A

Δ%

Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales 34,42441,85844,57529%

Créditos a la Vivienda 205,076224,699230,00312%

Total Préstamos de Menudeo 239,500266,557274,57815%

Actividad Empresarial o Comercial 200,356196,584185,090-8%

Entidades Financieras 24,93117,69524,157-3%

Entidades Gubernamentales 14,90020,13223,38657%

Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales 240,187234,411232,633-3%

Total Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2 2479,687500,968507,2116%

CARTERA DE CRÉDITO CON RIESGO DE CRÉDITO ETAPA 3

Al 30 de septiembre de 2024 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó \$20,398 millones, un incremento anual y trimestral de \$607 millones o 3% y de \$1,836 millones o 10% respectivamente.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 30 de septiembre de 2024 se ubicó en \$14,762 millones, una disminución anual de \$1,031 millones o 7% y un incremento trimestral de \$510 millones o 4%.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 72.4% al 30 de septiembre de 2024, una disminución respecto al año pasado y al trimestre anterior de 743pb y 441pb, respectivamente.

El índice de morosidad al 30 de septiembre de 2024 fue de 3.9%, una disminución de 9pb respecto del año anterior y un incremento de 30pb respecto al trimestre pasado.

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

202330 jun

202430 sep

2024A/A

Δ%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 19,79118,56220,3983%

Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios (15,793) (14,252) (14,762) -7%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 Neta 3,9984,3105,63641%

Índice de morosidad 4.0% 3.6% 3.9% -9 pb

DEPÓSITOS

El total de depósitos registró \$554,321 millones al 30 de septiembre de 2024, un incremento anual de \$23,742 millones o 4%, debido a mayores volúmenes en depósitos de vista y ahorro y títulos de crédito emitidos; compensados parcialmente por un menor volumen en mercado de dinero.

Respecto al trimestre inmediato anterior los depósitos disminuyeron \$14,108 millones o 2%, debido a menores volúmenes de depósitos a plazo y de vista y ahorro; compensados parcialmente por mayores títulos de crédito emitidos

Scotiabank - Depósitos

(millones de pesos; consolidado con subsidiarias) 30 sep

202330 jun

202430 sep

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

2024A/A

Δ%

Total Depósitos Vista y Ahorro 269,967299,048290,7688%
Público en General 207,459222,127207,4710%
Mercado de Dinero 41,21725,28225,263-39%
Total Depósitos a Plazo 248,676247,409232,734-6%
Títulos de Crédito Emitidos 10,67720,58829,350>+100%
Cuenta global de captación sin movimientos 1,2591,3841,46917%
Total de Depósitos 530,579568,429554,3214%

OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN

Al 30 de septiembre de 2024, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en \$9,104 millones, sin cambios significativos respecto al cierre de septiembre 2023 y junio 2024.

Scotiabank-Inversiones en Instrumentos Financieros

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024 valor razonable)

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

Instrumentos financieros negociables 72,5402,35494974,952

Sin restricción: --94958

Restringidos: 72,5402,354--74,894

En operaciones de reporto 54,3232,354--56,677

Préstamos de valores -----

Otros 18,217---18,217

Instrumentos financieros para cobrar o vender 78,35820,963-1,445100,766

Sin restricción: 77,86820,963-1,445100,276

Restringidos: 490---490

En operaciones de reporto -----

En operaciones de préstamo de valores -----

Otros 490---490

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés 5,053---5,053

Sin restricción 5,053---5,053

Total 155,95123,31791,494180,771

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

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Emisor Títulos Tasa Plazo Importe

I_BANSAN_2440314,908,650,29510.9%214,900

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024 valor razonable)

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

Posición Posición Posición Posición Posición Posición

Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva Activa Pasiva

Negociación 9,2279,098--1,3631,03124546033,72133,693--44,55644,282

Cobertura -----15,32216,059--15,32216,059

Scotiabank-Montos nominales en operaciones derivadas

(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de septiembre de 2024)

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80
 CONSOLIDADO
 Impresión Final

Posición	Posición	Posición	Posición	Posición	Posición
Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Con fines de negociación					
Posición USD	7,0817,704				
Posición EUR	151186				
Posición CHF					
Posición GBP					
Posición CAD					
Divisas CAD					
Divisas USD	717155553				
Divisas EUR	11				
Divisas MXN	5050				
Acciones MXN	822822				
Acciones USD	335				
Índices MXN	1872,4444,1591,870				
Tasa de interés					
Pesos	28,68728,496600,980604,701				
Dólares	7767769,4689,513				
Euros	8				
Pesos Colombianos	177,500				
Con fines de cobertura					
Tasa de interés					
Pesos	82,744580				
Dólares	618967				
Euros					

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	128,42956,326	184,755	
Créditos a entidades financieras	22,9361,221	24,157	
Créditos a entidades gubernamentales	14,2269,160	23,386	
Créditos al consumo	43,406	43,406	
Créditos a la vivienda	225,827238	225,867	
Total	434,82466,709385	501,571	

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 2 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	335	335	
Créditos al consumo	1,169	1,169	
Créditos a la vivienda	4,130424	136	
Total	5,634425,640		

Scotiabank-Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3 (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	6,1741,664	7,838	
Créditos a entidades financieras	56	56	
Créditos al consumo	1,083	1,083	
Créditos a la vivienda	11,388285	11,421	
Total	18,7011,692520,398		

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

Saldo al 30 de junio de 2024	18,562
Reestructuras	158
Recuperaciones (409)	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Castigos y quitas(859)

Trasposos de y a cartera de Crédito con Riesgo de Crédito entre Etapa 1 2 y 32,826

Fluctuación Tipo Cambio120

Saldo al 30 de septiembre de 202420,398

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

Saldo al 30 de junio de 202414,252

Más: Creación de reservas29

Calificación1,280

Menos: Adjudicaciones y otros80

Castigos y quitas867

Comercial11

Hipotecario120

Consumo746

Desliz cambiario (148)

Saldo al 30 de septiembre de 202414,762

Scotiabank-Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito30 sep

202330 jun

202430 sep

2024

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 1 y 2

Metropolitano66.0%70.7%71.5%

Noroeste - Centro9.9%8.5%8.3%

Nortel2.3%10.5%10.4%

Bajío6.7%5.9%5.6%

Sur5.1%4.4%4.2%

Cartera de Crédito con Riesgo de Crédito Etapa 3

Metropolitano54.3%58.8%58.0%

Noroeste - Centro15.8%13.6%12.7%

Norte5.7%5.5%8.4%

Bajío12.2%12.6%12.2%

Sur12.0%9.5%8.7%

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

Grado de Riesgo

Importe Cartera CrediticiaReservas Preventivas Necesarias

Cartera ComercialConsumoCartera de ViviendaTotal Reservas Preventivas

No revolventesTarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes

Exceptuada calificada

Riesgo A1459,3079351334823391,889

Riesgo A255,8735234922517814

Riesgo B110,282109567116252

Riesgo B27,98841873847213

Riesgo B33,3254293940112

Riesgo C13,74520758356234

Riesgo C24,054647121270444

Riesgo D10,5021,203803711,5753,229

Riesgo E10,4963,8887163332,5157,452

Total565,5726,7291,2721,7634,87514,639

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

Exceso123

Reservas Constituidas 14,762

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 2024.

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

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida \$

-

-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)

48

-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3 3

-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores 72

Total \$ 123

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 2024 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros - Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

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

TítulosImporteVencimiento

B4 27070111,209,6861,96101-jul-27

BV 2707016-01-jul-27

Total11,209,6921,961

Scotiabank-ISR y PTU Diferido (millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)ISRPTU

Futuros castigos de crédito5,1921,067

Pagos anticipados(506)(104)

Comisiones cobradas por anticipado(388)(80)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo847165
Plan de pensiones1,116228
Provisiones y otros918134
Otros 41102
Efecto Neto en Diferido7,2201,512

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

VencimientoPréstamosFinanciamientoTotal

Banca

MúltipleBanco de

MéxicoBanca de DesarrolloFondos de FomentoOtros Organismos

Pesos

Inmediato-----

Mediano--4,2672,615-6,882

Largo--14,0834,132-18,215

Total--18,3506,747-25,097

Tasa Promedio0.00%0.00%12.51%10.53%0.00%

Otros

Inmediato-----

Mediano8,895-10362-9,267

Largo1,9902,954961-5,905

Total10,885-2,9641,323-15,172

Tasa Promedio5.45%0.00%6.16%5.81%0.00%

Total Préstamos Interbancarios10,885-21,3148,070-40,269

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 2024.

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

Captación Tradicional 30 sep

202330 jun

202430 sep

2024

Depósitos a la Vista52.2%54.8%55.7%

Metropolitano25.6%29.7%31.1%

Noroeste - Centro8.8%7.8%7.3%

Norte7.5%7.3%7.0%

Bajío4.8%4.8%5.2%

Sur5.5%5.2%5.1%

Depósitos Ventanilla39.9%40.6%39.5%

Metropolitano16.5%15.4%13.7%

Noroeste - Centro4.4%4.6%4.8%

Norte6.6%8.2%7.8%

Bajío6.3%7.3%7.3%

Sur6.1%5.1%5.9%

Total de Captación del Público92.1%95.4%95.2%

Fondeo Profesional7.9%4.6%4.8%

Scotiabank-Tasas Pagadas en Captación Tradicional

Tasa Promedio

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024) PesosDólares

Depósitos a la vista (incluye ahorro)6.35%2.73%

Depósitos a plazo10.05%0.00%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 13 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

Scotiabank-Resultados por Intermediación
(millones de pesos)30 sep
2024

Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable(2,793)
Resultado por valuación de divisas2,930
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros
derivados303
Resultado por compraventa de divisas1,378
Costos de transacción(51)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos
financieros(3)
Total1,764

EMISIÓN DE CERTIFICADOS BURSÁTILES

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

Cuarta***Primera**Segunda**Tercera**Cuarta**Quinta

Clave de PizarraSCOTIAB 23SCOTIAB 24SCOTIAB 24-2SCOTIAB 24VSCOTIAB 24DSCOTIAB 24-3

Monto de la Emisión\$7,125 millones\$5,189 millones\$4,811 millones\$4,325 millones "\$24
millones usd / \$472 millones MXN\$3,970 millones

Fecha de Emisión y Colocación18 agosto

202326 febrero

202426 febrero

202413 sep

2024 13 sep

202413 sep

2024

Plazo de Vigencia de la Emisión927 días, aprox.

2.5 años1,095 días, aprox.

3 años 2,548 días, aprox.

7 años1,095 días, aprox.

3 años1,092 días, aprox.

3 años2,548 días, aprox.

7 años

GarantíaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografariaQuirografaria

Tasa de interésTIIE28+0.04TIIE Fondeo+0.32%9.24%TIIE Fondeo+0.32%3.46+0.84%9.89%

Pago de InteresesCada 28 días durante la vigencia de la emisiónCada 28 días durante la
vigencia de la emisiónCada 182 días durante la vigencia de la emisiónCada 28 días
durante la vigencia de la emisiónCada 182 días durante la vigencia de la emisiónCada
182 días durante la vigencia de la emisión

Calificaciones otorgadas Fitch/S&PAAA(mex) /"mxAAA"AAA(mex) /"mxAAA"AAA(mex) /"mxAAA"
AAA(mex) /"mxAAA"AAA(mex) /"mxAAA"AAA(mex) /"mxAAA"

Amortización del principalUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimientoUn sólo
pago al vencimientoUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago al vencimientoUn sólo pago
al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en diciembre de 2018.

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

EMISIÓN DE OBLIGACIONES SUBORDINADAS

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Fecha InicioFecha VencimientoISINPlazo Importe (\$)Tasa (%)

18-diciembre-1405-diciembre-24MX0QSC1N00163,6402,093,000,0007.4

28-junio-1809-junio-33MX0QSC1N00245,4603,360,000,00012.3

11-septiembre-18PerpetuaMX0QSC1N0032-3,455,000,00011.3

Total de Obligaciones Subordinadas8,908,000,000

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto MXN
99_SCOTIAB_9	213,753,200	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	375,320,000
99_SCOTIAB_10	213,719,250	25-nov-21	22-nov-24	1093	Index (BNPIUIL5)	371,925,000
99_SCOTIAB_1	22533,200	28-feb-22	25-feb-25	251093	MSFDVTHY Index	53,320,000
99_SCOTIAB_5	221,238,860	15-jun-22	13-jun-25	251094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	123,886,000
99_SCOTIAB_6	221,795,500	15-jun-22	13-jun-25	251094	MSCI USA IMI (ENHAAGE5)	179,550,000
99_SCOTIAB_7	22793,540	16-jun-22	13-jun-25	251093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	79,354,000
99_SCOTIAB_8	221,027,150	16-jun-22	13-jun-25	251093	MSCI USA IMI (ENHAFOO5)	102,715,000
99_SCOTIAB_11	225,528,250	17-nov-22	14-nov-25	251093	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	552,825,000
99_SCOTIAB_12	22457,550	18-nov-22	14-nov-25	251092	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	45,755,000
99_SCOTIAB_13	22104,500	23-nov-22	21-nov-25	251094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	10,450,000
99_SCOTIAB_14	22753,800	19-dic-22	17-dic-25	251094	US Innovative Leaders 5 Index (BNPIUIL5)	75,380,000
99_SCOTIAB_2	235,542,850	27-jul-23	27-ene-25	550	Dólar - Peso (USDMXN)	554,285,000
99_SCOTIAB_3	23353,600	31-ago-23	28-feb-25	547	Dólar - Peso (USDMXN)	35,360,000
83_SCOTIAB_4	23146,267	21-nov-23	15-nov-24	360	S&P 500 Index (SPX)	14,626,700
99_SCOTIAB_5	232,529,850	08-dic-23	07-dic-26	261095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	252,985,000
99_SCOTIAB_6	231,576,600	08-dic-23	07-dic-26	261095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	157,660,000
99_SCOTIAB_7	23481,400	15-dic-23	14-dic-26	261095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
83_SCOTIAB_1	241,661,850	27-mar-24	05-nov-24	223	Dólar - Peso (USDMXN)	166,185,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2024						

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto USD
99_SCOTIAB_2	24D 25,000	19-jul-24	14-jul-27	1090	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	2,500,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2024						

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

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

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

- Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.
- Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).

c)Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).

d)Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.

e)Microcréditos individuales o grupales.

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

1).Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento",

2).Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,

3).Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes.

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

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

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

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

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

Aplicación del programa OTIS

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

a)CrediAuto

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

b)Hipotecario

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

c)Préstamo personal y préstamo de nómina

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

d)ScotiaLine

El apoyo consistió en no requerir el pago mínimo de la línea de crédito revolvente del

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

e) Tarjetas de crédito

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

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

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

30 sep 2024

Saldo con CCE OTI Efectos en Cartera y Estimación Saldo sin CCE OTI

Cartera comercial \$232,298-232,298
Créditos de consumo 43,406 643,412
Créditos a la vivienda: 225,867 392 25,906

Etapas 1 \$501,571 455 01,616

Cartera comercial 335-335
Créditos de consumo 1,169 11,170
Créditos a la vivienda: 4,136 64,142

Etapas 2 \$5,640 75,647

Cartera comercial 7,894-7,894
Créditos de consumo 1,083 (7) 1,076
Créditos a la vivienda: 11,421 (45) 11,376

Etapas 3 \$20,398 (52) 20,346

Cartera de crédito \$527,609-527,609
(+/-) Partidas diferidas \$3,694-3,694
(-) Estimación preventiva para riesgos crediticios \$(14,762) (7) (14,769)

Total cartera de crédito, neta \$516,541 (7) 516,534

Total activos \$877,880 (7) 877,873

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Estimación preventiva para riesgos crediticios (Resultados) \$(3,553) (7) (3,560)

Resultado neto \$7,917 (7) 7,910

Total capital contable \$86,405 (7) 86,398

Total pasivo y capital contable \$877,880 (7) 877,873

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 2024)

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

1 Acciones ordinarias que califican para capital común de nivel 1 más su prima correspondiente 13,468

2 Resultados de ejercicios anteriores 54,989

3 Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas) 17,939

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 86,396

Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios

7 Ajustes por valuación prudencial No aplica

8 Crédito mercantil

(neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -

9 Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo) -

10 conservador Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo) 1,944

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%) -

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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)1,533
22Monto que excede el umbral del 15%No aplica
23 del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en
acciones comunes de instituciones financierasNo aplica
24 del cual: Derechos de servicios hipotecariosNo aplica
25 del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias
temporalesNo aplica
26Ajustes regulatorios nacionales7,634
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 anticipados6,792
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 compensación842
27Ajustes regulatorios que se aplican al capital común de nivel 1 debido a
insuficiencia de capital adicional de nivel 1 y al capital de nivel 2 para cubrir
deduciones-
28Ajustes regulatorios totales al capital común de nivel 111,111
29Capital común de nivel 1 (CET1)75,285
Capital adicional de nivel 1: instrumentos
30Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1,
más su prima3,484
31 de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables
3,484
32 de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicablesNo
aplica
33Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del
capital adicional de nivel 1-
34Instrumentos emitidos de capital adicional de nivel 1 e instrumentos de capital común
de nivel 1 que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en
tenencia de terceros (monto permitido en el nivel adicional 1)No aplica
35 del cual: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradualNo
aplica
36Capital adicional de nivel 1 antes de ajustes regulatorios3,484
Capital adicional de nivel 1: ajustes regulatorios
37
conservadorInversiones en instrumentos propios de capital adicional de nivel 1No aplica
38
conservadorInversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital adicional de
nivel 1No aplica
39
conservadorInversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**SCOTIABANK INVERLAT, S.A.,
INSTITUCIÓN DE BANCA MÚLTIPLE,
GRUPO FINANCIERO SCOTIABANK
INVERLAT**

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

PAGINA 19 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 emitidoNo aplica

41Ajustes regulatorios nacionales-
42Ajustes regulatorios aplicados al capital adicional de nivel 1 debido a la insuficiencia del capital de nivel 2 para cubrir deduccionesNo aplica

43Ajustes regulatorios totales al capital adicional de nivel 1-

44Capital adicional de nivel 1 (AT1)3,484

45Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)78,770

Capital de nivel 2: instrumentos y reservas

46Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima3,477

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

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

49 de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradualNo aplica

50 conservadorReservas72

51Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios3,549

Capital de nivel 2: ajustes regulatorios

52 conservadorInversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2No aplica

53 conservadorInversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2No aplica

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

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

56Ajustes regulatorios nacionales-
57Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2-

58Capital de nivel 2 (T2)3,549

59Capital total (TC = T1 + T2)82,319

60Activos ponderados por riesgo totales463,647

Razones de capital y suplementos

61Capital Común de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.24%

62Capital de Nivel 1
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)16.99%

63Capital Total
(como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)17.75%

64Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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)19.34%

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)9.24%

Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea 3)

69Razón mínima nacional de CET1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)No aplica

70Razón mínima nacional de T1
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)No aplica

71Razón mínima nacional de TC
(si difiere del mínimo establecido por Basilea 3)No aplica

Cantidades por debajo de los umbrales para deducción (antes de la ponderación por riesgo)

72Inversiones no significativas en el capital de otras instituciones financierasNo aplica

73Inversiones significativas en acciones comunes de instituciones financierasNo aplica

74Derechos por servicios hipotecarios (neto de los impuestos a la utilidad diferidos a cargo)No aplica

75Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales (netos de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)-

Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital de nivel 2

76Reservas elegibles para su inclusión en el capital de nivel 2 con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite) 72

77Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada4,228

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

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

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

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

81Monto excluido del CET1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)No aplica

82Límite actual de los instrumentos AT1 sujetos a eliminación gradual-

83Monto excluido del AT1 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)-

84Límite actual de los instrumentos T2 sujetos a eliminación gradual-

85Monto excluido del T2 debido al límite (exceso sobre el límite después de amortizaciones y vencimientos)-

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

ReferenciaDescripción

1Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

2Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.

3Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de títulos disponibles para la venta, efecto

acumulado por conversión, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo, resultado por tenencia de activos no monetarios, y el saldo de remediones por beneficios definidos

a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.

4No aplica. El capital social de las instituciones de crédito en México está representado por títulos

representativos o acciones. Este concepto solo aplica para entidades donde dicho capital no esté

representado por títulos representativos o acciones.

5No aplica para el ámbito de capitalización en México que es sobre una base no consolidada. Este

concepto solo aplicaría para entidades donde el ámbito de aplicación es consolidado.

6Suma de los conceptos 1 a 5.

7No aplica. En México no se permite el uso de modelos internos para el cálculo del requerimiento de capital por riesgo de mercado.

8Crédito mercantil, neto de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

9Intangibles, diferentes al crédito mercantil, y en su caso a los derechos por servicios hipotecario, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

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

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

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

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

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

14No aplica.

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

16*El monto de la inversión en cualquier acción propia que:

la Institución adquiera: de conformidad con lo previsto en la Ley de acuerdo con lo

establecido en la fracción I inciso d) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones; a través de los índices de valores previstos por la fracción I inciso e) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, y a través de las sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

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

17*Inversiones, en capital de sociedades, distintas a las entidades financieras a que se refiere el inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a sociedades de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.

18*Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

19*Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de las sociedades de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

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

20*Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado

en caso de existir estos derechos.

Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.

21El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.

22No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.

23No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.

24No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.

25No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.

26Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.

A. La suma del efecto acumulado por conversión y el resultado por tenencia de activos no monetarios considerando el monto de cada uno de estos conceptos con signo contrario al que se consideró para incluirlos en la referencia 3, es decir si son positivos en este concepto entrarán como negativos y viceversa.

B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

C. El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.

E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.

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

I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.

O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.

27No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

28Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.

29Renglón 6 menos el renglón 28.

30El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.

31Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.

32No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.

33Obligaciones subordinadas computables como Capital Básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).

34No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

35No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

36Suma de los renglones 30, 33 y 34.

37 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

38 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

39 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

40 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

41Ajustes nacionales considerados:

Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

42No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.

43Suma de los renglones 37 a 42.

44Renglón 36, menos el renglón 43.

45Renglón 29, más el renglón 44.

46El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

(incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el Capital Fundamental ni en el Capital Básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.

47Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

48No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

49No aplica. Ver la nota de la referencia 5.

50Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.

51Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.

52 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

53 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

54 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

55 conservadorNo aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.

56Ajustes nacionales considerados:

Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.

57Suma de los renglones 52 a 56.

58Renglón 51, menos renglón 57.

59Renglón 45, más renglón 58.

60Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.

61Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

62Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

63Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).

64Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61, 65, 66 y 67.

65Reportar 2.5%

66Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción

III, del Artículo 2 Bis 5.

67La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.

68Renglón 61 menos 7%.

69No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

70No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

71No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

- 72No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
- 73No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
- 74No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
- 75El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
- 76Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
- 771.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
- 78Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
- 790.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
- 80No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
- 81No aplica. No existen instrumentos sujetos a transitoriedad que computen en el capital común de nivel 1.
- 82Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
- 83Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte básica al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 33.
- 84Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 por el correspondiente límite del saldo de dichos instrumentos.
- 85Saldo de los instrumentos que computaban como capital en la parte complementaria al 31 de diciembre de 2012 menos el renglón 47.

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Balance General

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Referencias de los rubros del balance generalRubros del Balance GeneralMonto presentado en el balance general

Activo

- BG1Efectivo y equivalentes de efectivo42,491
- BG2Cuentas de Margen2,104
- BG3Inversiones en instrumentos financieros180,771
- BG4Deudores por reporto14,052
- BG5Préstamo de valores-
- BG6Instrumentos financieros derivados59,878
- BG7Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros(277)
- BG8Total de cartera de crédito (neto)516,541
- BG9Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización-
- BG10Otras cuentas por cobrar (neto)38,545
- BG11Bienes adjudicados (neto)831
- BG12Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)2,628
- BG13Inversiones permanentes4,918
- BG14Activos de larga duración mantenidos para la venta13
- BG15Impuestos a la utilidad diferidos (neto)7,160

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

BG16Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)1,981
Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)1,504
Activos Intangibles (neto)4,674
Pasivo
BG17Captación tradicional554,455
BG18Préstamos interbancarios y de otros organismos40,269
Valores Asignados por liquidar21,099
BG19Acreedores por reporto56,687
BG20Préstamo de valores-
BG21Colaterales vendidos o dados en garantía-
BG22Instrumentos financieros derivados60,341
BG23Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros-
BG24Obligaciones en operaciones de bursatilización-
BG25Otras cuentas por pagar38,215
BG26Obligaciones subordinadas en circulación-
BG27Pasivo por Impuestos a la Utilidad1,192
BG28Créditos diferidos y cobros anticipados1,246
Pasivos por arrendamiento1,684
Instrumentos Financieros que califican como pasivo9,104
Pasivos por Beneficio a los Empleados7,118
Capital contable
BG29Capital contribuido13,468
BG30Capital ganado72,936
Cuentas de orden
BG31Avales otorgados-
BG32Activos y pasivos contingentes-
BG33Compromisos crediticios327,895
BG34Bienes en fideicomisos o mandato498,324
BG35Agente financiero del gobierno federal-
BG36Bienes en custodia o en administración82,429
BG37Colaterales recibidos por la entidad20,017
BG38Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad-
BG39Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)-
BG40Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de
crédito etapa 31,985
BG41Otras cuentas de registro2,777,580

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 2024)

IdentificadorConceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del
Capital NetoReferencia del formato de revelación de la integración de capital del
apartado I del presente anexoMonto de conformidad con las notas a la tabla Conceptos
regulatorios considerados para el cálculo de los componentes de Capital Neto
Referencia(s) de rubro del balance general y monto relacionado con el concepto
regulatorio considerado para el cálculo de Capital Neto proveniente de la referencia
mencionada

ACTIVO

1Crédito mercantil8-

2Otros Intangibles9-

3Impuesto a la utilidad diferida (a favor) proveniente de pérdidas y créditos fiscales
101,944BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) \$1,944

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-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

1,533BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) \$1533

13Reservas reconocidas como capital complementario5072BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$72

14Inversiones en deuda subordinada26-B-

15Inversiones en organismos multilaterales26-D-

16Inversiones en empresas relacionadas26-E-

17Inversiones en capital de riesgo26-F-

18Inversiones en sociedades de inversión26-G-

19Financiamiento para la adquisición de acciones propias26-H-

20Cargos diferidos y pagos anticipados26-J6,792BG 16 Activos Intangibles \$3,865 más Gastos de Instalación \$2,927

21Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)26-L-

22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos26-N-

23Inversiones en cámara de compensación26-P842BG 13 Inversiones Permanentes \$ 842

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-R313,484BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,484

30Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental133-

31Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S463,477BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,477

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-Q113,468BG 29 Capital Social \$10,671 más Prima en Venta de Acciones \$2,797

35Resultado de ejercicios anteriores254,989BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$54,989

36Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable3457BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$457

37Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores317,483BG 30 Reservas de Capital \$10,240 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$85) más Remediación por beneficios definidos a los empleados (\$590) más Resultado Neto \$7,917

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

partidas no registradas a valor razonable3, 11-
41Efecto acumulado por conversión3, 26-A-
42Resultado por tenencia de activos no monetarios3, 26-A-
CUENTAS DE ORDEN
43Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas26 - K-
CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL
44Reservas pendientes de constituir12-
45Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de
bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)26-C-
46Operaciones que contravengan las disposiciones26-I-
47Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes26-M-
48Derogado

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

IdentificadorDescripción

1Crédito mercantil.

2Intangibles, sin incluir al crédito mercantil.

3Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de pérdidas y créditos
fiscales.

4Beneficios sobre el remanente en operaciones de bursatilización.

5Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos sin acceso irrestricto e
ilimitado.

6Cualquier acción propia que la Institución adquiera de conformidad con lo previsto en
la Ley, que no hayan sido restadas; considerando aquellos montos adquiridos a través de
las inversiones en índices de valores y el monto correspondiente a las inversiones en
sociedades de inversión distintas a las previstas por la referencia 18

7Inversiones en acciones de sociedades distintas a las entidades financieras a que se
refiere el inciso f) de la fracción I del Artículo 2 Bis 6 de las presentes
disposiciones, que sean a su vez, directa o indirectamente accionistas de la propia
Institución, de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades
financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales
financieras de éstas, considerando aquellas inversiones correspondientes a sociedades
de inversión distintas a las previstas por la referencia 18.

8Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los
Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras,
donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

9Inversiones directas en el capital de las entidades financieras a que se refieren los
Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras,
donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

10Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren
los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones
Financieras, donde la Institución posea hasta el 10% del capital de dichas entidades.

11Inversiones indirectas en el capital de las entidades financieras a que se refieren
los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 de la Ley para Regular las Agrupaciones
Financieras, donde la Institución posea más del 10% del capital de dichas entidades.

12Impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales.

13Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los
activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que
se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de
crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas
Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos
ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se
utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de
capital por riesgo de crédito.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- 14Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 15Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
- 16Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 17Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 18Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
- 19Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de estas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 20Cargos diferidos y pagos anticipados.
- 21La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
- 22Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos que tengan ser deducidas de acuerdo con el Artículo 2 Bis 8 de las presentes disposiciones.
- 23Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
- 24Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al crédito mercantil.
- 25Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a otros intangibles (distintos al crédito mercantil).
- 26Pasivos del plan de pensiones por beneficios definidos asociados a inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos.
- 27Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.
- 28Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 27 y 33.
- 29Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
- 30Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital Básico No Fundamental.
- 31Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
- 32Monto de obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario.
- 33Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.
- 34Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

presentes disposiciones.

35Resultado de ejercicios anteriores.

36Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.

37Resultado neto y resultado por valuación de títulos disponibles para la venta.

38Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.

39Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.

40Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.

41Efecto acumulado por conversión.

42Resultado por tenencia de activos no monetarios.

43Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.

44Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

45El monto que resulte si con motivo de la adquisición de posiciones de bursatilización, las Instituciones originadoras registran una utilidad o un incremento en el valor de sus activos respecto de los activos anteriormente registrados en su balance, conforme a lo establecido en la fracción I inciso c) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

46Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

47El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

48Derogado

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgoImporte de posiciones equivalentesRequerimiento de capital

Operaciones en moneda nacional con tasa nominal38,0083,041

Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable 1,424114

Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA's3,277262

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 INPC534

Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General--

Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal7,729618

Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio2,034163

Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones242

Posiciones en Mercancía--

Requerimiento de capital por impacto Gamma45837

Requerimiento de capital por impacto Vega242

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%)343

Grupo I-B (ponderados al 4%)--

Grupo II (ponderados al 0%)--

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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%)90773
Grupo III (ponderados al 11.5%)--
Grupo III (ponderados al 20%)4,425354
Grupo III (ponderados al 25%)433
Grupo III (ponderados al 50%)1,702136
Grupo III (ponderados al 57.5%)20016
Grupo III (ponderados al 100%)66653
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%)5,022402
Grupo V (ponderados al 10%)--
Grupo V (ponderados al 20%)23619
Grupo V (ponderados al 50%)413
Grupo V (ponderados al 115%)--
Grupo V (ponderados al 150%)45636
Grupo VI (ponderados al 20%)5,425434
Grupo VI (ponderados al 25%)3,733299
Grupo VI (ponderados al 30%)14,0151,121
Grupo VI (ponderados al 40%)13,5581,085
Grupo VI (ponderados al 50%)39,2683,141
Grupo VI (ponderados al 70%)363
Grupo VI (ponderados al 75%)35,1562,813
Grupo VI (ponderados al 85%)11,014881
Grupo VI (ponderados al 100%)30,5202,442
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%)14512
Grupo VII_A (ponderados al 20%)19,5611,565
Grupo VII_A (ponderados al 23%)83867
Grupo VII_A (ponderados al 25%)--
Grupo VII_A (ponderados al 50%)6,230498
Grupo VII_A (ponderados al 60%)--
Grupo VII_A (ponderados al 100%)130,91810,473
Grupo VII_A (ponderados al 115%)--
Grupo VII_A (ponderados al 120%)70256
Grupo VII_A (ponderados al 138%)--
Grupo VII_A (ponderados al 150%)675
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)--
Grupo VII_B (ponderados al 0%)--
Grupo VII_B (ponderados al 20%)--
Grupo VII_B (ponderados al 23%)--
Grupo VII_B (ponderados al 50%)--
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)--

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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%)10,058805
Grupo VIII (ponderados al 150%)2,887231
Grupo IX (ponderados al 100%)22,1201,770
Grupo IX (ponderados al 115%)--
Grupo X (ponderados al 1250%)--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)--
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)--
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)--
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)--
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)--
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)--
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)--
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas3,966317
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación181
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega15012

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleadoActivos ponderados por riesgoRequerimiento de capital

Indicador de Negocio 46,5003,720

CATEGORÍA CAPITALIZACIÓN

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 17.75% al cierre de septiembre 2024, 306pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (14.69% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).

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

ReferenciaCaracterísticasOpciones

1EmisorScotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat

2Identificador ISIN, CUSIP o BloombergN.A.

3Marco legalLey de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.

Tratamiento regulatorio

4Nivel de capital con transitoriedadN.A.

5Nivel de capital sin transitoriedadFundamental

6Nivel del instrumentoInstitución de crédito sin consolidar subsidiarias

7Tipo de InstrumentoAcción series "F" y "B"

8Monto reconocido en el capital regulatorio13,468,335,561

9Valor nominal del instrumentoUn Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales

9A Moneda del instrumentoPesos mexicanos

10Clasificación contableCapital

11Fecha de emisión13-ene-01

12Plazo del instrumentoPerpetuidad

13Fecha de vencimientoSin vencimiento

14Cláusula de pago anticipadoNo

15Primera fecha de pago anticipadoN.A.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

ReferenciaDescripción

- 1Institución de crédito que emite el título que forma parte del Capital Neto.
2Identificador o clave del título que forma parte del Capital Neto, (ISIN, CUSIP o número identificador de valor internacional).
3Marco legal con el que el título deberá de cumplir, así como las leyes sobre a las cuales se sujetará.
4Nivel de capital al que corresponde el título que está sujeto a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
5Nivel de capital al que corresponde el título que cumple con el anexo 1-Q, 1-R, o 1-S de las presentes disposiciones.
6Nivel dentro del grupo al cual se incluye el título.
7Tipo de Instrumento de Capital o título representativo del capital social que se incluye como parte del Capital Neto. En caso de los títulos sujetos a la transitoriedad establecida de conformidad con el Artículo Tercero Transitorio, establecido en la Resolución 50a, se refiere a las obligaciones subordinadas descritas en el Artículo 64 de la Ley de Instituciones de Crédito.
8Monto del Instrumento de Capital o título representativo del capital social, que se
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

reconoce en el Capital Neto conforme al Artículo 2 bis 6 de las presentes disposiciones, en caso de que la referencia 5 sea Fundamental o Básico no Fundamental; y conforme al Artículo 2 bis 7 de las presentes disposiciones en caso de que dicha referencia sea Complementario. En cualquier otro caso, será el monto que corresponda de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.

9Valor nominal del título en pesos mexicanos.

9AMoneda utilizada para expresar el valor nominal del título en pesos mexicanos conforme al estándar internacional ISO 4217

10Clasificación contable del título que forma parte del Capital Neto.

11Fecha de emisión del título que forma parte del Capital Neto.

12Especificar si el título tiene vencimiento o es a perpetuidad.

13Fecha de vencimiento del título, sin considerar las fechas de pago anticipado.

14Especificar si el título incluye una cláusula de pago anticipado por el emisor donde se ejerza el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15Fecha en la que el emisor puede, por primera vez, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

15AEspecificar si la cláusula de pago anticipado considera eventos regulatorios o fiscales.

15BEspecificar el precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado.

16Fechas en la que el emisor puede, posterior a la especificada en la referencia 15, ejercer el derecho de pagar el título anticipadamente con previa autorización del Banco de México.

17Especificar el tipo de rendimiento/dividendo que se mantendrá durante todo el plazo del título.

18Tasa de interés o índice al que hace referencia el rendimiento/dividendo del título

19Especificar si el título incluye cláusulas que prohíban el pago de dividendos a los poseedores de títulos representativos del capital social cuando se incumple con el pago de un cupón o dividendo en algún instrumento de capital.

20Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).

21Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".

22Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.

23Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

24Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.

25Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.

26Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.

27Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.

28Tipo de acciones en las que se convierte el título.

29Emisor del instrumento en el que se convierte el título.

30Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.

31Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.

32Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.

33Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.

34Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

35 Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto

(millones de pesos al 30 de septiembre de 2024)

Ref. RUBRO Sep-241)

T Jun-24

T-1 Mar-24

T-2 Dic-23

T-3 Sep-23

T-4

1 Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones 16,63916,76915,79216,2807,799

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 463,647470,684464,864471,664461,662

3 Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%) 3.25% 3.25% 3.25% 3.25% 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 887,401894,365842,238868,289831,882

5 "Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%) 1.88% 1.88% 1.88% 1.88% 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 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 No

6c En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos? 0% 0% 0% 0% 0%

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 37 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

(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 2024 fue de \$20.93 millones y su promedio durante el tercer trimestre de 2024 fue de \$18.54 millones mismo que corresponde a un 0.022% del capital neto (\$85,851 millones a agosto 2024, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2024 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos) Cierre

Septiembre 2024 Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés

Derivados 1,739,5831,500,224

Mercado de Dinero 51,70054,153

Tipo de cambio

Cash 4,4294,003

Derivados 323,278315,485

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 39 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Capitales
Cash95
Derivados7,8747,902

VaR 1 día (millones de pesos)Cierre

Septiembre 2024Promedio

Factor de Riesgo

Tasas de interés19.2618.34

Tipo de cambio4.831.85

Capitales--

VaR Global20.9318.54

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 2024 muestra una pérdida máxima de \$389.89 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 2024, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

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

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US60,45458,042

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 134,348130,471

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 2024 de 167.01% y 115.48% 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 ± 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 2024 y en promedio para el tercer trimestre de 2024 es la siguiente:

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Valor Económico (+100 pbs) (2,031) (2,510)

Sensibilidad de Margen (-100 pbs) (203) (100)

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

Scotiabank

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Instrumentos financieros para cobrar o vender 1) .94,17293,678

Derivados de Cobertura 111,69399,896

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 2024 y el promedio del tercer trimestre del 2024 fueron \$5,608 millones y \$4,501 millones, respectivamente.

RIESGO DE CRÉDITO

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

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

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

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

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

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

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

Metodología para determinar las estimaciones preventivas para riesgos crediticios El Banco cuenta con un sistema de clasificación de riesgos crediticios aprobado a nivel institucional para cartera Comercial y modelos de score y/o métricas de seguimiento de desempeño para la cartera de Menudeo. También se cuenta con procesos y sistemas que permiten clasificar la cartera por nivel de riesgo y realizar el proceso de cálculo de reservas de todas las carteras de crédito, conforme a los modelos regulatorios establecidos por CNBV en la CUB.

Se utilizan las Agencias Calificadoras aprobadas por CNBV conforme se describe en Anexo 1-B de la CUB.

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 \$12 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 2024, el Banco mantiene \$67 millones como remanente de reservas adicionales sin asignación específica a un portafolio.

INFORMACIÓN METODOLÓGICA

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

- La pérdida esperada representa el monto que el Banco espera perder durante los próximos doce meses por concepto de incumplimientos dadas las características de sus carteras. Es igual al resultado de multiplicar la exposición al incumplimiento (EI), la probabilidad de incumplimiento (PI) y la severidad de la pérdida (SP) de las exposiciones crediticias.

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

Métricas Riesgo de Crédito1).

(Cifras al 30 de septiembre 2024) Pérdida

Esperada Pérdida no Esperada

Hipotecas 0.28% 2.91%

Consumo 3.70% 15.59%

Cartera Comercial 0.59% 4.21%

Total 0.72% 4.59%

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

Parámetros de Riesgo1).

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

Hipotecas 230,0031.60% 16.79%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 44 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Consumo 62,9144.70% 72.25%

Cartera Comercial 275,7721.40% 43.50%

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 el proceso de constitución de garantías; previo a su aceptación, se valora la capacidad de absorción de riesgo y 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 2024.

POLÍTICAS PARA ASEGURAR LAS GARANTÍAS REALES Y ESTABLECER RESERVAS DE CRÉDITO

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

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

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

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

RIESGO DE CRÉDITO EN INSTRUMENTOS FINANCIEROS

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

Al cierre de septiembre 2024 y en promedio durante el tercer trimestre de 2024, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.03% y 0.03% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.31% y 0.29% 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 46 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

para cada uno de los indicadores seleccionados.

RIESGO LEGAL

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

CÁLCULO DEL REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO OPERACIONAL

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

VALOR PROMEDIO DE LA EXPOSICIÓN

Durante el periodo de julio-septiembre 2024, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$85.2 millones, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2024 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$38.0 millones, donde \$3.1 millones corresponden al Riesgo Operacional y \$34.9 millones al Riesgo Legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

RIESGO TECNOLÓGICO

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

Para gestionar el Riesgo Tecnológico, el Banco cuenta con el Marco de Gestión del Riesgo Tecnológico y de Ciberseguridad que define las funciones, responsabilidades y obligaciones de las partes interesadas, así como, la supervisión de los organismos y las herramientas, prácticas y entregables requeridos para gestionar y vigilar los riesgos asociados con las Tecnologías de la Información y la Ciberseguridad. Las auditorías habituales realizadas por un departamento independiente y experimentado de Auditoría Interna de Tecnologías de la Información incluyen revisiones totales del diseño, implementación y explotación de los sistemas de control interno en todas las áreas de negocio y apoyo, nuevos productos y sistemas y la confiabilidad e integridad de las operaciones de procesamiento de datos.

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)

Periodo Reportado: julio 2024 - septiembre 2024 (T3 2024)

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez

	Calculo Individual T3 2024	Calculo Consolidado T3 2024
(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	140,094.71
SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	140,094.71
2 Financiamiento minorista no garantizado	166,369	166,369
3 Financiamiento estable	98,2016	60798,2016
4 Financiamiento menos estable	68,1686	81768,1686
5 Financiamiento mayorista no garantizado	269,244	93,492
6 Depósitos operacionales	159,543	39,079
7 Depósitos no operacionales	109,020	53,732
8 Deuda no garantizada	681	681
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	500

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 47 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

10Requerimientos adicionales:282,28920,210282,28920,210
11Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de
garantías8,4326,6068,4326,606
12Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda0000
13Líneas de crédito y liquidez273,85713,604273,85713,604
14Otras obligaciones de financiamiento contractuales64646464
15Otras obligaciones de financiamiento contingentes2,8602,8602,8602,860
16TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO No aplica130,549 No aplica130,549
ENTRADAS DE EFECTIVO
17Entradas de efectivo por operaciones garantizadas11,04250711,042507
18Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas47,70230,01547,70230,015
19Otras entradas de efectivo15,61415,61415,61415,614
20TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO74,35846,13674,35846,136
Importe ajustado
21TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLESNo aplica140,095No aplica140,095
22TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVONo aplica84,414No aplica84,414
23COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ[1]No aplica167.01No aplica167.01

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

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$75,443 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$30,407 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 \$5,608 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$13,661 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas por flujo de carteras de \$28,162 millones y por operaciones de call money de \$8,669 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$14,900 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de \$134,768 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$99,269 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$24,384 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE, cabe mencionar que dicha posición no incluye a los BREMS debido a que se reportan como títulos de deuda de nivel 1; adicionalmente, efectivo disponible por \$7,670 millones y \$4,053 millones en títulos de nivel 2.

c) Los cambios de los principales componentes dentro del trimestre que se reporte; Promedio del segundo trimestre 2024: 158% - promedio del tercer trimestre 2024: 167% El coeficiente de cobertura de liquidez incrementó 900 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:

- En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$5,181 millones y los depósitos en bancos crecieron en MXN \$5,229 millones.
- Los activos líquidos tuvieron una disminución de \$16,311 millones.
- Finalmente, fondeo tradicional del banco decreció en \$22,965 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo crecieron en \$14,190 millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables ;
Evolución de Activos Líquidos T3-2024 Julio Agosto Septiembre
Efectivo 5%6%6%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Reservas en el Banco Central 24%14%18%
Nivel 1 69%77%73%
Nivel 2^a 2%3%3%
Nivel 2B0%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

Depósitos de exigibilidad inmediata 49%48%49%

Depósitos a plazo

Del público en general 38%37%35%

Mercado de dinero 4%4%4%

Títulos de crédito emitidos 3%4%5%

Cuenta global de captación sin movimientos 0%0%0%

PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS

De exigibilidad inmediata 0%0%0%

De corto plazo 3%3%3%

De largo plazo 3%4%4%

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 aumentos en colaterales.

Exposición Potencial Futura (septiembre 2024)

(Cifras en millones de pesos)

Con contrato de compensación 4,953

Sin contrato de compensación 10,200

Posibles llamadas de margen (septiembre 2024)

Colateral en Tránsito 73

Downgrade (septiembre 2024)
Baja calificación 3 niveles5,608

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

Scotiabank-Exposición en Derivados
(cifras en millones de pesos) Posición Cierre

Factor de Riesgo
Tasas de interés 1,739,583
Tipo de cambio 323,278
Capitales 7,874

Total 2,070,735

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 2024, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 6.6% al cierre de septiembre del 2024 y en promedio durante tercer trimestre del 2024 fue de 6.3%.

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 2024.

Descripción Promedio

T3 2024 Septiembre 2024

Cash GAP 30 d - Grupo - estresado (MXN MM) 49,13844,672

Cash GAP 90 d - Grupo - estresado (MXN MM) 74,79470,319

Horizonte de Supervivencia - Banco (días) 3939

Horizonte de Supervivencia - Banco - estresado (días) 3838

Horizonte de Supervivencia - Grupo (días) 3939

Horizonte de Supervivencia - Grupo - estresado (días) 3838

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 2024 y el promedio del tercer trimestre de 2024 son:

Scotiabank Posición

(Cierre) Posición (Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,45458,042

Liquidity Buffer

(bajo métrica CCL) 134,348130,471

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 53 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

de Contingencia de Liquidez el cual incorpora las acciones correctivas que la institución tendría que poner en marcha en caso de contingencia.

e) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranas, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- 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 2024, los cuales fueron superiores al 100%, y de acuerdo a lo estipulado en las Disposiciones de carácter general sobre los requerimientos de liquidez para las instituciones de banca múltiple, Scotiabank durante los 3 meses del tercer trimestre 2024, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

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

Periodo Reportado: tercer trimestre del 2024

Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto

(Cifras en millones de pesos) Cifras Individuales Cifras Consolidadas

Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado Importe sin ponderar por plazo residual Importe ponderado

Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año Sin vencimiento < 6 meses De 6 meses a < 1 año > 1 año

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE

1 Capital: 89,296.240.000.000.0089,296.2489,296.240.000.000.0089,296.24

2 Capital fundamental y capital básico no fundamental. 89,296.240.000.000.0089,296.2489,296.240.000.000.0089,296.24

3 Otros instrumentos de capital. 0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00

4 Depósitos minoristas: 0.00208,944.81988.4425.71193,576.690.00208,944.81988.4425.71193,576.69

5 Depósitos estables. 0.0091,731.70489.2812.6887,622.610.0091,731.70489.2812.6887,622.61

6 Depósitos menos estables. 0.00117,213.11499.1613.03105,954.080.00117,213.11499.1613.03105,954.08

7 Financiamiento mayorista: 0.00370,199.3723,756.3443,388.07189,198.140.00370,199.3723,756.3443,388.07189,198.14

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 54 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

8Depósitos operacionales.0.0044,735.840.000.0022,367.920.0044,735.840.000.0022,367.92
9Otro financiamiento mayorista.0.00325,463.5323,756.3443,388.07166,830.220.00325,463.53
23,756.3443,388.07166,830.22
10Pasivos interdependientes0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00
11Otros pasivos: 74.2648,066.502,103.765,639.416,691.2974.2648,066.502,103.765,639.41
6,691.29
12Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto74.26
0.000.000.000.0074.260.000.000.000.00
13Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores. 0.00
48,066.502,103.765,639.416,691.290.0048,066.502,103.765,639.416,691.29
14Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible89,370.50627,210.6826,848.54
49,053.19478,762.3589,370.50627,210.6826,848.5449,053.19478,762.35

ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO

15Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento
Estable Neto.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica8,178.69No AplicaNo AplicaNo AplicaNo
Aplica8,178.69
16Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.0.000.00
0.000.000.000.000.000.000.000.00
17Préstamos al corriente y valores:0.00127,289.4638,581.10298,684.44354,098.780.00
127,289.4638,581.10298,684.44354,098.78
18Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos
elegibles de nivel I.0.0011,151.340.000.001,115.130.0011,151.340.000.001,115.13
19Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos
elegibles distintos de nivel I.0.0013,527.265,463.462,482.037,242.850.0013,527.26
5,463.462,482.037,242.85
20Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades
financieras, las cuales:0.0084,762.4030,001.19133,843.55164,662.020.0084,762.40
30,001.19133,843.55164,662.02
21Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método
Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00
22Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:0.004,058.314,319.71248,228.64
171,474.450.004,058.314,319.71248,228.64171,474.45
23Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método
Estándar establecido en las Disposiciones.0.001,111.181,203.2788,403.4958,619.490.00
1,111.181,203.2788,403.4958,619.49
24Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se
encuentren en situación de impago).0.0014,901.340.002,533.729,604.330.0014,901.340.00
2,533.729,604.33
25Activos interdependientes.0.000.000.000.000.000.000.000.000.000.00
26Otros Activos:0.0066,644.853,213.5610,808.7338,879.200.0066,644.853,213.5610,808.73
38,879.20
27Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.
0.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.000.00No AplicaNo AplicaNo Aplica0.00
28Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y
contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centralesNo Aplica
1,930.760.000.001,641.15No Aplica1,930.760.000.001,641.15
29Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.No
Aplica0.000.000.001,151.89No Aplica0.000.000.001,151.89
30Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes
de la deducción por la variación del margen inicialNo Aplica0.000.000.00988.58No Aplica
0.000.000.00988.58
31Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores. 64,714.09
3,213.5610,808.7335,097.590.0064,714.093,213.5610,808.7335,097.59
32Operaciones fuera de balance.No Aplica268,328.390.000.0013,416.42No Aplica268,328.39

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 55 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

0.000.0013,416.42

33Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.No AplicaNo AplicaNo AplicaNo

Aplica414,573.09No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica414,573.09

34Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica

115.48No AplicaNo AplicaNo AplicaNo Aplica115.48

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

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

•Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por \$186,553 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$136,107 millones, Capital (fundamental y complementario) por \$94,410 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por \$27,497 millones y \$32,843 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por \$3,449 millones.

•Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de \$353,177 millones y por operaciones mercado de dinero de \$19,416 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por \$15,649 millones, deducciones de capital por \$11,191 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por \$725 millones.

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

Promedio del segundo trimestre del 2024: 115.64% - Promedio del tercer trimestre del 2024: 115.48%

El coeficiente de financiamiento neto disminuyó 16pb respecto al segundo trimestre del 2024, esto debido principalmente a:

a.El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 22,979 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 8,743 millones.

b.El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron \$6,580 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)JulioAgostoSeptiembre

Financiamiento Estable Disponible484,319468,912483,056

Financiamiento Estable Requerido416,552414,221412,946

Coeficiente de Fondeo Estable Neto116.27%113.20%116.98%

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 2024 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$8.98 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.01 millones de pesos.

InstituciónTipo de CotizaciónEmisoraTítulosImporte ValuadoCostoPlusvalía/
Minusvalía

ScotiabankPública1_NEMAK_A920,0001.851.92(0.07)

ScotiabankPública1B_NAFTRAC_ISHRS105,0005.515.53(0.02)

ScotiabankPública1_AMX_B100,0001.621.540.08

Total1,125,000.008.988.99(0.01)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

Al cierre del tercer trimestre del año 2024, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$1.11 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	AMX_B64	9,000.01	-0.01		
Scotiabank	Pública	NEMAK_A364	2,110.01	(0.02)	(0.01)	
Scotiabank	Pública	A_BABA_N1	9,000.12	-0.12		
Scotiabank	Pública	I_MCHI_*2	7,000.32	-0.32		
Scotiabank	Pública	I_PSQ_*4	2,000.05	(0.03)	0.02	
Scotiabank	Pública	I_CUERVO_*96	5,110.07	-0.07		
Scotiabank	Pública	I_SHV_*1	1,000.15	-0.15		
Scotiabank	Pública	I_IB01_N1470	1,470.01	-0.01		
Scotiabank	Pública	I_WALMEX_*22	644	-(0.01)	(0.01)	
Scotiabank	Pública	I_GMEXICO_B10	1,000.01	-0.01		
Scotiabank	Pública	I_GCARSO_A13	213	---		
Scotiabank	Pública	I_ALFA_A111	4,290.01	-0.01		
Scotiabank	Pública	I_NEMAK_A531	5,730.01	(0.07)	(0.06)	
Scotiabank	Pública	I_CUERVO_*44	1,220.02	(0.01)	0.01	
Scotiabank	Pública	I_WALMEX_*71	1,000.09	(0.03)	0.06	
Scotiabank	Pública	I_GMEXICO_B1	1,000	---		
Scotiabank	Pública	I_GCARSO_A126	4,890.03	(0.04)	(0.01)	
Scotiabank	Pública	I_ALFA_A513	5,570.47	(0.08)	0.39	
Scotiabank	Pública	I_ARA_*50	176	---		
Scotiabank	Pública	I_B_NAFTRAC_ISHRS143	1,970.01	(0.02)	(0.01)	
Scotiabank	Pública	I_A_MGA_N700	---			
Scotiabank	Pública	I_NEMAK_A62	885	---		
Scotiabank	Pública	I_ARA_*90	105	---		
Scotiabank	Pública	I_B_NAFTRAC_ISHRS43	1,570.02	-0.02		
Scotiabank	Pública	I_CHDRAUI_B4	2,000.01	-0.01		
Scotiabank	Pública	I_ALPEK_A4	337	---		
Scotiabank	Pública	I_IB1MXX_N6	---			
Scotiabank	Pública	I_MBIL_N27	---			
Total			2,269,386.42	(0.31)	1.11	

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

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe	Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Sin cotización	EMPRESAS FRISCO, S.A. DE C.V.	1,222	---			
Scotiabank	Sin cotización	BLADEX COM8	95	---			
Total			9,317	---			

Al 30 de septiembre, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de \$1.90 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$1.40 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$0.50 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	6.300.006.3022.23%1.40
Por riesgo específico	
Canasta de acciones	6.300.006.308.00%0.50
Índices accionarios	0.000.000.004.00%0.00
Requerimiento por riesgos específico	0.000.000.004.00%0.00

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 57 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Total Requerimiento de capital 11.90

Anexo 1-0 Bis Revelación de Información relativa a la Razón de Apalancamiento

TABLA I.1

FORMATO ESTANDARIZADO DE REVELACIÓN PARA LA RAZÓN DE APALANCAMIENTO

Referencia Rubro jun-24 sep-24

1 Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance) 794,359 803,884

2 (Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III) (10,446) (11,111)

3 Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2) 783,912 792,773

Exposiciones a instrumentos financieros derivados

4 Costo actual de reemplazo asociado a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados (neto del margen de variación en efectivo admisible) 6,553 3,717

5 Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados 6,289 6,418

6 Incremento por Colaterales aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados cuando dichos colaterales sean dados de baja del balance conforme al marco contable operativo

7 (Deducciones a las cuentas por cobrar por margen de variación en efectivo aportados en operaciones con instrumentos financieros derivados) (1,932) (3,543)

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 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)

11 Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10) 10,910 6,592

Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores

12 Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas 22,871 14,052

13 (Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas) (21,870) (14,052)

14 Exposición Riesgo de Contraparte por SFT 119

15 Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros --

16 Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15) 1,012 9

Otras exposiciones fuera de balance

17 Exposición fuera de balance (importe nominal bruto) 388,965 327,896

18 (Ajustes por conversión a equivalentes crediticios) (290,435) (239,868)

19 Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18) 98,530 88,028

Capital y exposiciones totales

20 Capital de Nivel 1 76,795 78,770

21 Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19) 894,365 887,401

Coeficiente de apalancamiento

22 Coeficiente de apalancamiento de Basilea III 8.59% 8.88%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

TABLA II.1

COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

Referencia DESCRIPCIÓN jun-24 sep-24

1 Activos totales 869,361,877,814

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 (816) (842)

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 (41,221) (53,286)

5 Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores (21,859) (14,043)

6 Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden 98,530,888,028

7 Otros ajustes (9,631) (10,268)

8 Exposición del coeficiente de apalancamiento 894,365,887,401

TABLA III.1

CONCILIACIÓN ENTRE ACTIVO TOTAL Y LA EXPOSICIÓN DENTRO DEL BALANCE

Referencia DESCRIPCIÓN jun-24 sep-24

1 Activos totales 869,361,877,814

2 Operaciones en instrumentos financieros derivados (52,131) (59,878)

3 Operaciones en reporto y préstamos de valores (22,871) (14,052)

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 794,359,803,884

TABLA IV.1

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

CONCEPTO/PERIODO jun-24 sep-24 Variación

Capital Básico 1) 76,795,787,770 1,975

Activos Ajustados 2) 894,365,887,401 -6,964

Razón de Apalancamiento 3) 8.59% 8.88% 29 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 2024.

El indicador se ubicó en 8.88%, 29pb mayor respecto el trimestre anterior, debido al incremento del capital nivel 1 de \$1,975 millones (+22pb) principalmente por el resultado neto del periodo; así como a la disminución de los activos ajustados por \$6,964 millones (+7pb); principalmente por la disminución de las exposiciones fuera del balance que compensaron parcialmente el incremento de las exposiciones dentro del balance.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.

3Suma de las líneas 1 y 2

4Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) recibidas, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:

a) Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución.

b) La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia.

c) El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda.

d) El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente.

e) El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos.

En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.

5Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.

En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.

6No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

7Monto de márgenes de variación en efectivo entregados en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.

8No aplica.

9No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

10No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

11Suma de las líneas 4 a 10

12Monto de los activos registrados en el balance general (cuentas por cobrar registradas contablemente)

13Importe positivo que resulte de deducir las cuentas por pagar de las cuentas por cobrar generadas por operaciones de reporto y préstamo de valores, por cuenta propia, con una misma contraparte, y siempre que se cumplan las condiciones siguientes:

a) Las operaciones correspondientes tengan la misma fecha de liquidación.

b) Se tenga el derecho de liquidar las operaciones en cualquier momento.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

c) Las operaciones sean liquidadas en el mismo sistema y existan mecanismo o arreglos de liquidación (líneas o garantías) que permitan que la liquidación se realice al final del día en el que se decide liquidar.

d) Cualquier problema relacionado con la liquidación de los flujos de los colaterales en forma de títulos, no entorpezca la liquidación de las cuentas por pagar y cobrar en efectivo.

El monto se debe registrar con signo negativo.

14 Valor de conversión a riesgo crediticio de las operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta propia, conforme al Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones cuando no exista un contrato marco de compensación. Y conforme al Artículo 2 Bis 37 cuando exista dicho contrato. Lo anterior sin considerar los ajustes por garantías reales admisibles que se aplican a la garantía en el marco de capitalización.

15 Tratándose de operaciones de reporto y préstamo de valores por cuenta de terceros, en las que la Institución otorgue garantía a sus clientes ante el incumplimiento de la contraparte, el importe que se debe registrar es la diferencia positiva entre el valor del título o efectivo que el cliente ha entregado y el valor de la garantía que el prestatario ha proporcionado.

Adicionalmente, si la Institución puede disponer de los colaterales entregados por sus clientes, por cuenta propia, el monto equivalente al valor de los títulos y/o efectivo entregados por el cliente a la Institución.

16 Suma de las líneas 12 a 15

17 Montos de compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden conforme a los Criterios Contables.

18 Montos de las reducciones en el valor de los compromisos crediticios reconocidos en cuentas de orden por aplicar los factores de conversión a riesgo de crédito establecidos en el Título Primero Bis de las presentes disposiciones, considerando que el factor de conversión a riesgo de crédito mínimo es del 10 % (para aquellos casos en los que el factor de conversión es 0 %) y en el caso de las operaciones a las que se hace referencia en el inciso IV del artículo 2 Bis 22 de dichas disposiciones, un factor de conversión a riesgo de crédito de 100%.

El monto se debe registrar con signo negativo.

19 Suma de las líneas 17 y 18

20 Capital Básico calculado conforme al artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

21 Suma de las líneas 3, 11, 16 y 19

22 Razón de Apalancamiento. Cociente de la línea 20 entre la línea 21.

TABLA II.2

NOTAS AL COMPARATIVO DE LOS ACTIVOS TOTALES Y LOS ACTIVOS AJUSTADOS

Referencia Explicación

1 Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2 Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos b), d), e), f), g), h), i), j) y l) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3 No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

4 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 11 de la Tabla I.1 y la cifra presentada en operaciones con instrumentos financieros derivados contenidos en el balance de la Institución.

.El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo

5 Monto equivalente a la diferencia entre la cifra contenida en la fila 16 de la Tabla I.1 y la cifra presentada por operaciones de reporto y préstamo de valores contenidos en el balance de la Institución.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

El importe se debe registrar con el signo resultante de la diferencia señalada, es decir podrá ser positivo o negativo.

6Importe registrado en la fila 19 de la Tabla I.1. El monto se debe registrar con signo positivo.

7Monto de las deducciones del capital básico contenidas en los incisos c), k), m), n), p), q) y r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

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

TABLA III.2

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

ReferenciaDescripción

1Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

2El monto correspondiente a las operaciones en instrumentos financieros derivados presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

3El monto correspondiente a las operaciones de reporto y préstamo de valores presentadas en el activo de los últimos estados financieros.

El monto se debe registrar con signo negativo.

4No aplica. El ámbito de aplicación es sobre la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.

5Suma de las líneas 1 a 4, la cual debe coincidir con la línea 1 de la Tabla I.1

AGENCIAS CALIFICADORAS

Scotiabank-Calificaciones Escala NacionalLargo plazoCorto plazoPerspectiva

Fitch RatingsAAA(mex)F1+(mex)Estable

Standard & Poor'ssmxAAAmxA-1+Estable

La información aquí publicada ha sido preparada por Scotiabank con el único fin de informar a sus clientes las calificaciones vigentes que le han sido otorgadas por las 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 62 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

Asambleas de Accionistas, por un monto total de \$3,148,000,000.00 (Tres mil ciento cuarenta y ocho millones de pesos 00/100) M.N., para Scotiabank Inverlat, S.A. a razón de \$0.3555655955272 por acción para distribuirse sobre la totalidad de las acciones en circulación.

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

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

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

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

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

FUENTES INTERNAS Y EXTERNAS DE LIQUIDEZ

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

- Instrumentos de Mercado por un valor de MXN\$117,904 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$42,492 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 2024, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

Instrumentos

Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

El Banco recurre a los productos derivados para controlar el riesgo de mercado que se deriva de sus actividades de captación de fondos de inversión, así como para reducir el costo de su fondeo. Para controlar el riesgo de tasas de interés en sus actividades de préstamos a tasa fija, se recurre a los intercambios (swaps) de tasas de interés y a los futuros de tasa de interés. Los contratos adelantados de divisas se emplean para controlar el riesgo cambiario. El Banco negocia productos derivados por cuenta de sus

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

Núm. Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)

9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

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

Subyacente Futuros Opciones Swaps

MRMRMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (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:

- 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 68 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

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 2024 y en promedio para el tercer trimestre de 2024 es de:

Scotiabank-

Brechas de liquidez acumuladas

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,45458,042

Liquidity Buffer 134,348130,471

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

Se presenta la relación de instrumentos financieros derivados que se encuentran presentes en el documento Master Configuration - Grupo Financiero Scotiabank (México).

El presente documento sirve como referencia rápida a las técnicas de valuación

implementadas tanto en los aplicativos del Grupo Financiero (OPICS) o en los

aplicativos desarrollados en casa matriz (K2/Peak & Wall Street).

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

Producto Subyacente Moneda Modelo de Valuación Factor de Valuación Fuente de Precios

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

IRS Futures TIIE Fondeo MXN Price Price VALMER

Listed Interest Rate Swap (CME) TIIE Fondeo MXN Swap Interest Rate Curve VALMER

OTC European Index Call Spread Option OTC European Index Call Spread Option MXN, CAD, USD, EUR, JPY Call Spread Option Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket Option Equity Index, Common Stock MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity Option Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with Target Volatility (Vol Under 15%) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Equity Option Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 69 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

OTC Index Binary Equity OptionCommon Stock, Equity Index, ETFMXN,CAD,USD,
EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVLMER

Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVLMER

Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVLMER

Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVLMER

Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVLMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,

MXN,PEN,AUD,EUR,

JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVLMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER

FX Rate

Surface

OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,

EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER

FX Rate

Surface

Price

Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,

BRL,CLP,COP,PEN,

AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios

Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,

EUR,JPY PricePriceVALMER

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

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

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

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

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 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el tercer trimestre de 2024 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

**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 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

cubierto debe ajustar el valor en libros de dicha posición y se reconoce inmediatamente en los resultados del período en que ocurre.

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

C) INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS

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

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

Al cierre de septiembre de 2024 y promedio del tercer trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank-

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Liquidity Buffer 134,348,130,471

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)NormalEscenario

PosibleEscenario

ProbableEscenario

Estrés

Gap 30d Gap Acum60,45454,84554,84454,842

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(5,609)(5,610)(5,612)

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

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

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

DELTA

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

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

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

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

GAMMA

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

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

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

VEGA

Vega es el nombre que se da a la medida de sensibilidad del valor de un portafolio de opciones ante cambios en las volatilidades de mercado del subyacente. Matemáticamente,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 75 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

vega se define como la primera derivada de la función de Black & Scholes con respecto a la volatilidad implícita.

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

RHO

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

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

THETA

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

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

DIVIDEND RISK

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

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

II. INFORMACIÓN CUANTITATIVA

Cifras expresadas en pesos

A)ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.
Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a
septiembre 30, 2024

	0 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(347,953.69)	(69,941.60)	(177,804.18)	10,870.24	(584,848.44)	(1,169,677.67)
CCS	(332.92)	150.99	207.59	17.85	43.55	87.06
Caps&Floors	(5,341.44)	438.87	(5.40)	(0.35)	(4,900.55)	(9,808.87)
Binary Caps&Floors	-----					
TIIE Futures	-----					
Total DERIVATIVES	(353,628.05)	(69,351.74)	(177,601.99)	10,887.74	(589,705.44)	(1,179,399.48)

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 (176.24) Millones de pesos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 76 / 80
 CONSOLIDADO
 Impresión Final

b) Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
 c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.
 Los escenarios de stress están basados en el movimiento al alza que pudieran tener las tasas de interés, en el escenario probable de 50 pb, en el escenario poco probable de 100 pb y en el escenario muy poco probable 200pb. Los escenarios se muestran a continuación.

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock

(+/-) P&L Stress 1

Shock

(+/-) P&L Stress 2

Shock

(+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIE y Bono M--50.00-100.00-200.00-

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps (1.18) 121.68 50.00 (58.97) 100.00 (117.94) 200.00 (235.88)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.01) 2.37 0.10 (0.00) 0.40 (0.00) 1.00 (0.01)

a FX %Forwards 1.85 36.53 0.10 (3.65) 0.20 (7.31) 0.50 (18.26)

a FX %Opciones Divisa--0.10-0.20-0.50 0.00

Total (62.62) (125.25) (254.15)

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

Opciones Delta Vega Gamma

Options AAPL.OQ---

Options BNPUI5.INDX 6,588.00 23,902.00 220.00

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options INTC.OQ---

Options MEXBOL.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

Options SPX.INDX---

Options SPXFP.INDX---

Options SPXSR5.INDX---

Options STX50E.INDX---

Total 6,588.00 23,902.00 220.00

Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja (0.1) (0.3) (0.5)

Options AAPL.OQ---

Options BNPUI5.INDX (658.80) (1,976.40) (3,294.00)

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options INTC.OQ---

Options MEXBOL.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 77 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Total (658.80) (1,976.40) (3,294.00)

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

Escenarios al alza 0.050.150.2
Options AAPL.OQ---
Options BNPUI5.INDX 329.40988.201,317.60
Options ENHFO5.INDX---
Options ENHGE5.INDX---
Options INTC.OQ---
Options MEXBOL.INDX---
Options MSFDV1.INDX---
Options QQQ.OQ---
Options SHELL.AS---
Options SPX.INDX---
Options SPXFP.INDX---
Options SPXSR5.INDX---
Options STX50E.INDX---
Total 329.40988.201,317.60

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Escenario Monto
Probable (658.80)
Poco Probable (1,976.40)
Muy poco Probable (3,294.00)

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 2024 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte Colateral Recibido MXN Colateral Enviado MXN Colateral Recibido USD Colateral Enviado USD
CLIENTE 1--19,555,000 (13,180,000)
CLIENTE 2 970,000,000 (812,000,000) --
CLIENTE 3--755,000-
CLIENTE 4--4,525,000-
CLIENTE 5- (34,900,000) --
CLIENTE 6 39,600,000 (533,854,889) 37,825,000 (32,575,000)
CLIENTE 7--27,210,000 (31,390,000)
CLIENTE 8--162,980,000 (194,570,000)
CLIENTE 9--114,300,000 (247,800,000)
CLIENTE 10--570,000-
SUBTOTAL 1,009,600,000 (1,380,754,889) 367,720,000 (519,515,000)

Contraparte Colateral Recibido MXN Colateral Enviado MXN Colateral Recibido USD Colateral Enviado USD
CLIENTE 11--5,910,000 (830,000)
CLIENTE 12--- (100,000)
CLIENTE 13--27,890,000 (26,650,000)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

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

PAGINA 78 / 80
CONSOLIDADO
Impresión Final

CLIENTE 14--- (580,000)
CLIENTE 1595,400,000 (49,200,000) --
CLIENTE 16230,300,000 (382,300,000) --
CLIENTE 17300,000---
CLIENTE 18339,600,000 (199,500,000) 111,810,000 (102,160,000)
CLIENTE 19333,214,685 (852,937,172) --
CLIENTE 201,000,000---
CLIENTE 2126,400,000---
CLIENTE 22--4,230,000 (5,200,000)
CLIENTE 23--1,750,000-
CLIENTE 24--680,000 (340,000)
CLIENTE 25--260,000 (2,960,000)
CLIENTE 26--6,500,000 (21,870,000)
TOTAL2,035,814,685 (2,864,692,061) 526,750,000 (680,205,000)

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

ProductoFechaClienteDivisaMontoMotivo del incumplimiento

Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)10/07/2024Cliente 1MXN(51,234) Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)12/07/2024Cliente 2MXN115,617 Falla del sistema propio
Pagos por Operaciones de Opción17/07/2024Cliente 3MXN1,665,500Pago cuenta erronea
Pagos por Operaciones Cambiarias22/07/2024Cliente 4MXN893,740 Falta de liquidez
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)29/07/2024Cliente 5MXN(1,000,742)En espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)29/08/2024Cliente 6MXN(1,099,126)En espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Opción03/09/2024Cliente 7MXN2,828,143No realizó unwind
Pagos por Operaciones de Opción04/09/2024Cliente 8USD50,000 Otros
Pagos por Operaciones de Opción04/09/2024Cliente 9MXN(920,000) Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)18/09/2024Cliente 10EUR114,653 Otros
Pagos por Operaciones de Opción19/09/2024Cliente 11MXN18,650,000Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción19/09/2024Cliente 12MXN(200,000)Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción19/09/2024Cliente 13USD(1,000,000)Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)26/09/2024Cliente 14USD4,098Pago incompleto
Pagos por Operaciones de Opción26/09/2024Cliente 15MXN18,650,000Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción26/09/2024Cliente 16MXN(200,000)Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción26/09/2024Cliente 17USD(1,000,000)Se rechazó pago
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards)27/09/2024Cliente 18USD14,824,848 Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps)30/09/2024Cliente 19MXN(1,039,802) Otros

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

Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 79 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

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

PAGINA 80 / 80

CONSOLIDADO

Impresión Final

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS
Cifras expresadas en pesos

(Ver archivo completo en PDF)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 18 de octubre de 2024, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Javier Antonio Serebrisky (Director General Adjunto de Finanzas), Fernando Rodríguez Antuña (Director General Adjunto Auditoría Grupo), y Julián Felipe Vásquez Wilches (Director Corporativo Contabilidad General y Reportes Regulatorios), autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2023 y 2022.

De conformidad con la Ley General de Sociedades Mercantiles (LGSM), los estatutos del Banco y las Disposiciones de Carácter General aplicables a las Instituciones de Crédito (las Disposiciones), emitidas por la Comisión los accionistas y la Comisión tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2024 adjuntos, se someterán a la aprobación de los Accionistas.

Bases de presentación

Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados están preparados con fundamento en la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para instituciones de crédito en México (los Criterios de Contabilidad) establecidos en el Anexo 33 de las Disposiciones, y las reglas de operación aplicables, establecidos por la Comisión, quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito y realiza la revisión de su información financiera.

Los Criterios de Contabilidad establecen que la contabilidad de las instituciones de crédito debe ajustarse a la estructura básica de las Normas de Información Financiera (NIF) definida por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A.C. (CINIF) en la NIF A-1 "Estructura de las normas de información financiera", considerando en primera instancia las NIF contenidas en la Serie NIF A "Marco conceptual", así como lo establecido en el criterio de contabilidad A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad". Asimismo, establecen que las instituciones deben observar los lineamientos contables de las NIF, excepto cuando sea necesario, a juicio de la Comisión, aplicar una normatividad o criterios de contabilidad específicos sobre el reconocimiento, valuación, presentación y revelación aplicables a rubros específicos de los estados financieros consolidados y los aplicables a su elaboración.

Los Criterios de Contabilidad señalan que a falta de criterio contable específico de la Comisión para las instituciones de crédito, o en un contexto más amplio, de las NIF, se aplicarán las bases de supletoriedad previstas por la NIF A-8 "Supletoriedad", y sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la citada NIF y el mismo criterio contable,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 93

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 por sus siglas en inglés) y cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando cumpla con los requisitos del criterio A-4 "Aplicación supletoria a los criterios de contabilidad" de la Comisión.

(Continúa)

Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

La información sobre juicios realizados en la aplicación de políticas contables que tienen el efecto más importante sobre los importes reconocidos en los estados financieros consolidados se describe en las siguientes notas:

Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros: definición del modelo de negocio: Instrumento Financiero para Cobrar Principal e Interés (IFCPI), Instrumento Financiero para Cobrar o Vender (IFCV), o Instrumento Financiero Negociable (IFN).

Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: determinación sobre si los instrumentos financieros son de negociación o son designados con fines de cobertura.

Nota 10 y 11 - Cartera de crédito: definición del modelo de negocio, ya sea para cobrar principal e interés (IFCPI), o para cobrar o vender (IFCV).

Nota 14 - Activos por derecho de uso: determinación de si un acuerdo contiene un arrendamiento.

Nota 17 - Inversiones en asociadas y otras inversiones permanentes: determinación si el Banco tiene influencia significativa (inversiones en asociadas) y determinación de si el Banco tiene control de facto sobre una participada.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

La información sobre supuestos e incertidumbres de estimación que tienen un riesgo significativo de resultar en un ajuste material a los importes en libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las notas a continuación:

-Nota 3j - Valuación de instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo.

-Nota 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

-Nota 7 - Inversiones en instrumentos financieros.

-Nota 10 y 11 - Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios y de recuperabilidad de cuentas por cobrar: supuestos e insumos utilizados en su determinación.

-Nota 18 - Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables, y la materialización de los impuestos diferidos.

-Nota 21 - Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves.

Determinación del valor razonable

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 3 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Algunas de las políticas y revelaciones contables del Banco requieren la medición de los valores razonables tanto de los activos y pasivos financieros como de los no financieros.

(Continúa)

El Banco cuenta con un marco de control establecido en relación con la medición de los valores razonables. Esto incluye la autorización por parte del Consejo de Administración de la contratación de un proveedor de precios, además de la autorización por parte del Comité de Riesgos del Banco de los modelos de valuación internos y sus modificaciones, los métodos de estimación de las variables usadas en estos modelos de valuación cuando no son proporcionadas directamente por el proveedor de precios que el Banco haya contratado, y de aquellos valores y demás instrumentos financieros a los que les son aplicables los modelos de valuación internos.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable, incluyendo los valores razonables de Nivel 3, y que reporta directamente a la Dirección de Finanzas. El equipo de valuación revisa regularmente los datos de entrada no observables significativos y los ajustes de valuación. Si se usa información de terceros, como cotizaciones de corredores o servicios de fijación de precios, para medir los valores razonables, el equipo de valuación evalúa la evidencia obtenida de los terceros para respaldar la conclusión de que esas valuaciones satisfacen los requerimientos de las NIF, incluyendo el nivel dentro de la jerarquía del valor razonable dentro del que deberían clasificarse esas valuaciones. Los asuntos de valuación significativos son informados al Comité de Auditoría y al Consejo de Administración del Banco.

Asimismo, el marco de control establecido incluye un equipo de valuación que tiene la responsabilidad general de la supervisión de todas las mediciones significativas del valor razonable.

Cuando se mide el valor razonable de un activo o pasivo, el Banco utiliza datos de mercado observables siempre que sea posible. Los valores razonables se clasifican en distintos niveles dentro de una jerarquía del valor razonable que se basa en los datos de entrada (observabilidad de los insumos) usados en las técnicas de valoración, como sigue:

Nivel 1: precios cotizados (no-ajustados) en mercados activos para activos o pasivos idénticos, que corresponde al nivel más alto.

Nivel 2: datos de entrada diferentes de los precios cotizados incluidos en el Nivel 1, que sean observables para el activo o pasivo, ya sea directa (es decir, precios) o indirectamente (es decir, provenientes de los precios).

Nivel 3: datos o insumos para medir el activo o pasivo que no se basan en datos de mercado observables (datos de entrada no observables), que corresponde a el nivel más bajo.

Los instrumentos financieros que son valuados mediante el uso de un modelo de valuación interno del Banco no son considerados bajo ninguna circunstancia como Nivel 1.

Si los datos de entrada usados para medir el valor razonable de un activo o pasivo se clasifican en niveles distintos de la jerarquía del valor razonable, entonces la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 4 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

medición del valor razonable se clasifica en su totalidad en el mismo nivel de la jerarquía del valor razonable que la variable de más baja observabilidad que sea significativa para la medición total.

Conforme a lo establecido en las Disposiciones, el Banco determina el valor razonable de los siguientes instrumentos financieros mediante la valuación directa a vector, que consiste en aplicar a la posición en títulos o contratos del Banco el precio actualizado para valuación proporcionado por un proveedor de precios:

Valores inscritos en el registro nacional de valores o autorizados, inscritos o regulados en mercados reconocidos por la Comisión.

(Continúa)

Instrumentos financieros derivados que cotizan en bolsas de derivados nacionales o que pertenecen a mercados reconocidos por el Banco Central.

Activos subyacentes y demás instrumentos financieros que forman parte de las operaciones estructuradas o paquetes de derivados, cuando se trata de valores o instrumentos financieros previstos en las fracciones 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 los años terminados al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no se observó una disminución significativa en el volumen (o nivel de actividad) en relación con la actividad normal del mercado. Lo anterior considerando el tipo de instrumentos financieros que mantiene el Banco, su baja complejidad y por la disminución de la volatilidad en los mercados financieros en 2023 y 2022.

Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, no existe una reducción en la disponibilidad de precios e insumos proporcionados por el proveedor de precios, por lo que no hay un deterioro evidente y que resulte significativo de las condiciones observables en los insumos utilizados para la valuación de los valores y los otros instrumentos financieros que requiera el reconocimiento de un deterioro en su valor. Como parte de los controles del Banco, se monitorea la evolución de los mercados financieros, liquidez y condiciones de disponibilidad de precios e insumos para la valuación de los instrumentos con el fin de anticipar cualquier deterioro en el valor de los mismos.

El Banco reconoce las transferencias entre los niveles de la jerarquía del valor razonable al final del período sobre el que se informa durante el cual ocurrió el cambio.

Las siguientes notas incluyen información adicional sobre los supuestos hechos al medir los valores razonables:

-Nota 4 - Jerarquía de Valor Razonable: Valores de mercado de títulos sin mercado observable.

- Nota 7 - Inversión en instrumentos financieros; y

- Nota 9 - Instrumentos financieros derivados y relaciones de cobertura.

Moneda funcional y de informe

Los estados financieros consolidados antes mencionados se presentan en moneda de informe peso mexicano, que es igual a la moneda de registro y a su moneda funcional.

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 5 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

cuando se hace referencia a dólares o USD, se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

Presentación del resultado integral

En cumplimiento con el criterio contable D-2 "Estado de resultado integral" establecido por la Comisión, el Banco presenta el resultado integral en un solo estado que presenta en un único documento todos los rubros que conforman el resultado neto, incrementado o disminuido por los Otros Resultados Integrales (ORI) del período, así como de la participación en los ORI de otras entidades, y se denomina "Estado de resultado integral".

(Continúa)

Reconocimiento de activos y pasivos financieros en su fecha de concertación

Los estados financieros consolidados reconocen los activos y pasivos provenientes de operaciones de compraventa de divisas, inversiones en valores, préstamo de valores e instrumentos financieros derivados en la fecha en que la operación es concertada, independientemente de su fecha de liquidación.

Resumen de las principales políticas contables

Las políticas contables que se muestran a continuación se han aplicado uniformemente en la preparación de los estados financieros consolidados que se adjuntan.

Reconocimiento de los efectos de la inflación

Los estados financieros consolidados que se acompañan fueron preparados de conformidad con los Criterios de Contabilidad, los cuales debido a que el Banco opera en un entorno económico no inflacionario conforme lo establece la NIF B-10 "Efectos de la inflación", incluyen el reconocimiento de los efectos de la inflación hasta el 31 de diciembre de 2007 con base en el valor de la Unidad de Inversión (UDI), que es una unidad de cuenta cuyo valor es determinado por el Banco de México (Banco Central) en función de la inflación. El porcentaje de inflación anual, acumulada en los tres últimos ejercicios y los valores de la UDI utilizados para determinar la inflación, se muestran a continuación:

Inflación

31 de diciembre de UDI Del año Acumulada

2023 7.98 164.38 % 20.83 %

2022 7.64 687.58 % 19.50 %

2021 7.10 827.61 % 14.16 %

Bases de consolidación

Los estados financieros consolidados incluyen los del Banco, S. A. y los de sus subsidiarias en las que ejerce control. Los saldos y operaciones importantes entre las compañías del grupo se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados. La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las entidades al 31 de diciembre de 2023 y 2022, los que se prepararon de acuerdo con los Criterios de Contabilidad establecidos por la Comisión.

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2023 y 2022, se detallan a continuación:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 6 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

(Continúa)

Operaciones en moneda extranjera

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio de cierre de jornada de operación determinado por el Banco Central.

A la fecha de cierre de los estados financieros consolidados, los activos y pasivos monetarios en moneda extranjera se convierten al tipo de cambio de cierre de jornada de operación publicado por el Banco Central y las ganancias o pérdidas en cambios que se originan en la conversión de moneda extranjera se reconocen en los resultados del ejercicio en el período en que se originan dentro del rubro "Resultado por intermediación", según sea el caso.

Compensación de activos financieros y pasivos financieros

Un activo y pasivo financiero serán objeto de compensación de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado su importe neto, sólo cuando el Banco tiene el derecho legalmente exigible y vigente de compensarlos en cualquier circunstancia, y a su vez la intención de liquidarlos sobre una base compensada, o de realizar el activo financiero y liquidar el pasivo financiero simultáneamente.

Efectivo y equivalentes de efectivo

El efectivo se reconoce a su valor nominal. Se consideran efectivo, la moneda de curso legal y moneda extranjera en caja, los depósitos en el Banco Central y los depósitos en entidades financieras del país y el extranjero, ya sea en cuentas de cheques, giros bancarios, telegráficos o postales y remesas en tránsito.

Los equivalentes de efectivo se reconocen inicialmente a su valor razonable. Éstos incluyen valores a corto plazo, de alta liquidez, fácilmente convertibles en efectivo que están sujetos a riesgos poco importantes en su valor (donde estos últimos son aquellos cuyo plazo de vencimiento se prevé dentro de un máximo de 48 horas a partir de su adquisición), entre otros, los préstamos interbancarios con vencimientos iguales o menores a tres días hábiles (operaciones de "Call Money"), las compras de divisas que no se consideran instrumentos financieros derivados conforme lo establece el Banco Central en la regulación aplicable, y otros equivalentes de efectivo tales como corresponsales, documentos de cobro inmediato, metales preciosos amonedados e inversiones disponibles a la vista.

La valuación de los equivalentes de efectivo representados por metales preciosos amonedados se realiza a su valor razonable, considerándose como tal a la cotización aplicable a la fecha de valuación, excepto aquellos que por su naturaleza no tengan valor razonable, los cuales se reconocen a su costo de adquisición.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Las divisas adquiridas que se pacta liquidar en una fecha posterior a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como efectivo y equivalentes de efectivo restringidos (divisas a recibir); en tanto que las divisas vendidas se registran como una salida de efectivo y equivalentes de efectivo (divisas a entregar). Los derechos originados por las ventas de divisas se registran en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y las obligaciones derivadas de las compras de divisas se registran en el rubro de "Acreedores por liquidación de operaciones".

(Continúa)

El monto de los sobregiros en cuentas de cheques, el saldo compensado, de divisas a recibir y divisas a entregar, o de algún concepto que integra el efectivo y equivalentes de efectivo, cuando muestran saldos negativos, se presenta en el rubro de "Otras cuentas por pagar".

Las operaciones de préstamos interbancarios pactadas a un plazo menor o igual a 3 días hábiles, así como los depósitos en el Banco Central sobre las cuales no pueda disponer el Banco, se reconocen como equivalentes de efectivo restringidos.

Los intereses ganados y las utilidades o pérdidas por valuación se incluyen en los resultados del ejercicio conforme se devengan como parte de los ingresos o gastos por intereses. Los resultados por valuación y compraventa de metales preciosos amonedados y divisas se reconocen en el resultado por intermediación.

Cuentas de margen

Las cuentas de margen están asociadas a transacciones con instrumentos financieros derivados celebrados en mercados o bolsas reconocidos, y corresponden al margen inicial, aportaciones y retiros posteriores efectuados en la vigencia de los contratos correspondientes. En las cuales se depositan activos financieros altamente líquidos destinados a procurar el cumplimiento de las obligaciones correspondientes a dichos instrumentos, a fin de mitigar el riesgo de incumplimiento. El monto de los depósitos corresponde al margen inicial y a las aportaciones o retiros posteriores que efectúen el Banco y la cámara de compensación durante la vigencia del contrato de los instrumentos financieros derivados.

Las cuentas de margen en efectivo se reconocen a su valor nominal y se presentan dentro del rubro de "Cuentas de margen". Los rendimientos y las comisiones que afectan a las cuentas de margen, distintos a las fluctuaciones en los precios de los derivados, se reconocen en los resultados del ejercicio conforme se devengan dentro de los rubros de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas pagadas", respectivamente.

Las liquidaciones parciales o totales depositadas o retiradas por la cámara de compensación con motivo de las fluctuaciones en los precios de los derivados se reconocen dentro del rubro de "Cuentas de margen", afectando como contrapartida una cuenta específica que puede ser de naturaleza deudora o acreedora, según corresponda y que representa un anticipo recibido, o bien, un financiamiento otorgado por la cámara de compensación y que reflejará los efectos de la valuación de los derivados previos a su liquidación.

Inversiones en instrumentos financieros

i. Reconocimiento y medición inicial

Las inversiones en instrumentos financieros comprenden instrumentos de patrimonio neto, obligaciones, bonos, certificados y demás títulos de crédito y documentos que se emiten

en serie o en masa, cotizados y no cotizados, que la entidad mantiene como posición propia. Se miden y reconocen inicialmente a su valor razonable más, en el caso de activos o pasivos financieros no medidos a valor razonable con cambios en éste, llevados a través de resultado integral, los costos de transacción directamente atribuibles a su adquisición o emisión, cuando en lo subsecuente se midan a su costo amortizado.

ii. Clasificación y medición posterior

En el reconocimiento inicial, las inversiones en instrumentos financieros se clasifican en las siguientes categorías, conforme al modelo de negocio y las características de los flujos contractuales de los mismos, como se muestra en la hoja siguiente.

(Continúa)

Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), que tienen por objeto en su tenencia, recuperar los flujos contractuales que conlleva el instrumento. Los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden sólo a pagos de principal e interés (rendimiento), usualmente sobre el monto del principal pendiente de pago. El IFCPI debe tener características de un financiamiento otorgado y administrarse con base en su rendimiento contractual.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV), medidos a valor razonable con cambios en otros resultados integrales (VRCORI), que tienen por objetivo tanto cobrar los flujos contractuales de principal e interés, como obtener una utilidad en su venta cuando ésta resulte conveniente. El Banco de forma irrevocable reconoce los cambios en el valor razonable de los IFCV a través del ORI; e

Instrumentos financieros negociables (IFN), medidos a valor razonable con cambios en resultados (VRCR) que representan la inversión en instrumentos financieros de deuda o de capital, y que tienen por objetivo obtener una utilidad entre el precio de compra y el de venta.

La clasificación de las inversiones en instrumentos financieros se basa tanto en el modelo de negocios como en las características de los flujos contractuales de los mismos. Atendiendo al modelo de negocios, un instrumento financiero o una clase de instrumentos financieros (un portafolio), puede ser administrado bajo:

Un modelo que busca recuperar los flujos contractuales (representado por el monto del principal e intereses).

Un modelo de negocio que busca, tanto la recuperación de los flujos contractuales como en el modelo anterior, como la obtención una utilidad mediante la venta de los instrumentos financieros, lo cual conlleva a desplazar un modelo combinado de gestión de estos instrumentos financieros.

Un modelo que busca obtener un máximo rendimiento a través de compra y venta de los instrumentos financieros.

Los instrumentos financieros no se reclasifican después de su reconocimiento inicial, excepto si el Banco cambia su modelo de negocio, en cuyo caso todos los instrumentos financieros afectados son reclasificados a la nueva categoría en el momento en que el cambio en el modelo de negocio ha ocurrido.

La reclasificación de inversiones en instrumentos financieros entre categorías se aplica prospectivamente a partir de la fecha de cambio en el modelo de negocio, sin modificar ninguna utilidad o pérdida reconocida con anterioridad, tales como intereses o pérdidas por deterioro.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 9/ 93

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.

Un instrumento financiero se mide al costo amortizado si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a su valor razonable con cambios a través de resultados conforme se describe en la hoja siguiente.

(Continúa)

el instrumento financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo es mantener los instrumentos financieros para obtener la recuperación de los flujos de efectivo contractuales; y

las condiciones contractuales del instrumento financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe del principal pendiente (Sólo Pago del Principal e Intereses, o SPPI por sus siglas).

Una inversión en un instrumento de deuda se mide a valor razonable con cambios en ORI si se cumplen las dos condiciones siguientes y no está clasificado como medido a valor razonable con cambios en resultados:

-el activo financiero se conserva dentro de un modelo de negocio cuyo objetivo se logra tanto obteniendo los flujos de efectivo contractuales como vendiendo los activos financieros; y

-las condiciones contractuales del activo financiero dan lugar, en fechas especificadas, a flujos de efectivo que están representados únicamente por pagos del principal e intereses sobre el importe de SPPI.

Todos los instrumentos financieros no clasificados como medidos al costo amortizado o a valor razonable con cambios en ORI como se describe anteriormente, son medidos a valor razonable con cambios en resultados. Esto incluye todos los instrumentos financieros derivados (ver inciso (j) de esta nota).

Instrumentos financieros: Evaluación del modelo de negocio -

El Banco determina su modelo de negocio para la administración de sus inversiones en instrumentos financieros y para clasificarlos adecuadamente. El modelo de negocio se basa en la forma en que los instrumentos financieros se administran para generar flujos de efectivo para el negocio y no en una intención particular de tenencia del instrumento. Se requiere de juicio para determinar el modelo de negocio, ya que este no se basa en un solo factor o actividad, por lo que se considera toda la evidencia disponible al momento de realizar la evaluación. De forma enunciativa mas no limitativa, la evidencia relevante a evaluar es la siguiente:

las políticas y los objetivos señalados para el portafolio y la operación de esas políticas en la práctica. Estas incluyen si la estrategia de la Administración se enfoca en cobrar ingresos por intereses contractuales, mantener un perfil de tasa de interés concreto o coordinar la duración de los instrumentos financieros con la de los pasivos que dichos instrumentos están financiando o las salidas de efectivo esperadas, o realizar flujos de efectivo mediante la venta de los instrumentos;

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 10 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

cómo se evalúa el rendimiento del portafolio y cómo éste se informa a la Administración del Banco;

los riesgos que afectan al rendimiento del modelo de negocio (y los instrumentos financieros mantenidos en el modelo de negocio) y, en concreto, la forma en que se gestionan dichos riesgos;

cómo se retribuye a los gestores del negocio (por ejemplo, si la compensación se basa en el valor razonable de los instrumentos gestionados o sobre los flujos de efectivo contractuales obtenidos); y

la frecuencia, el volumen y la oportunidad de las ventas en períodos anteriores, las razones de esas ventas y las expectativas sobre la actividad de ventas futuras.
(Continúa)

Las transferencias de instrumentos financieros a terceros en transacciones que no califican para la baja en cuentas no se consideran ventas para este propósito, de forma consistente con el reconocimiento continuo de los instrumentos por parte del Banco.

Los instrumentos financieros que son mantenidos para negociación y cuyo rendimiento es evaluado sobre una base de valor razonable son medidos a valor razonable con cambios en resultados.

Instrumentos financieros: Evaluación de si los flujos de efectivo contractuales son solo pagos del principal y los intereses (SPPI).

Para propósitos de esta evaluación, el monto del "principal" se define como el valor razonable del instrumento financiero en el momento del reconocimiento inicial. El "interés" se define como la contraprestación por el valor del dinero en el tiempo y por el riesgo crediticio asociado con el importe principal pendiente, durante un período de tiempo concreto y por otros riesgos y costos básicos de los préstamos (por ejemplo, el riesgo de liquidez y los costos administrativos), así como un margen de utilidad.

Al evaluar si los flujos de efectivo contractuales son SPPI, el Banco considera los términos contractuales del instrumento. Esto incluye evaluar si un instrumento financiero contiene una condición contractual que pudiera cambiar la oportunidad o importe de los flujos de efectivo contractuales de manera que no cumpliría esta condición.

Al hacer esta evaluación, el Banco toma en cuenta:

eventos contingentes que cambiarían el importe o la oportunidad de los flujos de efectivo;

términos que pudieran generar apalancamiento;

términos que hacen referencia al valor del dinero en el tiempo, como por ejemplo ajustar la tasa del cupón, incluyendo las características de tasa variable;

términos que generen instrumentos derivados implícitos, o cambios en sus términos y condiciones, por indexación a variables ajenas a la naturaleza del contrato;

características de pago anticipado y prórroga; y

términos que limitan el derecho del Banco a los flujos de efectivo procedentes de instrumentos específicos (por ejemplo, características de "sin recurso").

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 11 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Una característica de pago anticipado es consistente con el criterio de únicamente pago del principal e intereses si el importe del pago anticipado representa sustancialmente los importes no pagados del principal e intereses sobre el importe principal, que puede incluir compensaciones adicionales razonables para el termino anticipado del contrato. Adicionalmente, en el caso de un instrumento financiero adquirido con un descuento o prima significativo de su importe nominal contractual, una característica que permite o requiere el pago anticipado de un importe que representa sustancialmente el importe nominal contractual más los intereses contractuales devengados (pero no pagados) (que también pueden incluir una compensación adicional razonable por termino anticipado) se trata como consistente con este criterio si el valor razonable de la característica de pago anticipado es insignificante en el reconocimiento inicial.

(Continúa)

Instrumentos financieros: Medición posterior y ganancias y pérdidas -

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

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

Los dividendos de los instrumentos de patrimonio neto a favor se reconocen en los resultados del ejercicio, en el momento en que se genera el derecho a recibir el pago de los mismos en el rubro de "Ingresos por intereses". No obstante, ver inciso (j) de esta nota en el caso de los derivados designados como instrumentos de cobertura. Instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI) Estos instrumentos se miden posteriormente al costo amortizado usando el método del interés efectivo. El costo amortizado se reduce por las pérdidas por deterioro. El ingreso por intereses, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en resultados. Cualquier ganancia o pérdida en la baja en cuentas se reconoce en resultados del ejercicio.

Instrumentos financieros para cobrar o vender (IFCV) Estos instrumentos se miden posteriormente a valor razonable. El ingreso por intereses calculado bajo el método de interés efectivo, las ganancias y pérdidas por conversión de moneda extranjera y el deterioro se reconocen en los resultados del ejercicio. Otras ganancias y pérdidas netas se reconocen en otros resultados integrales (VRCORI), el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. En el momento de la baja en cuentas, las ganancias y pérdidas acumuladas en otros resultados integrales se reclasifican en resultados.

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".

Inversiones en acciones a través de 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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

El Banco da de baja en cuentas un instrumento financiero cuando expiran los derechos contractuales sobre los flujos de efectivo del instrumento financiero, o cuando transfiere los derechos a recibir los flujos de efectivo contractuales en una transacción en la que se transfieren sustancialmente todos los riesgos y beneficios de la propiedad del instrumento financiero, o en la cual el Banco no transfiere ni retiene sustancialmente todos los riesgos y beneficios relacionados con la propiedad y no retiene el control sobre los instrumentos financieros.

(Continúa)

El Banco participa en transacciones en las que transfiere los instrumentos reconocidos en su estado de situación financiera consolidado, pero retiene todos o sustancialmente todos los riesgos y beneficios de los instrumentos financieros transferidos. En estos casos, los instrumentos financieros transferidos no son dados de baja en cuentas. (ver incisos (h) e (i) de esta nota).

iv. Deterioro

El Banco evalúa desde su reconocimiento inicial las pérdidas crediticias esperadas (PCE) de los IFCV y los IFCPI, las cuales se determinan considerando el nivel de recuperabilidad esperada que corresponda a los distintos IFCV y reconoce el efecto de la pérdida, con base en el costo amortizado de los IFCV y los IFCPI. Dado que el valor razonable del IFCV ya reconoce el deterioro por pérdidas crediticias esperadas, el Banco no procede a crear una estimación que reduzca el valor razonable del IFCV; por lo tanto, el efecto se reconoce en la utilidad o pérdida neta, afectando el valor del IFCV antes de reconocer el efecto en ORI por valuación a valor razonable. Para los IFCPI, se reconoce la PCE determinada afectando el valor razonable del IFCPI. Lo anterior no afecta a los IFN, pues en éstos no surge la cuestión de cobrabilidad al no existir la intención de cobro y porque el valor de mercado de los mismos capta generalmente los efectos de pérdidas crediticias esperadas de los mismos.

Las PCE son el promedio ponderado por la probabilidad de las pérdidas crediticias y se miden como el valor presente de las insuficiencias de efectivo. Al estimar las PCE, el Banco considera la información razonable y sustentable que sea relevante y esté disponible sin costos o esfuerzos indebidos. Esto incluye información cuantitativa y cualitativa y análisis, basados en la experiencia histórica del Banco y en una evaluación de crédito informada e incluyendo información prospectiva.

El Banco vigila que las PCE por el deterioro de los títulos emitidos por una contraparte, guarda consistencia con el deterioro determinado para créditos que se otorguen a la misma contraparte.

En caso de que existan cambios favorables en la calidad crediticia de los IFCV que estén debidamente sustentados con base en eventos posteriores observables, la PCE ya reconocida se revierte en el período en que ocurren dichos cambios, contra la utilidad o pérdida neta del período, como una reversión de PCE previamente reconocida.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contraparte deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 13 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

(Continúa)

Operaciones de reporto

Las operaciones de reporto que no cumplen con los términos establecidos en la NIF C-14 "Transferencia y baja de activos financieros", se les da el tratamiento de financiamiento con colateral atendiendo a la sustancia económica de dichas transacciones e independientemente si se trata de operaciones de reporto "orientadas a efectivo" u "orientadas a valores". En las transacciones "orientadas a efectivo" la intención como reportada es obtener un financiamiento en efectivo y la intención de la reportadora es el invertir su exceso de efectivo, y en la transacción "orientada a valores" la reportadora tiene como objetivo acceder a ciertos valores en específico y la intención de la reportada es la de aumentar los rendimientos de sus inversiones en valores.

Actuando como reportada

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco reconoce la entrada de efectivo o equivalentes de efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar medida inicialmente al precio pactado que se presenta en el rubro "Acreedores por reporto", la cual representa la obligación de restituir dicho efectivo a la reportadora. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por pagar se valúa a su costo amortizado mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Gastos por intereses". Los activos financieros transferidos a la reportadora ("colateral otorgado") se reclasifican en el estado de situación financiera consolidado, presentándolos como restringidos, y se siguen valuando de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda al activo.

Actuando como reportadora-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, se reconoce la salida de efectivo y equivalentes de efectivo, o bien una cuenta liquidadora acreedora, registrando una cuenta por cobrar al precio pactado que se presenta en el rubro de "Deudores por reporto", la cual representa el derecho a recuperar el efectivo entregado. A lo largo de la vigencia del reporto, la cuenta por cobrar se valúa a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devenga, de acuerdo con el método de interés efectivo, dentro del rubro de "Ingresos por intereses". Los activos financieros recibidos como colateral, se registran en cuentas de orden y se valúan a valor razonable.

En caso de que el Banco venda el colateral o lo otorgue en garantía, se reconoce la entrada de los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada (inicialmente al precio pactado), la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. El diferencial que llegara a resultar entre el precio recibido y el valor de la cuenta por pagar se reconoce en los resultados del ejercicio, en adición, se lleva en cuentas de orden el control de dicho colateral vendido o dado en garantía siguiendo para su valuación el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Asimismo, en el caso en que la reportadora se convierta a su vez en reportada por la concertación de otra operación de reporto con el mismo colateral recibido en garantía de la operación inicial, el interés por reporto pactado en la segunda operación se deberá reconocer en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo, afectando la cuenta por pagar valuada a costo amortizado mencionada anteriormente.

(Continúa)

Las cuentas de orden reconocidas por colaterales recibidos o colaterales recibidos que a su vez hayan sido vendidos o dados en garantía por la reportadora, se cancelan cuando la operación de reporto llega a su vencimiento o exista incumplimiento por parte de la reportada.

Estimación de perdidas crediticias esperadas -

La estimación para pérdidas crediticias esperadas se determina conforme a lo establecido en la NIF C-16 "Deterioro de instrumentos financieros", lo cual implica que se determina inicialmente una etapa de riesgo a cada posición, y posteriormente calcular la estimación de pérdidas crediticia esperada asociada a cada etapa.

El Banco ha desarrollado el procedimiento para determinar las pérdidas crediticias esperadas para los instrumentos financieros, con el objeto de determinar el deterioro de los deudores por reporto para su posterior reconocimiento contable.

Préstamo de valores

Es aquella operación en la que se conviene la transferencia de valores, del prestamista al prestatario, con la obligación de devolver tales valores u otros substancialmente similares en una fecha determinada o a solicitud, recibiendo como contraprestación un interés. En esta operación se solicita un colateral o garantía por parte del prestamista al prestatario.

Actuando como prestamista-

A la fecha de la contratación del préstamo de valores actuando como prestamista, el Banco registra el valor objeto del préstamo transferido al prestatario como restringido, para lo cual se siguen las normas de valuación, presentación y revelación de conformidad con el criterio de contabilidad que corresponda. Asimismo, se registra en cuentas de orden el colateral recibido que garantiza los valores prestados.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Ingresos por intereses".

Actuando como prestatario-

Actuando como prestatario, a la fecha de la contratación del préstamo de valores, el Banco registra el valor objeto del préstamo recibido en cuentas de orden, siguiendo para su valuación los lineamientos para los títulos reconocidos en el criterio de contabilidad B-9 "Custodia y administración de bienes".

El valor objeto de la operación se presenta en cuentas de orden en el rubro de colaterales recibidos por el Banco. Por lo que se refiere a colaterales recibidos provenientes de otras transacciones se deberán presentar en el rubro de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

En la fecha en que el Banco venda el valor objeto de la operación, deberá reconocer la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir dicho valor al prestamista (medida inicialmente al precio pactado) que se valorará a valor razonable.

El importe del premio devengado se reconoce en los resultados del ejercicio a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación, en el rubro "Gastos por intereses" y en el estado de situación financiera consolidado dentro del rubro de "Acreedores y otras cuentas por pagar".

(Continúa)

Instrumentos financieros derivados y operaciones de cobertura (IFD)

El Banco clasifica los instrumentos financieros derivados con base a su intencionalidad en las dos categorías que se muestran a continuación:

Con fines de negociación - Consiste en la posición que asume el Banco con la intención de obtener ganancias basadas en los cambios en su valor razonable.

Con fines de cobertura - Consiste en la posición que asume el Banco con el objeto de compensar o transformar el perfil de uno o varios de los riesgos generados por una partida cubierta.

El reconocimiento en los estados financieros consolidados de los activos y/o pasivos provenientes de operaciones con IFD, se realiza en la fecha en que se concreta la operación, independientemente de la fecha de liquidación o entrega del bien.

El Banco reconoce todos los activos o pasivos financieros resultantes de los derechos y obligaciones establecidos en los contratos de IFD, inicialmente a su valor razonable, el cual, presumiblemente, corresponde al precio de transacción, es decir, el precio de contraprestación recibida o entregada. Los costos de transacción que sean directamente atribuibles a la adquisición de IFD se reconocen directamente en resultados dentro del "Resultado por intermediación".

Posteriormente, todos los IFD se valúan a su valor razonable, sin deducir los costos de transacción en los que se pudiera incurrir en la venta u otro tipo de disposición, reconociendo dicho efecto de valuación en los resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Los derivados se presentan en el estado de situación financiera consolidado en un rubro específico del activo o del pasivo, dependiendo de si su valor razonable corresponde a un saldo deudor o un saldo acreedor, respectivamente. Dichos saldos deudores o acreedores se compensan siempre y cuando cumplan con las reglas de compensación de activos y pasivos financieros.

Para la determinación del valor razonable, se consideran los datos e insumos provistos por un proveedor de precios autorizado por la Comisión, siempre y cuando no sean instrumentos financieros derivados que coticen en bolsas nacionales o que no sean intercambiados en mercados reconocidos por el Banco Central.

Operaciones con fines de negociación-

Contratos adelantados forwards:

El contrato adelantado o "forward" se opera en forma privada (fuera de los mercados

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 16 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

organizados de futuros o de opciones). El saldo de dichos IFD representa la diferencia entre el valor razonable del contrato y el precio "forward" estipulado del mismo. Si la diferencia es positiva es plusvalía y se presenta en el activo; si es negativa es minusvalía y se presenta en el pasivo.

Opciones:

En opciones compradas, su saldo deudor representa el valor razonable de los flujos futuros a recibir, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

(Continúa)

En opciones vendidas, su saldo acreedor representa el valor razonable de los flujos futuros a entregar, reconociendo los efectos de valuación en los resultados del ejercicio.

Futuros:

El contrato a futuro opera con términos estandarizados (condiciones generales de contratación), tiene mercado secundario y requiere el establecimiento obligatorio de colaterales en cuentas de aportaciones o de margen de liquidación diaria.

Swaps:

Es un IFD mediante el cual se establece la obligación bilateral de intercambiar flujos de efectivo en fechas futuras preestablecidas, sobre un valor nominal o de referencia durante un periodo determinado.

Su saldo representa la diferencia entre el valor razonable de la parte activa y de la parte pasiva.

Operaciones con fines de cobertura-

El Banco utiliza instrumentos financieros derivados con el objetivo de manejar adecuadamente los riesgos de tasas de interés y de tipos de cambio inherentes a las operaciones de crédito, depósitos, inversiones en valores y reportos, todas ellas propias de la banca comercial. Los instrumentos más utilizados son swaps de tasas de interés y de monedas, mediante los cuales se transforma instrumentos de tasa flotante a tasa fija y de tasa fija a tasa flotante, o en su caso, se 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 consolidado, incluyendo si se espera que los cambios en los flujos de efectivo de la partida cubierta y el instrumento de cobertura se compensen entre sí.

Los derivados con fines de cobertura, que cumplen con todas las condiciones, se valúan a valor razonable y el efecto se reconoce dependiendo del tipo de cobertura, de acuerdo con lo que se muestra a continuación:

Coberturas de valor razonable. Cubren la exposición a los cambios en el valor razonable

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 17 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

de un activo o pasivo reconocido o de un compromiso en firme no reconocido, o un componente de alguna de las partidas anteriores, o una exposición agregada. La posición primaria cubierta y el instrumento derivado de cobertura se valúan a su valor razonable, registrándose el efecto neto en los resultados del período dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

(Continúa)

Coberturas de flujos de efectivo. Cubren la exposición a la variabilidad de flujos de efectivo atribuible a un riesgo particular asociado con un activo o pasivo reconocido, un portafolio o un componente de los mismos, o una o varias transacciones pronosticadas altamente probables o porciones de éstas, o una exposición agregada. Se valúa a valor razonable el instrumento derivado de cobertura y la valuación correspondiente a la parte efectiva de la cobertura, se registra dentro de la cuenta "Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo" en los Otros Resultados Integrales. La parte inefectiva se registra en resultados del período dentro del rubro "Resultado por intermediación".

Una relación de cobertura debe 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 15).

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Instrumentos financieros derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses".

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de IFD fuera de mercados o bolsas reconocidos-

La cuenta por cobrar que se genera por el otorgamiento de colaterales en efectivo en operaciones de IFD no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que la cuenta por pagar que se genera por la recepción de colaterales en efectivo se presenta dentro del rubro "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en activos no realizables, como títulos, se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Ajuste de valoración por riesgo crédito contraparte y riesgo de crédito propio

El Credit Valuation Adjustment (CVA) es un ajuste a la valuación de los instrumentos financieros derivados Over the Counter (OTC) por el riesgo asociado a la exposición crediticia asumida con cada contraparte.

Actualmente el Banco tiene implementada una metodología de cálculo de CVA bilateral a nivel contraparte que incorpora mitigantes de riesgo de crédito tales como acuerdos de compensación y colaterales.

(Continúa)

La determinación de la exposición se basa en insumos de mercado consistentes con los utilizados en los procesos de valuación de instrumentos y los parámetros de pérdida (severidad de la pérdida y probabilidad de incumplimiento) se revisan periódicamente y se someten a validaciones y pruebas de estrés (en su caso, para las contrapartes que tienen asociados Credit Default Swaps (CDS) a mercado, estos son utilizados para la obtención de la probabilidad de pérdida).

Los modelos de riesgo contraparte correspondientes a las metodologías implementadas para obtener las exposiciones de crédito para el portafolio de derivados.

El Debit Valuation Adjustment (DVA) es un ajuste de valoración similar al CVA, pero, en este caso, surge por el riesgo de crédito propio del Banco asumido por sus contrapartes en derivados financieros OTC.

Todos los valores razonables de los instrumentos financieros se calculan diariamente.

Compensación de cuentas liquidadoras

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reportos, préstamos de valores, activos virtuales y/o de operaciones con instrumentos financieros derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados, se registran en cuentas liquidadoras dentro de los rubros de "Otras cuentas por cobrar, neto" y "Acreedores por liquidación de operaciones", respectivamente, así como los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día. Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados.

Los activos y pasivos financieros se compensan de manera que se presente en el estado de situación financiera consolidado el saldo deudor o acreedor, según corresponda, siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y se tenga la intención de liquidar la cantidad neta, provengan de la misma naturaleza de la operación, se celebren con la misma contraparte y se liquiden en la misma fecha de vencimiento o de realizar el activo y cancelar el pasivo simultáneamente.

Cartera de crédito

La cartera de crédito se compone de financiamientos otorgados a clientes por el Banco a través de contratos de crédito, operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito financiero, los cuales se reconocen cuando son originados y, en caso de adquisiciones, en la fecha de concertación de la adquisición.

La cartera de crédito incluye:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 19 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cartera de crédito valuada a costo amortizado. El modelo de negocio de esta cartera de crédito consiste en conservarla para cobrar los flujos de efectivo contractuales y los términos del contrato prevén flujos de efectivo en fechas preestablecidas, que corresponden únicamente a pagos de principal e interés sobre el monto del principal pendiente de pago. Se reconoce inicialmente a su valor razonable que corresponde al precio de transacción, es decir al monto neto financiado que resulta de adicionar o restar al monto original de crédito, el seguro que se haya financiado, los costos de transacción, las comisiones, intereses y otras partidas cobradas por anticipado. Para su reconocimiento posterior, la cartera de crédito se valúa a su costo amortizado. El costo amortizado corresponde al valor presente de los flujos de efectivo contractuales por cobrar de la cartera de crédito, más los costos de transacción por amortizar, utilizando el método de interés efectivo y restando la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)

Los costos de transacción a que se hacen referencia incluyen, entre otros, honorarios y comisiones pagados a agentes, asesores e intermediarios, avalúos, gastos de investigación, así como la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades. Por otra parte, los costos de transacción no incluyen premios o descuentos, los cuales forman parte del valor razonable de la cartera de crédito al momento de la transacción.

Tanto las comisiones cobradas como los costos de transacción que origina una línea de crédito se reconocen como un crédito o cargo diferido, respectivamente, presentándose netos y afectando la cartera de crédito, los cuales se amortizan en resultados conforme se devengan, excepto si se trata de los relacionados a tarjeta de crédito o líneas de crédito revolvente, los cuáles se reconocen directamente en resultados al momento del otorgamiento.

Clasificación de la cartera de crédito

La cartera de crédito se presenta en las categorías de comercial, vivienda y consumo, conforme a lo descrito a continuación:

Créditos comerciales:

los otorgados a personas morales o personas físicas con actividad empresarial y destinados a su giro comercial o financiero;

créditos otorgados a entidades financieras distintos de los préstamos interbancarios con un plazo menor a 3 días hábiles;

créditos por operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito;

créditos otorgados a fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos y los esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados" en los que exista una afectación patrimonial que permita evaluar individualmente el riesgo asociado al esquema;

los créditos concedidos al Gobierno Federal, entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados y los créditos a empresas productivas del estado, y aquellos con garantía expresa de la Federación registrados ante la SHCP y el Banco Central, así como los garantizados expresamente por las entidades federativas, municipios y sus organismos descentralizados, asentados en el Registro Público Único a que hace referencia la Ley de Disciplina Financiera de las entidades federativas y los municipios.

Créditos a la vivienda. Se clasifican como créditos a la vivienda los créditos directos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 20 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

otorgados a personas físicas y destinados a la adquisición o construcción de la vivienda sin propósito de especulación comercial, que cuentan con garantía hipotecaria sobre la vivienda del acreditado. Asimismo, se consideran créditos a la vivienda, los destinados a la construcción, remodelación o mejoramiento de la vivienda que están respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado, o bien cuentan con una garantía otorgada por alguna institución de banca de desarrollo o por un fideicomiso público constituido por el Gobierno Federal para el fomento económico (remodelación o mejoramiento). Adicionalmente, se incluyen los créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades y aquellos créditos de liquidez garantizados por la vivienda del acreditado.

(Continúa)

La cartera de crédito de vivienda incluye créditos originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT), adquiridos por el Banco. Esta cartera de crédito incluye la denominada cartera en prórroga, que se integra por créditos que, en términos de la Ley del INFONAVIT, cuentan con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios. Lo anterior, siempre y cuando la entidad está contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos de los organismos de referencia. Al concluir la prórroga la cartera recibe el tratamiento que le corresponde conforme a si se trata de "Régimen Ordinario de Amortización" (ROA) o el "Régimen Especial de Amortización" (REA).

ROA es una a modalidad de pago que es aplicable a los acreditados que tienen una relación laboral, mediante la cual se pacta que los trabajadores pagan sus créditos a través de descuentos salariales efectuados por su patrón, entidad o dependencia.

REA es una modalidad de pago que es aplicable a acreditados que ya no cuentan con una relación laboral, a la que le son aplicables las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

Las obligaciones y derechos que el INFONAVIT tienen sobre los créditos adquiridos son las siguientes:

El Banco fue seleccionado mediante el proceso de subasta para adquirir los derechos de coparticipación en la originación de los créditos del producto "Segundo Crédito" que serán otorgados a los derechohabientes del INFONAVIT.

El INFONAVIT conserva la administración, cobranza y recuperación correspondiente a los créditos cedidos al Banco y está obligado a realizar las gestiones de cobro necesarias para la recuperación de los créditos exigibles.

Créditos de consumo. Son créditos directos otorgados a personas físicas, derivados de operaciones de tarjeta de crédito, de créditos personales, de nómina, de créditos para la adquisición de bienes de consumo duradero (conocidos como ABCD), que contempla entre otros al crédito automotriz y las operaciones de arrendamiento financiero que son celebradas con personas físicas; incluyendo aquellos créditos otorgados para tales efectos a los ex-empleados de las entidades, así como los de liquidez que no cuenten con garantía de inmuebles.

Líneas de crédito

En el caso de líneas de crédito y cartas de crédito que el Banco ha otorgado, en las

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

cuales no todo el monto autorizado esté ejercido, la parte no utilizada de las mismas se reconoce en cuentas de orden.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte, se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía se reconocen como créditos restringidos.

Operaciones de descuento y cesión de derechos de crédito

(Continúa)

El descuento es una operación por la cual el Banco, como "descontante", se obliga a anticipar a un cliente, como "descontatario", el importe de un crédito, contra tercero y de vencimiento futuro, a cambio de la enajenación a favor de del Banco de dicho crédito, disminuido por un interés a favor del descontante.

Las cesiones de derechos de crédito son operaciones de financiamiento mediante las cuales se transmite al Banco la titularidad de derechos de crédito, siendo distintas de las adquisiciones de cartera de crédito.

Para cualquiera de las operaciones mencionadas anteriormente, el Banco reconoce inicialmente como cartera de crédito el valor nominal de la cartera recibida contra la salida de efectivo, el aforo pactado reconocido en "Otras cuentas por pagar" por importe del valor nominal de los derechos de crédito transferidos que no financia el Banco, y el ingreso financiero por devengar.

El ingreso financiero por devengar de estas operaciones corresponde a la diferencia entre el valor de la cartera recibida deducida del aforo y el monto financiado. Su devengamiento en el resultado integral se determina y reconoce conforme a la tasa de interés efectiva de las operaciones.

Pagos en especie

Los pagos en especie se reconocen de conformidad con lo establecido en la política contable de bienes adjudicados en la nota 3s.

Modelo de negocio de la cartera de crédito

La determinación del modelo de negocio para la cartera de crédito se basa en el historial de cómo el Banco la administra. El Banco considera lo siguiente:

La forma en cómo se determina e informa el desempeño de la cartera de crédito. Los riesgos que afectan el desempeño del modelo de negocio y de la cartera de crédito y cómo son administrados esos riesgos. Los lineamientos sobre los que se basa la remuneración de la dirección de crédito, si con base en maximizar el valor de la cartera de crédito o en cobrar sus flujos contractuales.

El Banco considera también la frecuencia, el valor y la oportunidad de las ventas de cartera de crédito en períodos anteriores, las razones de dichas ventas, así como las expectativas sobre la actividad de ventas futuras dentro del contexto y condiciones en que se presentaron, y la influencia que tienen en la forma en que se logra el objetivo de la entidad para administrar o gestionar la cartera de crédito y, específicamente sobre cómo se realizan los flujos de efectivo.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Trimestralmente el Banco evalúa las características de sus modelos de negocio para clasificar la cartera de crédito con base en el objetivo del mismo, conforme a sus políticas establecidas.

Renegociaciones

Se consideran renegociaciones a las reestructuras y renovaciones de las operaciones de cartera de crédito, las cuales se describen, en la hoja siguiente.

(Continúa)

Reestructuración. Es una renegociación de la que se deriva cualquier modificación a las condiciones originales del crédito, entre las cuales se encuentran:

cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;
cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, Veces Salario Mínimo (VSM), Unidad de Medida y Actualización (UMA) o Unidades de Inversión (UDI);
concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo para la Atención de Emergencias por Amenazas Naturales "OTIS";
prórroga del plazo del crédito;
modificación al esquema de pagos pactado, o
ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate.

Renovación. Es una renegociación en la que el saldo de un crédito es liquidado parcial o totalmente por el deudor, sus obligados solidarios u otra persona que por sus nexos patrimoniales constituya riesgos comunes con el deudor, a través del incremento al monto original del crédito, o bien con el producto proveniente de otro crédito contratado con la misma entidad o con un tercero que por sus nexos patrimoniales con esta última constituya riesgos comunes.

No obstante lo anterior, el Banco no considera renovado un crédito por las disposiciones que se efectúen durante la vigencia de una línea de crédito preestablecida, siempre y cuando el acreditado haya liquidado la totalidad de los pagos que le sean exigibles conforme a las condiciones originales del crédito.

Por las reestructuras, así como por las renovaciones con las que se liquida parcialmente el crédito original, el Banco reconoce una utilidad o pérdida por la diferencia entre los flujos de efectivo del nuevo crédito descontados a la tasa de interés efectiva original y el valor en libros del crédito original a la fecha de la renegociación, sin considerar su estimación preventiva para riesgos crediticios.

Para efectos de lo anterior, se considera valor en libros al monto efectivamente al acreditado, ajustado por los intereses devengados, otros conceptos financiados, los cobros de principal e intereses, así como por las quitas y condonaciones, bonificaciones y descuentos que se hayan otorgado, y en su caso los ingresos o gastos financieros por devengar.

Para la determinación de la tasa de interés efectiva del nuevo crédito, consecuencia de la reestructura o la renovación parcial, se toma de base el resultado sumar al monto financiado se le adicionan los costos de transacción incurridos y en su caso las comisiones cobradas en por su originación y el resultado se toma de base para aplicar la tasa de interés efectiva original. Los costos de transacción y comisiones cobradas se reconocen como un cargo o crédito diferido, respectivamente, y se amortizan durante la vida remanente del crédito.

En el caso de renovaciones totales, el Banco considera que existe un nuevo crédito, por

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 23 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

lo que da de baja el crédito original.

(Continúa)

Nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito

La cartera de crédito es evaluada periódicamente a efecto de determinar el riesgo de crédito, el cual representa la pérdida potencial por la falta de pago de un acreditado o contraparte en las operaciones que efectúa el Banco, incluyendo las garantías reales o personales que les otorguen, así como cualquier otro mecanismo de mitigación utilizado por las entidades. El nivel de riesgo de crédito de la cartera de crédito se clasifica por etapas que son, en orden ascendente en su nivel de riesgo, Etapa 1, Etapa 2 y Etapa 3.

Etapa 1

Se refiere a cartera de crédito cuyo riesgo de crédito no se ha incrementado significativamente desde su reconocimiento inicial hasta la fecha de los estados financieros consolidados, es decir que no se encuentra en los supuestos para considerarse en las Etapas 2 y 3 que se mencionan posteriormente.

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 1:

Sobre créditos de consumo no revolvente (para adquisición de bienes de consumo duradero o ABCD, Auto, Nómina, Personal y Otros), cuando presentan hasta un mes de atraso.

Para tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presenta hasta un impago en los periodos 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 periodo representa al menos el 5% de la amortización pactada.

En el caso de cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos menores o iguales a 30 días naturales o un mes calendario.

Etapa 2

Incluye créditos que han mostrado un incremento significativo de riesgo desde su reconocimiento inicial y hasta la fecha de los estados financieros consolidados conforme a los modelos de cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios (ver nota 3p).

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 2:

Para créditos de consumo no revolvente, cuando presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses.

En el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 24 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

uno y hasta tres impagos en períodos consecutivos inmediatos anteriores.
Cartera de crédito hipotecaria y de vivienda, si presentan atrasos de más de un mes y hasta tres meses, incluyendo los clasificados como REA.
Cartera de crédito comercial, cuando presenta atrasos mayores a 30 días naturales o un mes calendario y menores a 90 días naturales tres meses calendario.

(Continúa)

Los créditos que estando en Etapa 2 han liquidado totalmente los saldos exigibles pendientes de pago, o que habiendo sido reestructurados o renovados han cumplido con el pago sostenido, son reclasificados a Etapa 1.

Etapa 3

Corresponde a la cartera de crédito con deterioro crediticio originado por la ocurrencia de uno o más de los eventos, los cuales tienen un impacto significativo sobre los flujos de efectivo futuros de dichos créditos. En específico, se consideran los créditos en esta etapa los que se muestran a continuación:

Aquéllos por los que el Banco tiene conocimiento de que el acreditado ha sido declarado en concurso mercantil.

Sin perjuicio de lo previsto previamente, los créditos que continúan recibiendo pago en términos de lo previsto por la fracción VIII del artículo 43 de la Ley de Concursos Mercantiles (LCM), así como los créditos otorgados al amparo del artículo 75 en relación con las fracciones II y III del artículo 224 de la citada Ley, son traspasados a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 cuando incurren en los supuestos previstos por el numeral 2 siguiente.

Tratándose de créditos de consumo no revolventes y créditos a la vivienda, que han sido pagados parcialmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Créditos distintos a los mencionados en el numeral anterior, cuyas amortizaciones no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente, cuando los vencimientos de sus adeudos son como sigue:

Créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento, cuando presentan 30 días naturales o más de vencidos en capital e interés.

Créditos con pago único de principal al vencimiento y con pagos periódicos de intereses, si presentan 90 días naturales o más de vencidos en interés o 30 días naturales o más de vencidos en capital.

Pagos periódicos parciales de principal e interés, cuando presentan 90 días naturales o más de vencidos en capital o interés.

Documentos de cobro inmediato referidos en la política contable de "Efectivo y equivalentes de efectivo", al momento en que no han sido cobrados.

(Continúa)

Créditos adquiridos al INFONAVIT, conforme a la modalidad de pago REA o ROA, y créditos destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda, cuando sus amortizaciones o

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

pagos, respectivamente, no han sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presentan 90 días naturales o más de vencidos.

El traspaso a cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3 de los créditos a que se refiere el numeral 5 del párrafo anterior se sujeta al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

los recursos del crédito son dispuestos para el fin con que fueron otorgados; el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho período representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones mencionadas anteriormente no se consideran excluyentes entre sí.

Para créditos de consumo en los que las condiciones de pago establecidas en el contrato establecen pagos con periodicidad menor a un mes calendario, el Banco considera las siguientes equivalencias:

Periodicidad de pago
contractualEquivalencia
30 días90 días

Quincenal2 quincenasMás de 6 quincenas
Catorcenal2 catorcenasMás de 6 catorcenas
Decenal3 decenasMás de 9 decenas
Semanal4 semanasMás de 13 semanas

Adicionalmente, en atención a lo establecido en las Disposiciones para la determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios, el Banco considera los siguientes criterios para definir cuando los créditos se encuentran en Etapa 3:

Para créditos de consumo no revolvente cuando presenta atrasos mayores a tres meses. Sobre tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, cuando presentan más de tres impagos en 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, son reclasificados a Etapa 1, excepto los créditos reestructurados y/o renovados.

(Continúa)

Efecto de renegociaciones en el nivel de riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito Etapa 2 o Etapa 3 que se reestructuren o se renueven

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 26 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

no se reclasifican a una etapa con menor riesgo de crédito por efecto de su reestructura o renovación, en tanto no exista evidencia de pago sostenido.

Los créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, que se reestructuren durante su plazo o se renueven en cualquier momento, son traspasados a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, y permanecen en dicha etapa hasta que existe evidencia de pago sostenido.

Las líneas de crédito dispuestas, que se han reestructurado o renovado en cualquier momento, se traspasan a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito, excepto cuando se cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del acreditado y se ha cumplido lo siguiente:

se ha liquidado la totalidad de los intereses exigibles, y
se ha cubierto la totalidad de los pagos a que esté obligado en términos del contrato a la fecha de la reestructuración o renovación.

Tratándose de disposiciones de crédito hechas al amparo de una línea de crédito, cuando se reestructuran o renuevan en forma independiente de dicha línea, son evaluadas de conformidad con las reglas para reestructuraciones y renovaciones aplicables antes descritas, atendiendo a las características y condiciones de la disposición o disposiciones reestructuradas o renovadas.

Si posterior a la evaluación descrita en el párrafo anterior se concluye que una o más disposiciones otorgadas al amparo de una línea de crédito deben traspasarse a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito por efecto de dicha reestructura o renovación y tales disposiciones, de manera individual o en su conjunto, representan al menos 25% del total del saldo dispuesto de la línea de crédito al a fecha de la reestructura o renovación, el saldo total dispuesto, así como sus disposiciones posteriores, son traspasadas a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, distintos de créditos referentes a i) créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia que los intereses se paguen periódicamente, ii) líneas de crédito dispuestas, y iii) disposiciones de crédito hechas al amparo de líneas de crédito, que se han reestructurado o renovado de los que no ha transcurrido al menos el 80% del plazo original del crédito, se mantienen en la misma categoría únicamente si cumplen con lo siguiente:

el acreditado ha cubierto la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación ó reestructuración, y
el acreditado ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto.

Sobre el mismo tipo de créditos mencionados en el párrafo anterior, con riesgo de crédito en Etapa 1 y Etapa 2, pero que han sido reestructurados o renovados durante el transcurso del 20% final del plazo original del crédito, son traspasados a la categoría inmediata siguiente, con mayor riesgo de crédito, excepto si cumplen con lo que se muestra en la hoja siguiente.

(Continúa)

se ha liquidado la totalidad de los intereses devengados a la fecha de la renovación o reestructuración;

se ha cubierto el principal del monto original del crédito, que a la fecha de la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 27 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

renovación ó reestructuración debió haber sido cubierto, y se ha cubierto el 60% del monto original del crédito.

Si no se cumplen todas las condiciones descritas en los dos párrafos anteriores, según corresponda, el crédito se traspasa a la categoría inmediata siguiente con mayor riesgo de crédito desde el momento en que se reestructura o 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 período de pago en curso y 90 días.

Los créditos con riesgo de crédito en Etapa 1 o Etapa 2 que se reestructuren o renueven en más de una ocasión, son traspasados a cartera con riesgo de crédito en Etapa 3, excepto cuando el Banco cuenta con elementos que justifican la capacidad de pago del deudor. En el caso de cartera comercial, tales elementos son debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

Cuando se consolidan diversos créditos otorgados por el Banco a un mismo acreditado mediante una reestructura o renovación, se analiza cada uno de los créditos consolidados como si se reestructuraran o renovaran por separado y, si se concluye que uno o más de dichos créditos se habría traspasado a cartera con riesgo de crédito en Etapa 2 o Etapa 3 por la propia reestructura o renovación, el saldo total del crédito consolidado es traspasado a la categoría que correspondería al crédito objeto de consolidación con mayor riesgo de crédito.

Los créditos clasificados en el nivel de riesgo de crédito Etapa 2 por efecto de una reestructura son evaluados periódicamente a fin de determinar si existe un incremento en su riesgo que origine que deben ser traspasados a la Etapa de riesgo de crédito 3, conforme a lo descrito en el primer párrafo de la subsección "Etapa 3" de esta nota.

Los créditos no son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, por efecto de su reestructuración, si a la fecha de o la operación presentan cumplimiento de pago por el monto total exigible de principal e intereses y únicamente modifiquen una o varias de las condiciones originales del crédito mencionados a continuación, no se reclasificarán al rubro de "Etapa 3".

Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.

Tasa de interés: cuando se mejora al acreditado la tasa de interés pactada.

Moneda o unidad de cuenta: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda o unidad de cuenta.

Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago permite la omisión de pago en período alguno.

Ampliación de la línea de crédito: sólo en el caso de créditos de consumo otorgados mediante líneas de crédito revolventes.

(Continúa)

Pago sostenido del crédito.

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado cubre el monto total

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

exigible de principal e intereses sin retraso, conforme a lo siguiente:

Cuando se trata de amortizaciones menores o iguales a 60 días, se cubre un mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito.

Para créditos con períodos de entre 61 y 90 días naturales, se realiza el pago de dos amortizaciones.

En el caso de créditos con amortizaciones que cubran períodos mayores a 90 días naturales, se realiza el pago de una amortización.

Cuando los períodos de amortización pactados en la reestructura o renovación no son homogéneos, se considera el número de períodos que representan el plazo más extenso, conforme a lo descrito previamente.

Para reestructuras en las que se modifica la periodicidad del pago a períodos menores, para la determinación de si existe pago sostenido, se considera el número de amortizaciones que correspondería al esquema original del crédito.

En los casos de los créditos adquiridos al INFONAVIT, el Banco está obligado a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan el traspaso a cartera con riesgo Etapa 2 o Etapa 3, para determinar las amortizaciones requeridas para la existencia de pago sostenido, se considera el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalgan al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando ocurra alguno de los siguientes supuestos:

El acreditado ha cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura ó renovación, o bien,
Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo.

Los créditos que se reestructuran o renuevan en más de una ocasión, que se ha pactado con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, acreditarán pago sostenido del crédito cuando:

El acreditado cubre al menos el 20% del principal pendiente de pago a la fecha de la nueva reestructura o renovación;

(Continúa)

Se ha cubierto el importe de los intereses devengados conforme al nuevo esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días y ha transcurrido al menos dicho plazo, y

La entidad cuenta con elementos que justifiquen la capacidad de pago del deudor. En el caso de créditos comerciales, tales elementos están debidamente documentados e integrados al expediente del crédito.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados, distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de

que los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido. Tal es el caso de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a los períodos requeridos conforme al primer párrafo de esta subsección.

Los créditos que por efecto de una reestructura o renovación son traspasados a una categoría con mayor riesgo de crédito, en todos los casos permanecen un mínimo de tres meses en dicha etapa hasta acreditar pago sostenido. Se deberá de acreditar el pago sostenido en cada etapa de riesgo de crédito y en consecuencia ser traspasados a la etapa inmediata siguiente con menor riesgo de crédito. Lo anterior con excepción de los créditos con pago de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, en los que se aplica lo descrito previamente para estos casos.

En todo caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de 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:

probabilidad de incumplimiento intrínseca del acreditado,
las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
la prelación de pago frente a otros acreedores y,
la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reconocimiento de ingresos, costos y gastos

El interés efectivo determinado mediante la aplicación de la tasa de interés efectiva se reconoce conforme se devenga. El interés efectivo incluye el devengamiento de los intereses de cartera y la amortización de comisiones por el otorgamiento de crédito, ambos presentados en el rubro de "Ingresos por intereses", así como la amortización de los costos de transacción por el otorgamiento de crédito presentada en el rubro de "Gastos por intereses".

Para determinar la tasa de interés efectiva, el Banco realiza lo siguiente:

Determina el monto de los flujos de efectivo futuros estimados a recibir. Consiste en sumar el principal y los intereses que se recibirán conforme al esquema de pagos del crédito, durante el plazo contractual, o en un plazo menor si es que existe una probabilidad de pago antes de la fecha de vencimiento u otra circunstancia que justifique la utilización de un plazo menor, para lo cual el Banco documenta la evidencia correspondiente.

(Continúa)

Determinar el interés efectivo. Es el resultado de restar a los flujos de efectivo futuros estimados a recibir, el monto neto financiado determinado como se describe en el numeral 1 del segundo párrafo de esta nota.

Determinar la tasa de interés efectiva. Representa la relación entre el interés efectivo y el monto neto financiado.

Cuando conforme a los términos del contrato, la tasa de interés se modifica periódicamente, la tasa de interés efectiva calculada al inicio del período, es la que se utiliza durante toda la vida del crédito, es decir, no se determina nuevamente para cada período.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 30 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Existe la presunción de que los flujos de efectivo futuros y la vida esperada del crédito pueden ser confiablemente estimados, lo que sucede en la mayoría de las circunstancias; sin embargo, en aquellos casos en los que no sea posible estimar confiablemente los flujos de efectivo futuros o la vida estimada del o de los créditos, el Banco utiliza los flujos de efectivo contractuales documentando las circunstancias y hechos que llevaron a dicha conclusión, previa autorización del Comité de Crédito.

Las comisiones y costos de transacción se amortizan contra los resultados del ejercicio por el período correspondiente al plazo de la línea de crédito asociada. Si la línea de crédito se cancela, el saldo pendiente por amortizar se reconoce totalmente en resultados.

Las comisiones reconocidas con posterioridad al otorgamiento de crédito que se generan como parte del mantenimiento de dichos créditos, así como las que se cobran con motivo de créditos no colocados, se reconocen contra los resultados del ejercicio conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por concepto de anualidad de tarjeta de crédito se reconocen inicialmente como un crédito diferido y se amortizan en un período de 12 meses contra los resultados del ejercicio, en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Programa de lealtad de tarjetas de crédito

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

(Continúa)

Criterios contables especiales derivado de las inundaciones y daños ocasionados por el Huracán "OTIS".

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

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

Créditos a la vivienda con garantía hipotecaria.

Créditos revolventes y no revolventes, dirigidos a personas físicas (automotriz, personales, nómina, tarjeta de crédito y microcréditos).

Créditos comerciales para personas morales y personas físicas con actividad empresarial (PYME).

Fideicomisos en carácter de deudor de la banca.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 31 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Microcréditos individuales o grupales.

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

Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento",
Créditos con "pagos periódicos de principal e intereses" y,
Créditos que desde su inicio se estipule su carácter de revolventes,

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

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

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

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

(Continúa)

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

Partidas diferidas

Se integra por el monto neto entre costos de transacción y comisiones por otorgamiento de crédito.

Estimación preventiva para riesgos crediticios

La determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios de cada categoría de la cartera de crédito se realiza con base en las metodologías generales establecidas en las Disposiciones, las cuales se basan en el enfoque de Pérdida Esperada, que se determina multiplicando la Probabilidad de Incumplimiento (PI) por el producto de la Severidad de la Pérdida en caso de Incumplimiento (SP) y la Exposición al Incumplimiento (EI).

Tratándose de líneas de crédito comprometidas no dispuestas, el Banco reconoce la estimación correspondiente al saldo no dispuesto conforme a las Disposiciones, lo cual también es aplicable a las cartas de crédito que el Banco ha emitido.

La PI es la probabilidad expresada como porcentaje de que ocurra cualquiera o ambas de las siguientes circunstancias con relación a un deudor específico y determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones:

El deudor se encuentra en situación de mora durante 90 días naturales o más respecto a cualquier obligación crediticia frente a la Institución, o bien dicha obligación

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

crediticia cumple con los supuestos para ser clasificada con riesgo de crédito Etapa 3, descritos anteriormente (ver nota 31).

Se considera probable que el deudor no abone la totalidad de sus obligaciones crediticias frente al Banco.

La SP en caso de Incumplimiento corresponde a la intensidad de la pérdida en caso de incumplimiento expresada como porcentaje de la EI, una vez tomados en cuenta el valor de las garantías y los costos asociados a los procesos de realización (judiciales, administrativos de cobranza y de escrituración, entre otros); es determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

La EI es la posición esperada, bruta de reservas, de la operación de crédito si se produce el incumplimiento del deudor. La EI no puede ser inferior a la cantidad dispuesta de la operación al momento del cálculo del requerimiento de reservas ni de capital; se determinada conforme a la metodología estándar contenida en las Disposiciones.

(Continúa)

En su caso, el Banco determina o reconoce las estimaciones adicionales, las cuales se constituyen para cubrir riesgos que no se encuentran previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia, y sobre las que previo a su constitución, el Banco informa a la Comisión sobre lo siguiente:

origen de las estimaciones;
metodología para su determinación;
monto de estimaciones por constituir, y
tiempo que se estima serán necesarias.

Sobre los créditos con riesgo de crédito en Etapa 3, en los que en su reestructuración se acuerda la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, el Banco reconoce una estimación por el 100% de dichos intereses, la cual cancela cuando existe evidencia de pago sostenido.

Cartera de crédito comercial

El cálculo de la estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito comercial se realiza conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos, así como su clasificación previa en cinco diferentes grupos, según a quienes se han otorgado:

Entidades federativas y municipios.

Proyectos con fuente de pago propia.

Fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, no incluidos en la fracción anterior, así como esquemas de crédito comúnmente conocidos como "estructurados".

Entidades financieras.

Personas morales no incluidas en las fracciones anteriores y físicas con actividad empresarial que, a su vez, se divide en los siguientes subgrupos:

Con ingresos netos o ventas netas anuales menores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 33 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Con ingresos netos o ventas netas anuales iguales o mayores al equivalente en moneda nacional a 14 millones de UDIs.

Para el cálculo de la PI de los créditos comerciales se realiza de acuerdo con las Disposiciones, conforme a cada uno de los grupos descritos anteriormente, que consiste en evaluar factores cuantitativos y cualitativos del acreditado y asignarles un puntaje crediticio, el cual es totalizado y utilizado para calcular la PI.

(Continúa)

Para el cálculo de la SP, si los créditos carecen de cobertura de garantías reales, personales o derivados de crédito, se determina conforme a los meses transcurridos de atraso, dependiendo del grupo al que pertenecen, y considerando si son o no créditos subordinados o sindicados en los que el Banco es subordinado respecto de otros acreedores; asimismo, se considera la determinación de la SP mediante un cálculo diferenciado para los créditos de acreditados que han sido declaradas en concurso mercantil. En caso de que los créditos cuenten con garantías reales, garantías personales y seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación de la SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito. Para la cartera de crédito que cuenta con el beneficio de un esquema de cobertura de paso y medida, el cálculo de la SP considera dicha cobertura.

La EI, en el caso de líneas crédito no comprometidas que son cancelables incondicionalmente o que permiten la cancelación automática en cualquier momento y sin previo aviso del Banco, corresponde al saldo insoluto del crédito. Para líneas de crédito distintas a las mencionadas anteriormente, la determinación de la EI se realiza conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Cartera hipotecaria y de vivienda

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito hipotecaria de vivienda se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

El cálculo se realiza utilizando las cifras correspondientes al último día de cada mes constituyendo la calificación de reserva en crédito por crédito.

Asimismo, se consideran principalmente, factores tales como: i) monto exigible, ii) pago realizado, iii) valor de la vivienda, iv) saldo del crédito, v) atraso, vi) información proveniente de las sociedades de información crediticia, vii) ROA, viii) REA y ix) prórroga.

En caso de que los créditos cuenten con seguros de crédito, éstos son considerados en la determinación SP con la finalidad de ajustar las reservas preventivas para riesgo de crédito.

El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la PI por la SP y la EI o las diferentes reglas en las Disposiciones.

Cartera de consumo

La estimación preventiva para riesgos crediticios de la cartera de crédito de consumo se determina conforme a la metodología general establecida por la Comisión, que considera inicialmente el nivel de riesgo de crédito en el que están clasificados los créditos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 34 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando principalmente, factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia; así como, viii) antigüedad del acreditado en el Banco y ix) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia. El monto total de la reserva a constituir por cada crédito es el resultado de multiplicar la probabilidad de incumplimiento por la severidad de la pérdida y la exposición al incumplimiento o las diferentes reglas establecidas en las Disposiciones.

(Continúa)

La EI, en el caso de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes, se determina conforme a lo establecido en las Disposiciones.

Adicionalmente, el cálculo de las reservas preventivas correspondientes a la cartera crediticia de consumo no revolvente considera principalmente, lo siguiente: (i) monto exigible, (ii) pago realizado, (iii) atraso, (iv) antigüedad del acreditado en el Banco, (v) antigüedad del acreditado con otras instituciones, (vi) monto a pagar al Banco, (vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, (viii) saldo reportado en las sociedades de información crediticia, (ix) endeudamiento (xi) importe original del crédito, (xii) saldo del crédito y xiii) otras variables provenientes de las sociedades de información crediticia.

Grado de riesgo de la estimación preventiva para riesgos crediticios

Las reservas preventivas constituidas por el Banco son clasificadas conforme a su grado de riesgo, de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación.

Rangos de porcentaje de estimación preventiva para riesgos crediticios

Consumo

Grado de riesgoNo revolventeTarjeta de crédito y otros créditos revolventesHipotecario y de vivienda Comercial
DeADeADeADeA

A-10%	2.0%	3.0%	0.50%	0.90%		
A-22.01%	3.0%	3.01%	5.0%	0.501%	0.75%	0.911.5%
B-13.01%	4.0%	5.01%	6.5%	0.7511.0%	1.512.0%	
B-24.01%	5.0%	6.51%	8.0%	1.0011.5%	2.012.5%	
B-35.01%	6.0%	8.01%	10.0%	1.5012.0%	2.515.0%	
C-16.01%	8.0%	10.01%	15.0%	2.0015.0%	5.0110.0%	
C-28.01%	15.0%	15.01%	35.0%	5.00110.0%	10.0115.5%	
D15.01%	35.0%	35.01%	75.0%	10.00140.0%	15.5145.0%	
E35.01%	100%	75.01%	100%	40.001100%	45.01100%	

Castigos, eliminaciones y recuperaciones de cartera de crédito

El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo con plazos establecidos de 6 y 60 meses, respectivamente que determinan la imposibilidad práctica de recuperación. El castigo se reconoce cancelando el saldo del crédito que determine la Administración, contra la estimación preventiva para riesgo crediticios. Cuando el crédito a castigar excede el monto de la estimación, antes de efectuar el castigo, el Banco reconoce una estimación hasta por el monto de la diferencia.

En todo caso, el Banco cuenta con evidencia de las gestiones formales de cobro que se

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 35 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

han ejercido respecto de estos créditos, así como de los elementos que acreditan la imposibilidad práctica de recuperación del crédito de acuerdo con sus políticas internas establecidas en el manual de crédito.

El Banco podrá optar por eliminar de su activo aquellos créditos con riesgo de crédito etapa 3 que se encuentren provisionados al 100% aun cuando no cumplan con las condiciones para ser castigados. Para tales efectos, el Banco deberá cancelar el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios.

(Continúa)

Cualquier recuperación derivada de créditos previamente, castigados o eliminados es reconocida en los resultados consolidados del ejercicio dentro del rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios", salvo que las recuperaciones provengan de pagos en especie, cuyo tratamiento se realiza conforme a las políticas establecidas para Bienes Adjudicados en la nota 3s.

Los costos y gastos incurridos por la recuperación de cartera de crédito deberán reconocerse como un gasto dentro del rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera

Las quitas sobre el monto perdonado del pago del crédito en forma parcial o total que el Banco realice a los acreditados se realizarán cancelando el saldo insoluto del crédito contra la estimación preventiva para riesgos crediticios asociada al crédito y, si esta es menor al monto perdonado, el Banco previamente constituye estimaciones hasta por el monto de la diferencia.

La cancelación de la estimación preventiva para riesgos crediticios sobre las quitas, condonaciones, bonificaciones y descuentos sobre la cartera, es aplicable a los montos perdonados derivado de incrementos en el riesgo crédito, en caso contrario deberán disminuirse de los ingresos que le dieron origen.

Otras cuentas por cobrar, neto

Las cuentas por cobrar reconocidas en este rubro no tienen interés ya sea explícito o implícito: por lo tanto, incluyen:

cuentas por cobrar de corto plazo; y
otras cuentas por cobrar de corto plazo

No deberán incluirse las cuentas por cobrar derivadas de las operaciones a que se refieren:

los criterios B-3 "Reportos", B-4 "Préstamos de Valores" y B-6 "Cartera de Crédito" emitidos por la Comisión;
las correspondientes a los derechos de cobro definidos en el criterio "B-6"; y
las cuentas por cobrar en el rubro de otras cuentas por cobrar provenientes de operaciones de arrendamiento operativo.

Las otras cuentas por cobrar se integran de las cuentas por cobrar liquidadoras por operaciones de venta de divisas, inversiones en valores, reportos, préstamo de valores, derivados y por emisión de títulos, así como de los deudores de cuentas de margen, deudores por colaterales otorgados en efectivo por operaciones con valores, crédito y derivados realizadas en mercados OTC. Asimismo, incluye los deudores diversos por premios, comisiones y derechos por cobrar sobre operaciones vigentes no crediticias,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 36 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

partidas asociadas a operaciones crediticias, saldos a favor de impuestos acreditables, préstamos y otros adeudos del personal, amortizaciones de arrendamientos operativos no liquidadas y otros deudores.

Las cuentas por cobrar se deben valorar en su reconocimiento inicial al precio de la transacción (la contraprestación a la que el Banco considera tener derecho de cobro a cambio de transferir el control sobre los bienes o servicios a un cliente) en el momento de considerarse devengada la operación que le dio origen, lo cual ocurre cuando, se transfiera el control sobre los bienes o servicios acordados con el cliente a cambio de una contraprestación, en acuerdo con los términos del contrato celebrado.

(Continúa)

Las cuentas por cobrar deben incluir los impuestos y derechos trasladables al cliente y cualquier otro cobro al cliente por cuenta de terceros. El Banco debe reconocer un pasivo por el monto de cobro por cuenta de terceros incluidos en las cuentas por cobrar.

Las cuentas por cobrar denominadas en moneda extranjera se deben reconocer inicialmente en la moneda funcional, utilizando el tipo de cambio histórico; que es aquél con el cual el Banco pudo haber realizado las cuentas por cobrar a la fecha de la transacción.

Las cuentas por cobrar deben valorarse en su reconocimiento posterior al precio de la transacción pendiente de cobro.

Estimación para pérdidas crediticias esperadas

La estimación de pérdidas crediticias esperadas se debe reconocer desde su inicio en las cuentas por cobrar, afectando resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

En su reconocimiento posterior, se deben reconocer los cambios requeridos en la estimación para pérdidas crediticias esperadas por las modificaciones en las expectativas de las pérdidas crediticias esperadas que surjan en cada periodo en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

La estimación para pérdida crediticias esperadas se debe determinar a través del juicio profesional del Banco, considerando la evaluación de las pérdidas esperadas por el deterioro de las cuentas por cobrar, utilizando factores como la experiencia histórica de las pérdidas crediticias, condiciones actuales y pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el flujo de efectivo futuro por recuperar de las cuentas por cobrar.

La estimación para incobrabilidad para cuentas por cobrar comerciales se reconoce desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas.

Desde el reconocimiento inicial, deberá considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que, si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, deberá ajustarse con base en dicho valor presente.

Por lo anterior la Administración del Banco ha desarrollado el procedimiento para el cálculo de pérdida crediticia esperada para constituir dicha estimación basado en la siguiente ecuación:

$$PE = \sum_{i=1}^n EI_{ij} * TP_j$$

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 37 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

(Continúa)

En donde:

PE: Pérdida esperada;

EI_{ij}: Exposición al incumplimiento de la operación i en el grupo de atraso j;

TP_j: Tasa de pérdida del grupo de atraso j;

j: j-ésimo grupo de atraso;

n: El número de operaciones.

La tasa de pérdida se calcula con ayuda del análisis de la proporción de saldo que se ha pagado en cada bucket de atraso, de esta manera, se analiza la concentración del saldo por bucket de atraso y con ello, definir el umbral de deterioro y la asignación del 100% de pérdida.

El Banco puede determinar la pérdida esperada de manera individual para deudores que tienen características particulares, en caso de que sea impráctico, éstos se califican agrupándolos por características homogéneas o comunes.

En este sentido, el Banco ha desarrollado una metodología en donde se determinó impráctico realizar una evaluación individual de las cuentas por cobrar, por lo cual se derivaron de modelos estadísticos desarrollados con datos históricos de las cuentas por cobrar en donde se calificaron y agruparon por características comunes y homogéneas en términos de riesgo en donde basados en elementos clave para la medición de la pérdida esperada crediticia se determinaron las siguientes variables: Tasa de pérdida (TP) y Exposición al incumplimiento (EI).

Para estimar los parámetros y aplicarlos de forma colectiva, los activos que integran las cuentas por cobrar fueron agrupados de acuerdo con los días de atraso que poseen al momento de la estimación del deterioro, asignándoles un grupo de morosidad para lo cual se identificó en el caso particular del Banco, dicho período es de 120 días, conforme al proceso de cobro.

Cuando el Banco considere nula la probabilidad de cobro de una cuenta por cobrar, debe dar de baja el valor neto en libros de la cuenta por cobrar, aplicando la cuenta por cobrar a la estimación para pérdidas crediticias esperadas. Si la estimación fuera insuficiente, debe ajustarse de inmediato afectando los resultados del ejercicio en el rubro "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Las cuentas por cobrar, en su caso, se presentan deducidas de la estimación para pérdidas crediticias esperadas dentro del estado de situación financiera consolidado en el rubro "Otras cuentas por cobrar (neto)".

Otras consideraciones de la estimación de pérdidas crediticias esperadas para otras cuentas por cobrar:

Los sobregiros de cuentas de cheques de clientes que no cuentan con líneas de crédito de sobregiro, se clasifican, al momento de su reconocimiento, como adeudos vencidos y simultáneamente se constituye una estimación por el importe total.

(Continúa)

El Banco no constituye estimación de pérdidas crediticias esperadas por:

Saldos a favor de impuestos,

Impuesto al valor agregado acreditable y

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 38 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Cobros a clientes por cuenta de terceros.

No es objeto de este inciso las cuentas por cobrar con riesgo operacional, que su eliminación se reconoce en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Arrendamientos

Actuando como arrendador

Clasificación de los arrendamientos

El Banco clasifica cada uno de sus arrendamientos como un arrendamiento operativo o financiero. Se consideran como arrendamientos financieros todos los créditos que otorgue la entidad para operaciones de arrendamiento financiero, que son aquéllos en donde el Banco transfiere al arrendatario sustancialmente todos los riesgos y beneficios inherentes a la propiedad del activo subyacente, en caso de contrario se consideran como operativos.

Actuando como arrendatario

Al inicio de un contrato, el Banco evalúa si un contrato es, o contiene, un contrato de arrendamiento. Un contrato es, o contiene, un arrendamiento si el contrato transmite el derecho de controlar el uso de un activo identificado por un periodo 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.

(Continúa)

El pasivo por arrendamiento se mide inicialmente al valor presente de los pagos de arrendamiento que no se pagan en la fecha de inicio, descontados utilizando la tasa de interés implícita en el arrendamiento o, si esa tasa no puede determinarse fácilmente, la tasa incremental de financiamiento del Banco o la tasa libre de riesgo determinada con referencia al plazo del arrendamiento. Generalmente, el Banco usa su tasa de interés incremental como tasa de descuento.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 39 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

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 valorar bajo las siguientes condiciones:

hay un cambio en los pagos de arrendamiento futuros que surgen de un cambio en un índice o tasa;
hay un cambio en la estimación del Banco, del monto que se espera pagar bajo una garantía de valor residual; si el Banco cambia su evaluación de si ejercerá una opción de compra, extensión o terminación o
hay un pago en sustancia fijo de arrendamiento modificado.

Cuando el pasivo por arrendamiento se vuelve a valorar de esta manera, se realiza un ajuste correspondiente al importe en libros del activo por derecho de uso, o se registra en resultados si el importe en libros del activo por derecho de uso se ha reducido a cero.

El Banco presenta activos de derecho de uso que no cumplen con la definición de propiedad de inversión en el rubro "Activos por derecho de uso de propiedades, mobiliario y equipo", y los pasivos por arrendamiento en el rubro "Pasivo por arrendamiento", ambos en el estado de situación financiera consolidado.

Arrendamientos a corto plazo y arrendamientos de activos de bajo valor

El Banco ha decidido no reconocer los activos por derecho de uso y los pasivos por arrendamientos para arrendamientos de activos de bajo valor y arrendamientos a corto plazo, incluidos equipos de TI. El Banco reconoce los pagos de arrendamiento asociados con estos arrendamientos como un gasto en línea recta durante el plazo del arrendamiento.

(Continúa)

Bienes adjudicados

Los bienes adjudicados o recibidos mediante dación en pago que no son destinados para uso del Banco, se reconocen en la fecha que causa ejecutoria el auto de aprobación del remate mediante el cual se decreta la adjudicación, o tratándose de bienes recibidos mediante dación en pago, en la fecha que se firma la escritura de dación, o se haya formalizado la transmisión de propiedad del bien.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 40 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

El reconocimiento de bienes adjudicados se realiza como sigue:

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación, es decir, sin deducir la estimación preventiva para riesgos crediticios que se haya reconocido hasta esa fecha, y el valor neto de realización de los activos recibidos, cuando la intención de la entidad es vender dichos activos para recuperar el monto a cobrar; o

al menor entre el valor bruto en libros del activo que dio origen a la adjudicación o el valor razonable del activo recibido, cuando la intención de la entidad es utilizar el activo adjudicado para sus actividades.

En la fecha de registro del bien adjudicado o recibido mediante dación en pago, el valor del activo que dio origen a la adjudicación, así como su respectiva estimación preventiva para riesgos crediticios que se tuviera constituida, se dan de baja del estado de situación financiera consolidado por el total del activo neto de la estimación, deducido de los pagos parciales en especie en caso de cartera de crédito, o de los cobros o recuperaciones cuando se trata de derechos de cobro.

La diferencia entre el valor del activo que dio origen a la adjudicación, neto de estimaciones, y el valor del bien adjudicado determinado conforme a lo descrito en el segundo párrafo de esta nota, se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Valuación de bienes adjudicados

Los bienes adjudicados se valúan conforme al tipo de bien que se trate, registrando su valuación contra los resultados del ejercicio como "Otros ingresos (egresos) de la operación".

El Banco reconoce una estimación de deterioro por las pérdidas de valor por el paso del tiempo conforme a las disposiciones, reconociéndolo en resultados como "Otros ingresos (egresos) de la operación". La determinación de las reservas por tenencia de bienes muebles o inmuebles, adjudicados o recibidos en dación en pago por el transcurso del tiempo, se determina, conforme a lo que se muestra en la tabla de la hoja siguiente.

(Continúa)

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%10%

Más de 12 y hasta 18 20%20%

Más de 18 y hasta 24 45%45%

Más de 24 y hasta 30 60%60%

Más de 30 y hasta 36 100%100%

Más de 36 y hasta 42 100%100%

Más de 42 y hasta 48 100%100%

Más de 48 y hasta 54 100%100%

Más de 54 y hasta 60 100%100%

Más de 60 100%100%

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 41 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

directamente en los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos (egresos) de la operación".

Traspaso de bienes adjudicados para uso propio del Banco

Cuando el Banco opta por traspasar los bienes adjudicados para uso propio, el traspaso se realiza al rubro del estado de situación financiera consolidado que le corresponda según el activo de que se trate, cumpliendo con el hecho de que los bienes son utilizados para la realización de su objeto y se efectúe de acuerdo con sus estrategias de inversión y fines que se encuentran previamente establecidos en sus manuales, no existiendo la posibilidad de que dichos bienes vuelvan a considerarse como adjudicados.

Propiedades, mobiliario y equipo, neto

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

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

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

(Continúa)

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

Inversiones permanentes

Las inversiones permanentes en las que el Banco tiene influencia significativa o control se valúan utilizando el método de participación, a través del cual se reconoce la participación en los resultados y en el capital contable de estas entidades utilizando los estados financieros a la misma fecha y por el mismo período que el Banco. Se considera que una empresa es subsidiaria del Banco, cuando se tiene el poder de dirigir sus actividades relevantes, está expuesta o tiene derecho, a rendimientos variables procedentes de esa participación y tiene la capacidad presente de afectar esos rendimientos a través de su poder sobre ésta.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 42 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Activos de larga duración disponibles para su venta

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

El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta. Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.

Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que la entidad celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del período de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control de la entidad y existen evidencias suficientes de que la entidad se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

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

(Continúa)

Deterioro de activos de larga duración

El Banco evalúa periódicamente el valor neto en libros de los activos de larga duración para determinar la existencia de indicios de que dicho valor excede su valor de recuperación. El valor de recuperación representa el monto de los ingresos netos potenciales que se espera razonablemente obtener como consecuencia de la utilización o realización de dichos activos.

Si se determina que el valor neto en libros excede el valor de recuperación, el Banco registra las estimaciones necesarias. Cuando se tiene la intención de vender los activos, éstos se presentan en los estados financieros consolidados a su valor neto en libros o de realización, el menor. Los activos y pasivos de un grupo clasificado como disponible para la venta se presentan por separado en el estado de situación financiera consolidado.

Pagos anticipados y otros activos, neto

Los pagos anticipados representan aquellas erogaciones efectuadas por el Banco en donde no han sido transferidos los beneficios y riesgos inherentes a los bienes que está por adquirir o a los servicios que está por recibir. Los pagos anticipados se reconocen como un activo por el monto pagado, siempre que sea probable que los beneficios económicos futuros que estén asociados con tales pagos fluyan hacia el Banco.

Una vez recibidos los bienes y/o servicios, relativos a los pagos anticipados, estos se reconocen como un activo o como un gasto en el estado consolidado de resultado

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 43 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

integral, según sea la naturaleza respectiva.

Los pagos anticipados y otros activos incluyen erogaciones realizadas principalmente por gastos de licencias y anticipo de PTU. Al 31 de diciembre de 2023 y 2022, el monto asciende a \$2,568 y \$2,973, respectivamente.

Impuestos a la utilidad y participación de los trabajadores en la utilidad (PTU)

El impuesto a la utilidad y la PTU causados en el año, se determinan conforme a las disposiciones fiscales y legales vigentes.

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

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

El activo por PTU diferida se reconoce en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto", en tanto que la PTU causada se reconoce en el rubro de "Pasivo por beneficios a los empleados" en el estado de situación financiera consolidado.

(Continúa)

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

Los impuestos a la utilidad causados y diferidos se presentan y clasifican en los resultados del período, excepto aquellos que se originan de una transacción que se reconoce en los ORI. La PTU causada y diferida se incorporará dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción" en el estado consolidado de resultado integral.

Activos intangibles

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

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

Captación tradicional

Este rubro comprende los depósitos de exigibilidad inmediata, los depósitos a plazo del

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 44 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

público en general y los captados a través de operaciones en el mercado de dinero, los títulos de crédito emitidos y la cuenta global de captación sin movimientos en moneda nacional, extranjera o UDIS, mismos que se integran como se describe a continuación:

Depósitos de exigibilidad inmediata. Incluyen a las cuentas de cheques, cuentas de ahorro, a los depósitos en cuenta corriente, entre otros.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes del Banco, que no cuentan con una línea de crédito para tales efectos, se clasifican como adeudos vencidos en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" y el Banco constituye simultáneamente a dicha clasificación una pérdida crediticia esperada por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

Depósitos a plazo. Incluyen, entre otros, a los certificados de depósito retirables en días preestablecidos, aceptaciones bancarias y pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento captados del público en general y a través de operaciones en el mercado de dinero, estos últimos referidos a depósitos a plazo realizados con otros intermediarios financieros, así como con tesorerías de empresas y de entidades gubernamentales.

Títulos de crédito. Se integran de, entre otros, los bonos bancarios y los certificados bursátiles.

Cuenta global de captación sin movimientos. Incluye el principal y los intereses de los instrumentos de captación que no tengan fecha de vencimiento, o bien, que teniéndola se renueven en forma automática, así como las transferencias o las inversiones vencidas y no reclamadas.

(Continúa)

Si en el transcurso de tres años contados a partir de que los recursos se depositen en la cuenta global de captación sin movimientos, cuyo importe no exceda por cuenta, al equivalente de trescientas unidades de medida y actualización (UMAS), prescribirán en favor del patrimonio de la beneficencia pública, El Banco estará obligado a enterar los recursos correspondientes a la beneficencia pública dentro de un plazo máximo de quince días contados a partir del 31 de diciembre del año en que se cumpla el supuesto previsto anteriormente descrito.

Los títulos colocados a descuento que no devenguen intereses (cupón cero), se registran al momento de la emisión tomando como base el monto de efectivo recibido.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva con base en lo establecido en la NIF C-19 "Instrumentos Financieros por Pagar (IFP)" y evaluar si la tasa determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso. Sólo en caso de que la tasa de interés de mercado sea sustancialmente distinta a la tasa efectiva, debe utilizarse la tasa de mercado como la tasa de interés efectiva en la valuación del instrumento, reconociendo en la utilidad o pérdida neta los efectos que se produzcan en el valor del IFP por el cambio de tasa de interés.

Los intereses de captación tradicional se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos de emisión, así como el descuento o premio en la colocación se reconocen como parte del pasivo que le dio origen, según se trate, el cual es amortizado en resultados conforme se devengue como gastos o ingresos por intereses, según corresponda, tomando en consideración el plazo del título que le dio origen en

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 45 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

proporción al vencimiento de los títulos.

Obligaciones subordinadas en circulación

Por las obligaciones subordinadas en circulación que reúnen las características establecidas por la NIF C-12 "Instrumentos financieros con características de pasivo y de capital", el instrumento es clasificado como pasivo dentro del estado de situación financiera consolidado. Los intereses se reconocen conforme al método de interés efectivo en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses".

Los gastos que se incurran para emitir un instrumento financiero que califica como un pasivo deben deducirse del monto del pasivo y deben considerarse para determinar la tasa de interés efectiva.

Préstamos interbancarios y de otros organismos

En este rubro se registran los préstamos directos de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento. Asimismo, incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(Continúa)

Los préstamos deberán reconocerse inicialmente al precio de la transacción, deben sumarse o restarse los costos de transacción, así como otras partidas pagadas por anticipado, tales como comisiones e intereses, el Banco deberá determinar el valor futuro de los flujos de efectivo estimados que se pagarán por principal e intereses contractuales, durante el plazo remanente del préstamo o en un plazo menor, si es que existe una probabilidad de prepago u otra circunstancia que requiera utilizar un plazo menor.

El Banco deberá determinar la tasa de interés efectiva, para el cálculo el Banco debe estimar los flujos de efectivo esperados considerando todos los términos contractuales del IFP (tales como prepago, extensión, reembolso anticipado y otras opciones similares), adicionalmente, debe evaluar si la tasa de interés efectiva determinada se encuentra dentro del mercado, comparándola con una tasa de interés que considere el valor del dinero en el tiempo y los riesgos inherentes de pago para financiamientos similares, a los que tenga acceso la entidad.

Si el Banco recibe un préstamo con una tasa de interés contractual que esté sustancialmente fuera de mercado, pero se paga una comisión por adelantado al inicio del crédito al determinar la tasa de interés efectiva con base en los anteriores párrafos, y debe tomarse en cuenta dicha comisión.

Acreedores diversos y otras cuentas por pagar

Los acreedores diversos y otras cuentas por pagar incluyen el pasivo por beneficios a los empleados de corto y largo plazo, provisiones y otras cuentas por pagar por la prestación de servicios bancarios comisiones por pagar, acreedores por adquisición de activos, dividendos por pagar, IVA trasladado y otros impuestos y derechos por pagar.

Los pasivos del Banco se valúan y reconocen en el estado de situación financiera consolidado, para tal efecto deberán cumplir con la característica de ser una

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 46 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

obligación presente, donde la transferencia de activos o presentación de servicios sea virtualmente ineludible, surja como consecuencia de un evento pasado y su cuantía y vencimiento se encuentran claramente establecidos.

El Banco reconoce una provisión cuando su cuantía o vencimientos son inciertos y se cumplen las siguientes condiciones: a) existe una obligación presente resultante de un evento pasado a cargo de la entidad, b) es probable que se presente la salida de recursos económicos como medio para liquidar dicha obligación y c) la obligación puede ser estimada razonablemente.

De no cumplirse las condiciones antes mencionadas, no se reconoce una provisión.

Beneficios a los empleados

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que devengan los servicios prestados. Se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

(Continúa)

Beneficios directos a largo plazo

La obligación neta del Banco en relación con los beneficios directos a largo plazo (excepto por PTU diferida- ver inciso (y) de esa nota y que se espera que el Banco pague después de los doce meses de la fecha del estado de situación financiera consolidado más reciente que se presenta, es la cantidad de beneficios futuros que los empleados han obtenido a cambio de su servicio en el ejercicio actual y en los anteriores. Este beneficio se descuenta para determinar su valor presente. Las 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

La obligación neta del Banco correspondiente a los planes de beneficios definidos por planes de pensiones y prima de antigüedad, se calcula de forma separada para cada plan, estimando el monto de los beneficios futuros que los empleados han ganado en el ejercicio actual y en ejercicios anteriores, descontando dicho monto y deduciendo al mismo, el valor razonable de los activos del plan. El Banco mantiene un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocen directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción". Las contribuciones pagadas por anticipado se reconocen como un activo en la medida en que el pago por anticipado de lugar a una reducción en los pagos a efectuar en el futuro o a un reembolso en efectivo (nota 21).

Planes de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

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

(Continúa)

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

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

Las remediciones (antes ganancias y pérdidas actuariales), resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable.

Reconocimiento de ingresos

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan.

Los intereses devengados sobre cartera en Etapa 3 se reconocen en resultados hasta que se cobran.

Los intereses y comisiones cobradas por anticipado se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a resultados conforme se devengan.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial de un crédito se registran como un

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 48 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio como un ingreso por intereses durante la vida del crédito. Las comisiones por anualidad y renovación de productos de cartera comercial, consumo y vivienda se difieren, según corresponda, asimismo, los costos o gastos vinculados con el otorgamiento de créditos, se reconocen como un cargo diferido y se difieren durante el mismo plazo en el que se reconozcan los ingresos derivados por las comisiones cobradas por el otorgamiento inicial del crédito; el seguro que en su caso sea financiado forma parte de la cartera de crédito.

Las comisiones cobradas por el otorgamiento de crédito se presentan de manera neta de los costos y gastos asociados, presentándose en el rubro de otros activos, o bien de créditos diferidos y cobros anticipados según corresponda su naturaleza deudora o acreedora.

Las comisiones cobradas por reestructuraciones o renovaciones de créditos se adicionan a las comisiones originadas por el otorgamiento del crédito y se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza como un ingreso por intereses bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito. Las demás comisiones se reconocen en el momento en que se generan en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Los intereses por inversiones en títulos de renta fija se reconocen en resultados conforme se devengan conforme al método de interés efectivo. Los intereses cobrados por operaciones de reporto se reconocen en resultados de acuerdo con el método de interés efectivo, a lo largo del plazo de la operación.

(Continúa)

Las comisiones ganadas por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devengan.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes se reconocen en los resultados conforme se devengan.

Concentración de negocio y crédito

Los productos del Banco se comercializan con un gran número de clientes, sin que exista concentración importante en algún cliente específico.

Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que pretende un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regula los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo. De acuerdo con dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400,000 UDIS por persona física o moral. El Banco reconoce en resultados del ejercicio las aportaciones obligatorias al IPAB.

Las aportaciones obligatorias al IPAB se deberán cubrir mensualmente y serán por un monto equivalente a la duodécima parte del cuatro al millar, sobre el promedio mensual de los saldos diarios de sus operaciones pasivas del mes de que se trate.

Cuentas de orden

En las cuentas de orden se registran activos o compromisos que no forman parte del estado de situación financiera consolidado del Banco ya que no se adquieren los derechos de estos o dichos compromisos no se reconocen como pasivo de las entidades en

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 49 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

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.

(Continúa)

Las pérdidas a cargo del Banco por las responsabilidades en que haya incurrido como fiduciario, se reconocen en resultados en el período en el que éstas se conozcan, independientemente del momento en el que se realice cualquier promoción jurídica al efecto.

La unidad fiduciaria mantiene contabilidades especiales por cada contrato en el sistema fiduciario, y registra en las mismas y en su propia contabilidad el dinero y demás bienes, valores o derechos que se les confíen, así como los incrementos o disminuciones, por los productos o gastos respectivos, invariablemente los saldos de las contabilidades especiales de cada contrato de fideicomiso coinciden con los saldos de las cuentas de orden en que el Banco reconoce el patrimonio 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.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 50 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

directamente en los resultados del ejercicio.

Bienes en custodia o en administración:

El efectivo y los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración se reflejan en las cuentas de orden respectivas y son valuados con base en el precio proporcionado por el proveedor de precios. Con excepción del efectivo o los activos virtuales recibidos para el pago de servicios por cuenta de terceros, debiéndose presentar en el rubro de efectivo y equivalentes de efectivo o en el de activos virtuales, según corresponda y, el pasivo que se genere, en el rubro de otras cuentas por pagar.

Los valores en custodia y administración están depositados en la S.D. Indeval, Institución para el Depósito de Valores, S. A. de C. V.

Los ingresos derivados de los servicios de custodia o administración reconocidos en los resultados del ejercicio se presentarán en el rubro de comisiones y tarifas cobradas.

Colaterales recibidos por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos en operaciones de reporto y préstamo de valores actuando el Banco como reportadora o prestataria.

(Continúa)

Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad:

Su saldo representa el total de colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía, cuando el Banco actúe como reportadora o prestataria.

Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito en Etapa 3:

Se registran los intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito Etapa 3.

Otras cuentas de registro:

Se registran principalmente por garantías recibidas por el Banco, entre otros.

Contingencias

Las obligaciones o pérdidas importantes relacionadas con contingencias se reconocen cuando es probable que sus efectos se materialicen y existen elementos razonables para su cuantificación. Si no existen estos elementos razonables, se incluye su revelación en forma cualitativa en las notas a los estados financieros consolidados.

Los ingresos o activos contingentes se deben reconocer en los estados financieros consolidados cuando la incorporación de beneficios económicos se convierta en probable, esto es, hasta el momento en que existe certeza absoluta de su realización.

Cuando se determine que los activos y pasivos contingentes no se tiene certeza razonable de la incorporación de beneficios económicos o de la existencia de una obligación presente, respectivamente, estos no se deben reconocer en los estados financieros consolidados, debido a que su existencia es posible mas no probable. En este caso, se busca revelar estimaciones de los posibles efectos financieros en las notas a los estados financieros.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 51 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Mientras los activos y pasivos mantengan el carácter de contingentes, su control se debe llevar en cuentas de orden.

Reclasificaciones-

Al 31 de diciembre de 2022, el Banco agrupaba en el rubro de "Pagos anticipados y otros activos, neto" dentro del activo, los gastos de emisión y el descuento por colocación de depósitos a plazo de mercado de dinero y de títulos de crédito emitidos para efectos de presentación del estado de situación financiera consolidado. La Administración del Banco decidió reclasificarlas debido a su importancia y naturaleza al rubro de "Captación tradicional". Los efectos de estas reclasificaciones se aplicaron retrospectivamente en el estado de situación financiera consolidado al 31 de diciembre de 2022, de acuerdo con la NIF B-1, Cambios contables y correcciones de errores. Los efectos de las reclasificaciones antes mencionadas, en los rubros del estado de situación financiera consolidado, son como se muestran en la hoja siguiente.

(Continúa)

Concepto Originalmente reportadas Reclasificadas retrospectivamente Cifras después de reclasificaciones

Activo

Pagos anticipados y otros activos, neto\$ 3,116(143)2,973

Pasivo

Depósitos a plazo:

Mercado de dinero 31,238(63)31,175

Títulos de crédito emitidos 11,845(80)11,765

Pronunciamientos normativos emitidos recientemente

Mejoras a las NIF 2024

Durante diciembre de 2023, el CINIF ha promulgado las siguientes Mejoras a las NIF 2024, que contiene modificaciones puntuales a algunas NIF ya existentes.

NIF A-1 Marco Conceptual de las Normas de Información Financiera - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2025, permitiendo su aplicación anticipada a partir de 2024 si se adoptan anticipadamente las revelaciones de las NIF particulares aplicables al tipo de entidad que corresponda. Incluye la definición de entidades de interés público y requiere que se revele si la entidad se considera una entidad de interés público o una entidad que no es de interés público. Divide los requerimientos de revelación de las NIF en: i) revelaciones aplicables a todas las entidades en general (entidades de interés público y entidades que no lo son), y ii) revelaciones adicionales obligatorias solo para las entidades de interés público. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF C-6, Propiedades, planta y equipo - Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2024, permitiendo su aplicación anticipada en 2023. Cualquier cambio que genere debe reconocerse conforme a la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

NIF B-2, Estado de flujos de efectivo/NIF B-6, Estado de situación financiera/ NIF B-17, Determinación del valor razonable/ NIF C-2, Inversión en instrumentos financieros/ NIF C-16, Deterioro de instrumentos financieros por cobrar/ NIF C-20, Instrumentos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 54 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Variable 14,281,770.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/07/202228/07/20275.47544
Tasa Variable 6,085,784.43
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/07/202228/07/20275.47544
Tasa Variable 6,735,722.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202222/09/202711.22 Tasa
Variable 113,074,199.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202222/09/202711.22 Tasa
Variable 4,405,488.19
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202222/09/202711.22 Tasa
Variable 88,109,765.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202215/10/202711.2425
Tasa Variable 128,489,563.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/11/202211/10/202711.2175
Tasa Variable 17,004,215.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/11/202223/10/20265.30478
Tasa Variable 51,178,357.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 4,829,950.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 16,657,937.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/12/202230/11/20279.38 Tasa
Fija 45,578,623.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202218/12/202611.195
Tasa Variable 6,773,089.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/01/202323/01/202510.94 Tasa
Variable 10,003,038.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/02/202313/02/202510.94 Tasa
Variable 14,004,254.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/02/202314/02/202510.94 Tasa
Variable 10,003,038.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202331/03/20285.69544
Tasa Variable 70,814,148.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/05/202314/05/202711.2225
Tasa Variable 803,491.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/06/202331/05/20285.36544
Tasa Variable 14,197,126.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/06/202325/05/20275.36478
Tasa Variable 57,545,099.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/06/202330/03/20285.18367
Tasa Variable 113,792,511.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/06/202315/06/202811.2425
Tasa Variable 31,223,884.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202320/06/202511.15 Tasa
Variable 15,037,166.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202306/07/202810.1 Tasa
Fija 4,016,803.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/07/202322/06/20275.15478
Tasa Variable 35,879,343.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202316/06/202810.99 Tasa
Variable 104,209,810.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/07/202329/06/202810.99 Tasa
Variable 131,468,693.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/08/202301/07/202711.2277
Tasa Variable 3,649,735.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202325/08/20285.25478

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 55 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Variable 92,651,272.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/07/202315/01/202511.1225	
Tasa Variable 223,756.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/08/202331/08/20285.14544	
Tasa Variable 10,799,377.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202315/09/202711.2225	
Tasa Variable 1,349,818.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/09/202329/09/202710.99 Tasa	
Variable 7,502,289.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/10/202329/09/202810.74 Tasa	
Fija 26,387,187.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/10/202302/10/202810.83 Tasa	
Fija 7,257,602.30	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/10/202327/08/202710.84 Tasa	
Variable 31,643,735.84	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/10/202305/10/202611.21 Tasa	
Variable 10,499,321.00	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/10/202319/10/202811.2225	
Tasa Variable 65,577,734.48	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/10/202319/10/202811.2225	
Tasa Variable 6,411,394.57	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/202317/02/202711.0725	
Tasa Variable 33,686,154.37	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/11/202331/10/202811.01 Tasa	
Variable 23,690,571.62	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/11/202319/10/202811.2025	
Tasa Variable 85,179,390.72	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/12/202330/11/20275.87544	
Tasa Variable 13,907,079.71	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/12/202327/12/20289.73 Tasa	
Fija 268,146,726.20	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/01/202417/01/202510.84 Tasa	
Variable 4,781,439.31	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202420/01/202510.84 Tasa	
Variable 4,579,519.53	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/02/202421/01/202510.84 Tasa	
Variable 2,991,449.49	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/02/202413/02/202611.1725	
Tasa Variable 2,134,232.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/02/202419/11/20245.96155	
Tasa Variable 30,238,639.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/02/202423/02/20299.9 Tasa	
Fija 95,637,530.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/02/202421/02/202510.84 Tasa	
Variable 4,941,557.51	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/02/202421/02/202510.84 Tasa	
Variable 5,075,565.85	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/03/202423/01/202510.84 Tasa	
Variable 4,586,832.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202411/03/20295.42 Tasa	
Fija 114,531,348.25	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202406/03/20256.01249	
Tasa Variable 22,321,588.08	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/03/202407/03/20255.928 Tasa	
Variable 26,087,738.05	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/03/202405/12/20245.81153	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 56 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Variable 9,398,642.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/03/202411/03/202610.89 Tasa Variable 10,003,025.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/03/202419/03/202710.69 Tasa Fija 11,694,381.53
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/03/202416/12/20245.62118 Tasa Variable 18,156,335.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/03/202420/12/20245.44353 Tasa Variable 16,499,840.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/03/202427/02/202510.84 Tasa Variable 4,204,511.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/04/202427/03/20255.28317 Tasa Variable 35,466,587.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/04/202403/10/202410.84 Tasa Variable 9,002,710.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/04/202404/10/202413.2285 Tasa Variable 327,428.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/04/202404/10/202410.84 Tasa Variable 10,003,011.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202407/10/202410.84 Tasa Variable 10,003,011.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/04/202404/10/202413.2292 Tasa Variable 2,039,847.88
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202431/03/202610.89 Tasa Variable 9,002,722.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202407/10/202410.84 Tasa Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202407/10/202410.84 Tasa Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/04/202416/01/202510.84 Tasa Variable 5,350,298.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/04/202408/10/202410.84 Tasa Variable 5,482,118.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/04/202401/04/202610.89 Tasa Variable 9,002,722.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/04/202407/10/202413.229 Tasa Variable 42,094.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/04/202403/10/202413.2302 Tasa Variable 6,268,597.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202409/10/202410.84 Tasa Variable 4,001,204.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202402/04/202610.89 Tasa Variable 10,003,025.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/04/202407/10/202413.2302 Tasa Variable 21,775.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/04/202401/04/202610.89 Tasa Variable 10,003,025.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/04/202406/04/202610.89 Tasa Variable 10,003,025.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/04/202410/10/202413.2207 Tasa Variable 3,457,904.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/04/202407/10/202413.2207 Tasa Variable 1,192,643.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/04/202407/04/202610.89 Tasa Variable 14,004,235.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/04/202408/04/202610.89 Tasa Variable 11,003,327.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/04/202414/10/202413.225 Tasa Variable 5,751.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/04/202407/10/202413.225 Tasa Variable 3,315.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/04/202411/10/202413.2265 Tasa Variable 2,295,661.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/04/202410/10/202413.2265 Tasa Variable 1,116,833.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/04/202414/10/202413.2265 Tasa Variable 4,034.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/04/202410/10/202413.2265 Tasa Variable 2,652,460.53

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 57 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO22/04/202404/10/202413.225	Tasa Variable	1,089,250.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO22/04/202414/10/202413.225	Tasa Variable	878,120.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/04/202414/10/202413.225	Tasa Variable	1,026,630.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/04/202421/10/202413.225	Tasa Variable	65,525.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/04/202421/10/202413.225	Tasa Variable	210,696.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/04/202421/10/202413.225	Tasa Variable	43,283.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/04/202421/10/202413.225	Tasa Variable	45,004.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/04/202418/10/202413.225	Tasa Variable	1,599,033.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/04/202422/10/202413.225	Tasa Variable	10,095,124.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/04/202421/10/202413.225	Tasa Variable	299,425.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/04/202417/10/202413.225	Tasa Variable	3,425,978.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/04/202420/01/20255.89201	Tasa Variable	3,984,185.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/04/202418/10/202413.225	Tasa Variable	584,131.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/04/202417/10/202413.225	Tasa Variable	3,169,784.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/04/202425/10/202413.225	Tasa Variable	1,609,264.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/05/202429/10/202413.22	Tasa Variable	1,338.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/05/202429/01/20275.7275	Tasa Variable	39,785,218.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/05/202428/10/202410.84	Tasa Variable	11,003,312.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/05/202417/10/202413.22	Tasa Variable	3,167,205.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/05/202424/10/202413.22	Tasa Variable	1,741,334.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202429/10/202410.84	Tasa Variable	56,835,290.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/05/202424/10/202413.22	Tasa Variable	1,418,215.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202429/04/202911.01	Tasa Variable	166,244,009.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202429/10/202410.84	Tasa Variable	15,004,516.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202430/10/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202430/10/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/05/202430/10/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202430/10/202410.84	Tasa Variable	15,004,516.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/05/202425/10/202413.2166	Tasa Variable	1,142,153.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/05/202429/10/202413.2166	Tasa Variable	124,859.87
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202405/05/202811.23	Tasa Variable	8,673,709.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	95,628,786.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/05/202421/10/202413.22	Tasa Variable	310,553.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202431/10/202410.84	Tasa Variable	15,004,516.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202401/11/202410.84	Tasa Variable	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 58 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202401/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/05/202428/10/202413.22 Tasa Variable 1,308,441.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/05/202401/11/202413.22 Tasa Variable 955,441.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/05/202404/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/05/202429/10/202413.22 Tasa Variable 943.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/05/202404/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/05/202404/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/05/202401/11/202411.0977
Tasa Variable 5,044,699.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/05/202421/10/202413.22 Tasa Variable 11,073.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/05/202408/10/202413.22 Tasa Variable 179,114.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 11,493.46
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/05/202405/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/05/202405/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/05/202405/11/202410.84 Tasa
Variable 500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/05/202404/11/202411.085
Tasa Variable 15,124,706.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 26,999.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 806,512.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 146,159.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 268,484.35
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/05/202405/11/202411.08 Tasa
Variable 15,120,033.33
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/05/202431/10/202410.84 Tasa
Variable 2,336,703.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/05/202431/10/202413.22 Tasa Variable 4,540,492.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 491,770.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202406/11/202411.075
Tasa Variable 9,069,218.75
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 4,027,066.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 4,701,599.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 2,013,533.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 10,067,665.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 5,033,832.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 9,140.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 362,496.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 75,845.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 736,956.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/05/202408/11/202411.0725
Tasa Variable 5,033,832.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/05/202404/11/202413.22 Tasa Variable 207,055.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/05/202404/10/202413.22 Tasa Variable 222,434.80
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/05/202422/01/202510.84 Tasa

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 59 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Variable 10,213,225.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/05/202431/01/202510.84 Tasa
Variable 39,620,448.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/05/202411/11/202413.2199 Tasa Variable 12,516.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/05/202412/11/202411.065
Tasa Variable 5,029,199.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/05/202411/11/202413.2199 Tasa Variable 73,365.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/05/202404/10/202413.2199 Tasa Variable 185,372.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/05/202412/11/202411.065
Tasa Variable 502,919.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/05/202413/11/202411.065
Tasa Variable 5,027,662.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/05/202407/11/202413.215 Tasa Variable 3,198,477.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/05/202431/10/202413.215 Tasa Variable 2,238,230.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO21/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 24,216.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/04/202420/04/20295.65086
Tasa Variable 193,152,124.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/05/202415/11/202411.0725
Tasa Variable 3,515,070.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/05/202415/11/202411.0725
Tasa Variable 3,515,070.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO22/05/202424/10/202413.215 Tasa Variable 486,945.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO22/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 22,487.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202419/11/202411.0525
Tasa Variable 2,810,315.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202419/11/202411.0525
Tasa Variable 3,713,631.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/05/202415/11/202413.215 Tasa Variable 4,116,234.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/05/202415/11/202413.215 Tasa Variable 2,114.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/05/202404/10/202413.215 Tasa Variable 65,735.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/05/202408/11/202413.215 Tasa Variable 1,061,270.93
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/05/202430/04/203111.01 Tasa
Variable 100,030,583.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/05/202414/11/202413.2215 Tasa Variable 5,518,963.49
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202415/11/202411.0725
Tasa Variable 5,021,529.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/05/202404/10/202413.2225 Tasa Variable 143,584.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/05/202404/10/202413.2225 Tasa Variable 194,768.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/05/202412/11/202413.225 Tasa Variable 1,226,013.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/05/202422/11/202413.225 Tasa Variable 2,158,638.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/05/202420/11/202411.045
Tasa Variable 5,016,874.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202422/11/202411.05 Tasa
Variable 5,012,277.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/05/202422/11/202413.2265 Tasa Variable 744,448.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/05/202425/11/202413.2265 Tasa Variable 25,859.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/05/202425/11/202413.2265 Tasa Variable 19,473.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/05/202430/05/202910.42 Tasa
Fija 37,344,139.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO31/05/202421/11/202413.225 Tasa Variable 7,058,435.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO31/05/202404/10/202413.225 Tasa Variable 1,343,291.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO31/05/202404/10/202413.225 Tasa Variable 85,665.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/05/202425/11/202411.035
Tasa Variable 5,009,195.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/06/202404/10/202413.2265 Tasa Variable 17,308.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/06/202417/10/202413.2265 Tasa Variable 23,446.28

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 60 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable	108,244.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable	21,002.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202429/04/202910.99 Tasa Variable	46,226,228.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202429/11/202410.84 Tasa Variable	2,700,813.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202429/11/202410.84 Tasa Variable	2,700,813.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202429/11/202410.84 Tasa Variable	2,700,813.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202429/11/202410.84 Tasa Variable	2,700,813.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/202402/12/202411.0977 Tasa Variable	5,044,699.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/202402/12/202411.0977 Tasa Variable	3,531,289.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable	1,864,298.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/06/202404/10/202413.225 Tasa Variable	5,539.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/202431/01/202510.84 Tasa Variable	2,038,144.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/06/202424/03/202811.1664 Tasa Variable	6,770,254.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable	171,479.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable	114,954.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	22,241.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable	165,444.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	19,878.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable	3,996.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/06/202425/11/202413.225 Tasa Variable	1,040,071.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	114,279.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/06/202429/11/202413.225 Tasa Variable	1,936,294.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	23,034.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/06/202428/11/202413.225 Tasa Variable	1,431,581.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO07/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable	114,774.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/06/202429/11/202413.227 Tasa Variable	1,967,286.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/06/202402/12/202413.227 Tasa Variable	1,097.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/06/202404/10/202412.497 Tasa Variable	99,162.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/06/202404/10/202412.497 Tasa Variable	162,560.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/06/202425/10/20289.23 Tasa Fija	99,704,946.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202402/10/202412.495 Tasa Variable	105,092.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	33,425.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	224,788.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	326,571.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202421/11/202413.225 Tasa Variable	169,322.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202404/11/202413.225 Tasa Variable	63,499.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/06/202402/12/202413.225 Tasa Variable	1,261,736.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/06/202408/10/202412.495 Tasa Variable	417,277.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	16,287.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/06/202404/10/202412.495 Tasa Variable	139,160.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/06/202409/12/202411.0725 Tasa Variable	5,033,832.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/06/202409/12/202411.0725 Tasa Variable	5,033,832.64
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/06/202409/12/202411.0725 Tasa Variable	5,033,832.64

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 61 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	12/06/2028	11.215
Tasa Variable	13,519,608.31		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,028,798.81		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,028,798.81		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,028,798.81		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,028,798.81		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	12/06/2024	09/12/2024	11.0725
Tasa Variable	5,033,832.64		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	06/12/2024	13.225	Tasa Variable 597,343.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 648,850.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 80,929.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	09/12/2024	13.225	Tasa Variable 7,731.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	09/10/2024	12.495	Tasa Variable 150,012.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 86,617.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/06/2024	09/12/2024	13.225	Tasa Variable 898.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	09/10/2024	12.495	Tasa Variable 677,490.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	10/10/2024	12.495	Tasa Variable 871,778.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	21/11/2024	13.225	Tasa Variable 5,744,073.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 67,762.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	07/10/2024	12.495	Tasa Variable 3,886,360.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 576,529.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	07/10/2024	12.495	Tasa Variable 169,194.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 35,082.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	04/10/2024	12.495	Tasa Variable 212,127.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/06/2024	04/11/2024	13.225	Tasa Variable 140,723.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/06/2024	14/06/2029	11.2425
Tasa Variable	4,395,486.78		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	14/06/2024	31/01/2025	10.84
Variable	789,496.97		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/06/2024	11/10/2024	12.4975	Tasa Variable 291,188.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/06/2024	07/10/2024	12.4975	Tasa Variable 348,433.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/06/2024	04/10/2024	12.4975	Tasa Variable 193,621.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	17/06/2024	13/12/2024	10.84
Variable	20,006,022.22		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/06/2024	07/10/2024	12.4975	Tasa Variable 10,339.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/06/2024	04/10/2024	12.4975	Tasa Variable 370,073.11

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 62 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/06/202404/10/202412.4975	Tasa Variable	126,449.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/06/202404/11/202413.2275	Tasa Variable	114,650.28
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO17/06/202404/10/202412.4975	Tasa Variable	21,870.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202411/10/202412.495	Tasa Variable	781,742.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	4,209,915.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202407/10/202412.495	Tasa Variable	198,597.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	14,291.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	11,421.63
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202409/12/202413.225	Tasa Variable	332,448.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202404/11/202413.225	Tasa Variable	419,780.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO18/06/202411/12/202413.225	Tasa Variable	1,943,139.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/06/202411/10/202412.493	Tasa Variable	208,652.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/06/202404/10/202412.493	Tasa Variable	224,441.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/06/202404/10/202412.493	Tasa Variable	24,219.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/06/202404/11/202413.223	Tasa Variable	9,124.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	18,653.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	368,051.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202413/12/202413.225	Tasa Variable	1,042,316.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202416/12/202413.225	Tasa Variable	6,201.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	29,577.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	1,442,007.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202416/12/202413.225	Tasa Variable	4,545.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202402/12/202411.0977		Tasa Variable	7,062,578.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202416/10/202412.495	Tasa Variable	224,631.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	1,643.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	137,250.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	333.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202409/06/202511.0725		Tasa Variable	10,067,665.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202410/06/202511.0638		Tasa Variable	10,064,538.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/06/202411/06/202511.0675		Tasa Variable	10,061,486.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202404/12/202411.085		Tasa Variable	7,058,196.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202417/10/202412.495	Tasa Variable	294,864.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	194,401.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	1,145,580.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	48,490.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	66,925.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202428/11/202413.225	Tasa Variable	5,850,809.66
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202414/10/202412.495	Tasa Variable	2,090,792.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	517,399.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202414/10/202412.495	Tasa Variable	341,708.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	242,856.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	76,781.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202416/12/202413.225	Tasa Variable	91,009.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/06/202404/11/202413.225	Tasa Variable	90,963.83
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202418/10/202411.0606		Tasa Variable	1,003,994.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/06/202404/12/202411.085		Tasa Variable	3,024,941.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202420/12/202410.84		Tasa Variable	20,006,022.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/06/202406/12/202411.075			

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 63 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Variable 10,076,909.72

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	46,602.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	789,070.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	74,890.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	164,994.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	61,267.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	23,138.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/11/202413.225	Tasa Variable	1,915,838.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO24/06/202404/11/202413.225	Tasa Variable	289,385.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202414/10/20246.67558	Tasa Variable	113,991.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202417/10/202412.495	Tasa Variable	78,052.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	81,932.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	334,742.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	29,843.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202409/12/202413.225	Tasa Variable	861,952.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/06/202404/11/202413.225	Tasa Variable	33,198.76

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/06/202409/12/202411.0725

Tasa Variable 10,067,665.28

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202418/10/202412.495	Tasa Variable	263,349.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	138,702.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	1,151,250.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	300,850.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	330,545.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202411/10/202412.495	Tasa Variable	85,935.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202414/10/202412.495	Tasa Variable	445,444.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	347,605.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	12,098.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/06/202404/10/202412.495	Tasa Variable	98,301.56

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/06/202424/12/202411.0364

Tasa Variable 24,051,503.20

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202423/10/202412.4949	Tasa Variable	268,973.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	205,122.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	1,646,887.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	1,165.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202423/12/202413.2249	Tasa Variable	43,281.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	64,308.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	207,378.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202413/12/202413.2249	Tasa Variable	542,754.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202423/12/202413.2249	Tasa Variable	739.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/11/202413.2249	Tasa Variable	26,812.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202408/10/202412.4949	Tasa Variable	37,157.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	107,575.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	26,561.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	80,875.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/06/202404/10/202412.4949	Tasa Variable	9,692.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202424/10/202412.49	Tasa Variable	349,155.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202414/10/202412.49	Tasa Variable	323,294.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202421/10/202412.49	Tasa Variable	2,176,962.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	1,305,654.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	1,251,992.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	69,754.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	1,706.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202419/12/202413.22	Tasa Variable	4,375,887.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202411/10/202412.49	Tasa Variable	556,616.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202425/10/202412.49	Tasa Variable	87,647.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/06/202421/10/202412.49	Tasa Variable	273,286.49

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 64 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	97,212.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	25,979.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO28/06/202404/10/202412.49	Tasa Variable	116,007.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202407/10/20246.66295	Tasa Variable	64,541.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202418/10/202412.9237	Tasa Variable	17,040.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202421/10/202412.9237	Tasa Variable	321,583.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/10/202412.9237	Tasa Variable	914,985.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202421/10/202412.9237	Tasa Variable	349,569.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/10/202412.9237	Tasa Variable	1,228,762.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/10/202412.9237	Tasa Variable	964,043.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/10/202412.9237	Tasa Variable	15,824.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202423/12/202412.9613	Tasa Variable	9,229.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202405/12/202412.9613	Tasa Variable	18,282.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/11/202412.9613	Tasa Variable	32,533.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/07/202404/11/202412.9613	Tasa Variable	246,695.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/07/202429/10/202410.84		Tasa Variable	40,012,044.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/07/202427/12/202410.84		Tasa Variable	10,003,011.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/07/202430/10/202410.84		Tasa Variable	1,000,301.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/07/202430/10/202410.84		Tasa Variable	1,000,301.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/07/202430/10/202410.84		Tasa Variable	1,000,301.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202425/10/202412.9148	Tasa Variable	384,775.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202404/10/202412.9148	Tasa Variable	182,210.49
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202404/10/202412.9148	Tasa Variable	239,156.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202411/10/202412.9148	Tasa Variable	1,057,803.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202404/10/202412.9148	Tasa Variable	724,424.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/07/202404/10/202412.9148	Tasa Variable	256,461.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/10/202412.9206	Tasa Variable	41,718.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/10/202412.9206	Tasa Variable	679,648.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202423/12/202412.9473	Tasa Variable	1,156,059.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202418/10/202412.9206	Tasa Variable	10,124.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202421/10/202412.9206	Tasa Variable	96,719.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/10/202412.9206	Tasa Variable	77,718.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/07/202416/12/202411.0725		Tasa Variable	11,047,365.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/10/202412.9206	Tasa Variable	511,023.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/11/202412.9473	Tasa Variable	1,598,084.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO03/07/202404/11/202412.9473	Tasa Variable	74,208.24
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/07/202418/12/202411.0606		Tasa Variable	10,039,941.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	61,748.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	5,845.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	67,668.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202427/12/202412.9622	Tasa Variable	573,516.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202430/12/202412.9622	Tasa Variable	10,852.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202430/10/202412.9286	Tasa Variable	90,366.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	1,007,060.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	12,110.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/10/202412.9286	Tasa Variable	12,413.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202427/12/202412.9622	Tasa Variable	2,080,636.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/11/202412.9622	Tasa Variable	83,598.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO04/07/202404/11/202412.9622	Tasa Variable	4,465.26

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 65 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/07/202404/11/202412.9622	Tasa Variable	17,125.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/07/202403/10/202411.0976	Tasa Variable	20,172,629.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202425/10/202412.9078	Tasa Variable	10,506.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202425/10/202412.9078	Tasa Variable	992,884.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/10/202412.9078	Tasa Variable	780,567.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/07/202411/06/20295.87393	Tasa Variable	126,276,074.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/10/202412.9078	Tasa Variable	30,671.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/10/202412.9078	Tasa Variable	3,365,072.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202430/12/202412.9263	Tasa Variable	73,321.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/11/202412.9263	Tasa Variable	165,064.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/10/202412.9078	Tasa Variable	229,274.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/10/202412.9078	Tasa Variable	71,541.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/07/202404/11/202412.9263	Tasa Variable	11,417.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/07/202403/10/202411.0976	Tasa Variable	10,086,314.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202401/11/202412.929	Tasa Variable	114,295.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202421/10/202412.929	Tasa Variable	187,695.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/10/202412.929	Tasa Variable	49,067.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202411/10/202412.929	Tasa Variable	1,126,794.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202425/10/202412.929	Tasa Variable	21,025.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202428/10/202412.929	Tasa Variable	228,816.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/11/202412.929	Tasa Variable	117,567.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/11/202412.929	Tasa Variable	158,091.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/10/202412.929	Tasa Variable	323,180.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/10/202412.929	Tasa Variable	34,561.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202418/10/202412.929	Tasa Variable	266,763.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202428/10/202412.929	Tasa Variable	917,653.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/10/202412.929	Tasa Variable	6,773,640.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202404/10/202412.929	Tasa Variable	411,535.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/07/202407/10/202412.929	Tasa Variable	65,135.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202407/10/202411.0725	Tasa Variable	20,135,330.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202410/10/202412.4175	Tasa Variable	2,510,859.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202428/10/202412.9175	Tasa Variable	171,839.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202428/10/202412.9175	Tasa Variable	2,119,044.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202404/11/202412.9175	Tasa Variable	49,327.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202404/11/202412.9175	Tasa Variable	71,436.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202404/11/202412.9175	Tasa Variable	4,462.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202430/12/202412.9292	Tasa Variable	85,589.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/07/202404/11/202412.9175	Tasa Variable	236,828.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202430/06/203110.44	Tasa Fija	54,657,628.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202430/04/203111.01	Tasa Variable	100,030,583.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202401/11/202412.9193	Tasa Variable	102,122.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202404/10/202412.9193	Tasa Variable	638,150.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202404/11/202412.9193	Tasa Variable	176,790.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202418/10/202412.9193	Tasa Variable	2,624.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202428/10/202412.9193	Tasa Variable	88,688.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202404/10/202412.9193	Tasa Variable	16,257.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202428/10/202412.9193	Tasa Variable	45,998.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202404/11/202412.9193	Tasa Variable	218,624.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202407/10/202412.9193	Tasa Variable	569.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/07/202404/10/202412.9193	Tasa Variable	59,888.59

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 66 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202403/01/202512.9395	Tasa Variable	2,197,867.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202406/01/202512.9395	Tasa Variable	9,497.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO10/07/202406/01/202512.9395	Tasa Variable	932,302.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202428/10/202412.923	Tasa Variable	122,966.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/10/202412.923	Tasa Variable	74,017.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/11/202412.923	Tasa Variable	284,757.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/10/202412.923	Tasa Variable	46,850.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202406/01/202512.943	Tasa Variable	5,637.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/202403/01/202511.0976			
		Tasa Variable	12,103,577.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/11/202412.923	Tasa Variable	213,314.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/11/202412.923	Tasa Variable	7,417.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/11/202412.923	Tasa Variable	3,269.16
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/12/202412.943	Tasa Variable	14,446.45
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/202409/10/202411.0725			
		Tasa Variable	20,135,330.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202406/11/202412.923	Tasa Variable	186,489.65
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202428/10/202412.923	Tasa Variable	39,902.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO11/07/202404/11/202412.923	Tasa Variable	648,788.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/202409/10/202411.0725			
		Tasa Variable	402,706.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/07/202411/07/20294.93 Tasa Fija			
			15,930,585.16
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/07/202406/01/202511.075			
		Tasa Variable	12,092,291.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202408/10/202412.9039	Tasa Variable	110,576.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	10,535.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	404,758.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	200,195.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	7,131.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202406/01/202512.9035	Tasa Variable	8,392.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/07/202410/10/202411.0638			
		Tasa Variable	402,581.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202431/10/202412.9039	Tasa Variable	170,614.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202428/10/202412.9039	Tasa Variable	101,719.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202410/10/202412.9039	Tasa Variable	1,357,783.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	288,728.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	95,277.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202402/01/202512.9035	Tasa Variable	856,096.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	490,968.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202417/10/202412.9039	Tasa Variable	370,715.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/10/202412.9039	Tasa Variable	123,771.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	159,142.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202404/11/202412.9039	Tasa Variable	84,007.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO12/07/202407/10/202412.9039	Tasa Variable	60,564.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/07/202411/10/202411.0675			
		Tasa Variable	20,122,972.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/07/202408/01/202511.0725			
		Tasa Variable	12,081,198.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/11/202412.8736	Tasa Variable	970,264.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/10/202412.8736	Tasa Variable	29,246.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/11/20246.60508	Tasa Variable	120,475.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202407/10/202412.8736	Tasa Variable	109,510.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/11/202412.8736	Tasa Variable	43,107.94
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/12/202412.859	Tasa Variable	32,696.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO15/07/202404/10/202412.8736	Tasa Variable	386,986.31

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 67 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/07/202404/10/202412.8736	Tasa Variable	16,460.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/07/202404/12/202412.859	Tasa Variable	89,912.61
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/07/202430/06/202510.84	Tasa Variable	37,511,291.66
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/11/202412.8328	Tasa Variable	132,373.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/11/202412.8328	Tasa Variable	28,746.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/11/202412.8328	Tasa Variable	117,430.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/10/202412.8328	Tasa Variable	7,376.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/12/202412.8348	Tasa Variable	3,048.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/07/202414/10/202411.0725	Tasa Variable	451,937.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/11/202412.8328	Tasa Variable	143,073.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/11/202412.8328	Tasa Variable	278,407.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202404/12/202412.8348	Tasa Variable	28,228.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/07/202408/01/202512.8348	Tasa Variable	1,193,334.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/07/202429/06/202911.01	Tasa Variable	20,006,116.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/07/202415/10/202411.0725	Tasa Variable	20,086,119.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202408/11/202412.8274	Tasa Variable	80,950.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202407/10/202412.8274	Tasa Variable	40,472.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	3,995,147.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202403/01/202512.8297	Tasa Variable	610,098.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	1,794,033.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	1,557,718.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	101,450.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/12/202412.8297	Tasa Variable	929,076.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/12/202412.8297	Tasa Variable	18,631.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202401/11/202412.8274	Tasa Variable	16,428.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	180,691.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202404/11/202412.8274	Tasa Variable	44,842.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202407/10/202412.8274	Tasa Variable	2,274.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/07/202410/01/202512.8297	Tasa Variable	1,424,720.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202412/11/202412.8333	Tasa Variable	349,210.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202404/11/202412.8333	Tasa Variable	289,288.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202404/10/202412.8333	Tasa Variable	16,925.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202413/01/202512.8345	Tasa Variable	65,310.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202405/12/202412.8345	Tasa Variable	316,978.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202413/11/202412.8333	Tasa Variable	507,137.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202404/11/202412.8333	Tasa Variable	234,754.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202404/10/202412.8333	Tasa Variable	8,736.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/07/202414/10/202412.8333	Tasa Variable	6,113.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/07/202431/01/202510.84	Tasa Variable	308,522.77
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/07/202431/01/202510.84	Tasa Variable	1,388,352.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202417/10/202411.0725	Tasa Variable	20,086,119.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202417/10/202411.0725	Tasa Variable	451,937.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202414/11/202412.8465	Tasa Variable	215,380.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202403/10/202412.8465	Tasa Variable	732,411.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	1,552,716.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	116,928.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	64,938.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/07/202409/01/202512.8643	Tasa Variable	6,063,628.03

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 68 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	44,718.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	183,322.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	404,551.45
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	19,712.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202413/01/202512.8643	Tasa Variable	32,640.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/12/202412.8643	Tasa Variable	164,019.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/07/202417/10/202411.0725		Tasa Variable	10,043,059.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202411/11/202412.8465	Tasa Variable	3,269,515.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202413/11/202412.8465	Tasa Variable	2,052,813.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	35,356.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202411/11/202412.8465	Tasa Variable	729,550.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	183,818.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/11/202412.8465	Tasa Variable	150,630.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/07/202404/12/202412.8643	Tasa Variable	97,956.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202411/11/202412.8852	Tasa Variable	1,399,778.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/10/202412.8852	Tasa Variable	370,555.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202411/11/202412.8852	Tasa Variable	19,314.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/11/202412.8852	Tasa Variable	98,733.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/11/202412.8852	Tasa Variable	45,181.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202414/10/202412.8852	Tasa Variable	196,670.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202413/01/202512.9148	Tasa Variable	235,412.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202413/11/202412.8852	Tasa Variable	98,888.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202428/10/202412.8852	Tasa Variable	232,689.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/10/202412.8852	Tasa Variable	466,054.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/11/202412.8852	Tasa Variable	67,732.42
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/07/202404/10/202412.8852	Tasa Variable	139,447.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202421/10/202411.05		Tasa Variable	400,982.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202411/11/202412.8841	Tasa Variable	733,302.53
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202404/11/202412.8841	Tasa Variable	35,353.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202404/11/202412.8841	Tasa Variable	47,573.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202404/10/202412.8841	Tasa Variable	158,436.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202414/10/202412.8841	Tasa Variable	143,703.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202404/11/202412.8841	Tasa Variable	1,375,454.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202417/01/202512.9169	Tasa Variable	2,757,065.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202414/10/202412.8841	Tasa Variable	57,104.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202415/11/202412.8841	Tasa Variable	7,409.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202404/11/202412.8841	Tasa Variable	173,599.54
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/07/202414/10/202412.8841	Tasa Variable	5,514.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202421/10/202411.05		Tasa Variable	20,049,111.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202411/11/20246.53923	Tasa Variable	378,058.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202419/11/202412.8734	Tasa Variable	338,497.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202414/10/202412.8734	Tasa Variable	4,325.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	418,067.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	250,755.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/12/202412.8872	Tasa Variable	48,013.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	886,555.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	366,641.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	870,876.95
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/12/202412.8872	Tasa Variable	32,753.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO24/07/202422/10/202411.05		Tasa Variable	3,007,366.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202415/11/202412.8734	Tasa Variable	30,174.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/07/202404/11/202412.8734	Tasa Variable	726,817.28

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 69 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/07/202423/10/202411.05	Tasa
Variable 20,049,111.11	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202411/10/202412.891	Tasa Variable 2,038.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202420/01/202512.9192	Tasa Variable 53,979.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202411/10/202412.891	Tasa Variable 208,800.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 19,556.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 577,671.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 546,079.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202408/11/202412.891	Tasa Variable 258,089.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202420/11/202412.891	Tasa Variable 83,026.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202403/10/202412.891	Tasa Variable 135,389.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 777,666.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 165,511.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 92,151.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 444,830.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 3,144.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 1,909.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/12/202412.9192	Tasa Variable 48,000.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202414/10/202412.891	Tasa Variable 68,510.76
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO25/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 701,441.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/07/202421/04/202511.42	Tasa
Fija 12,258,853.33	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202421/11/202412.9042	Tasa Variable 757,033.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 100,682.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 155,748.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 35,472.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202416/01/202512.9215	Tasa Variable 6,961,637.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/12/202412.9215	Tasa Variable 27,445.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/07/202424/10/202411.0364	Tasa
Variable 450,965.69	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202401/11/202412.9042	Tasa Variable 351,858.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202419/11/202412.9042	Tasa Variable 41,585.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 162,925.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 65,604.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202420/01/202512.9215	Tasa Variable 89,548.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202419/11/202412.9042	Tasa Variable 820,213.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202404/11/202412.9042	Tasa Variable 63,661.71
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/07/202419/11/202412.9042	Tasa Variable 590,169.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/07/202425/10/202411.035	Tasa
Variable 20,036,783.33	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202415/11/202412.891	Tasa Variable 496,521.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202419/11/202412.891	Tasa Variable 1,780,308.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202425/10/202412.891	Tasa Variable 76,382.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 1,119,737.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 1,891,609.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202421/10/202412.891	Tasa Variable 35,856.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 57,566.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 919,366.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 20,349.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/11/202412.891	Tasa Variable 57,593.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/07/202404/10/202412.891	Tasa Variable 17,266.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/07/202419/11/20246.49145	Tasa Variable 252,405.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/07/202425/11/202412.8849	Tasa Variable 206,631.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/07/202404/11/202412.8849	Tasa Variable 848,215.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/07/202404/10/202412.8849	Tasa Variable 59,458.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/07/202404/11/202412.8849	Tasa Variable 258,271.94

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 70 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202425/10/202412.8849	Tasa Variable	98,648.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202411/11/202412.8849	Tasa Variable	2,153.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202404/11/202412.8849	Tasa Variable	174,123.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202404/11/202412.8849	Tasa Variable	113,345.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202404/10/202412.8849	Tasa Variable	23,279.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202420/01/202512.8921	Tasa Variable	14,342.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO30/07/202404/12/202412.8921	Tasa Variable	11,071.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/07/202430/07/202911.01		Tasa Variable	58,017,738.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202422/11/202412.8874	Tasa Variable	404,611.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202421/10/202412.8874	Tasa Variable	4,315.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202404/11/202412.8874	Tasa Variable	1,355,972.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202404/11/202412.8874	Tasa Variable	1,775,846.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202404/11/202412.8874	Tasa Variable	184,794.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO31/07/202404/11/202412.8874	Tasa Variable	669,698.70
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/07/202426/02/202511.0199		Tasa Variable	41,062,752.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202419/11/202412.9031	Tasa Variable	396,633.43
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202404/11/202412.9031	Tasa Variable	66,720.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202404/11/202412.9031	Tasa Variable	670,068.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202427/01/202512.9144	Tasa Variable	51,126.99
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO01/08/202427/01/202511.02		Tasa Variable	4,004,897.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202401/11/202412.9031	Tasa Variable	134,377.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202404/11/202412.9031	Tasa Variable	2,832,199.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202404/11/202412.9031	Tasa Variable	80,694.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202428/11/202412.9031	Tasa Variable	106,919.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO01/08/202427/01/202512.9144	Tasa Variable	21,634.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/08/202431/10/202410.84		Tasa Variable	20,006,022.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202428/11/202412.8805	Tasa Variable	403,551.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	11,912.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	297,195.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202423/01/202512.8761	Tasa Variable	4,230,202.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202428/10/202412.8805	Tasa Variable	72,923.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202425/11/202412.8805	Tasa Variable	2,532,435.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	319,214.55
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	1,482,434.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202423/01/202512.8761	Tasa Variable	4,499,627.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/08/202412/06/202811.195		Tasa Variable	5,451,792.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/08/202431/10/202410.84		Tasa Variable	500,150.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202426/11/202412.8805	Tasa Variable	130,419.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202425/11/202412.8805	Tasa Variable	287,420.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	22,083.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202425/11/202412.8805	Tasa Variable	690,831.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/11/202412.8805	Tasa Variable	24,298.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202428/10/202412.8805	Tasa Variable	4,942.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202413/01/202512.8761	Tasa Variable	149,201.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO02/08/202404/12/202412.8761	Tasa Variable	134,593.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/08/202429/01/202510.84		Tasa Variable	9,002,710.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202428/10/20246.44212	Tasa Variable	528,162.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202411/11/20246.46657	Tasa Variable	3,328.36
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/08/202431/01/202510.84		Tasa Variable	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 71 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Variable	9,002,710.00			
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/10/202412.8699	Tasa Variable	1,486.58	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/10/202412.8699	Tasa Variable	242,992.35	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202419/11/202412.8587	Tasa Variable	58,710.35	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	57,919.04	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202419/11/202412.8587	Tasa Variable	18,077.63	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	1,193,148.77	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	473,499.80	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	68,167.34	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202428/10/202412.8587	Tasa Variable	53,030.48	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202429/11/202412.8587	Tasa Variable	2,183,662.03	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202428/10/202412.8587	Tasa Variable	84,648.61	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	138,419.47	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	150,197.54	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	1,056,922.82	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/11/202412.8587	Tasa Variable	12,269.29	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/12/202412.8361	Tasa Variable	1,565,429.02	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/12/202412.8361	Tasa Variable	41,483.82	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/12/202412.8361	Tasa Variable	131,092.89	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO05/08/202404/12/202412.8361	Tasa Variable	5,073.05	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202418/10/20246.42773	Tasa Variable	205,442.95	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202425/11/20246.40763	Tasa Variable	128,189.07	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/08/202422/01/202511.05		Tasa Variable	8,019,644.44	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202404/10/202412.833	Tasa Variable	4,096.71	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202404/10/202412.833	Tasa Variable	23,413.91	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202425/10/202412.7705	Tasa Variable	74,530.88	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202429/11/202412.7705	Tasa Variable	189,485.60	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202421/10/202412.7705	Tasa Variable	12,897.32	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202404/11/202412.7705	Tasa Variable	412,694.02	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202404/11/202412.7705	Tasa Variable	293,460.54	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202427/01/202512.7146	Tasa Variable	387,515.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/08/202404/11/202411.085		Tasa Variable	453,741.19	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202428/10/202412.7705	Tasa Variable	34,435.85	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO06/08/202404/12/202412.7705	Tasa Variable	421,427.48	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202404/10/202412.8283	Tasa Variable	65,396.35	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202428/10/202412.7502	Tasa Variable	79,936.27	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202404/11/202412.7502	Tasa Variable	82,511.76	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202404/12/202412.7502	Tasa Variable	145,439.74	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202404/11/202412.7502	Tasa Variable	665,712.18	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202404/11/202412.7502	Tasa Variable	40,090.76	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO07/08/202431/01/202512.6917	Tasa Variable	169,416.17	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/08/202417/01/202511.0725		Tasa Variable	3,521,275.97	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202406/11/202411.075		Tasa Variable	20,153,819.44	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202407/10/202412.8341	Tasa Variable	954.44	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/12/202412.784	Tasa Variable	212,968.27	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202431/01/202512.7424	Tasa Variable	3,268.81	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/02/202512.7424	Tasa Variable	2,644,520.86	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/10/202412.8341	Tasa Variable	50,903.51	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202418/10/202412.784	Tasa Variable	13,525.27	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/12/202412.784	Tasa Variable	66,426.66	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/11/202412.784	Tasa Variable	85,924.48	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO08/08/202404/11/202412.784	Tasa Variable	364,605.28	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 72 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/08/202431/01/202512.7424	Tasa Variable	15,325.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO08/08/202404/02/202512.7424	Tasa Variable	194,650.85
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202406/12/202411.075	Tasa Variable	2,015,381.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202406/12/202411.075	Tasa Variable	2,015,381.94
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202408/08/202911.2425	Tasa Variable	10,890,981.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202408/08/202911.2425	Tasa Variable	11,683,053.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/08/202408/08/202911.2425	Tasa Variable	15,049,356.50
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/08/202407/11/202411.0725	Tasa Variable	20,135,330.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202406/12/202412.759	Tasa Variable	393,814.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202405/11/202412.759	Tasa Variable	79,465.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202411/10/202412.759	Tasa Variable	83,721.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202425/11/202412.759	Tasa Variable	109,692.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/11/202412.759	Tasa Variable	3,669,053.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202430/01/202512.7004	Tasa Variable	7,986,962.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202425/11/202412.759	Tasa Variable	77,216.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/12/202412.759	Tasa Variable	158,882.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/12/202412.759	Tasa Variable	74,932.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202430/01/202512.7004	Tasa Variable	2,255,752.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202407/10/202412.8322	Tasa Variable	135,622.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202407/10/202412.8322	Tasa Variable	9,831,663.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202418/10/202412.759	Tasa Variable	403,200.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202403/12/202412.759	Tasa Variable	353,457.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202402/12/202412.759	Tasa Variable	1,991,040.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/12/202412.759	Tasa Variable	149,996.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202402/12/202412.759	Tasa Variable	916,027.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/12/202412.759	Tasa Variable	9,084.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/08/202404/11/202412.759	Tasa Variable	15,844.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202407/10/20246.30283	Tasa Variable	30,446.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202425/11/20246.18487	Tasa Variable	4,249.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202407/10/202412.7945	Tasa Variable	81,167.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202422/10/202412.6743	Tasa Variable	5,160.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202402/12/202412.6743	Tasa Variable	414,643.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	66,711.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	517,989.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	5,875.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	1,900.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/11/202412.6743	Tasa Variable	21,472.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202431/01/202512.6123	Tasa Variable	66,546.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	9,156.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/10/202412.7945	Tasa Variable	31,441.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	643.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/11/202412.6743	Tasa Variable	16,918.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/11/202412.6743	Tasa Variable	73,820.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	9,491.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/11/202412.6743	Tasa Variable	23,931.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202404/12/202412.6743	Tasa Variable	2,824.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/08/202406/01/202512.6123	Tasa Variable	7,425.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/08/202414/06/202911.2225	Tasa Variable	1,730,313.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202407/10/20246.31269	Tasa Variable	54,006.37

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 73 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202402/12/20246.20597	Tasa Variable	73,976.13
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/08/202411/11/202411.0675		
Tasa Variable		301,844.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202411/10/202412.6536	Tasa Variable	42,024.37
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202404/10/202412.6536	Tasa Variable	2,178,829.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202406/11/202412.6365	Tasa Variable	12,633.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202404/12/202412.6365	Tasa Variable	37,578.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202404/11/202412.6365	Tasa Variable	113,823.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202404/11/202412.6365	Tasa Variable	20,782.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/08/202406/01/202512.5914	Tasa Variable	39,086.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202425/11/20246.20431	Tasa Variable	461,070.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202405/12/202412.6362	Tasa Variable	123,356.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202425/11/202412.6362	Tasa Variable	293,664.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	602,327.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	245,562.79
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202407/02/202512.5851	Tasa Variable	935,462.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	66,836.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	77,352.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/10/202412.6435	Tasa Variable	34,217.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	14,286.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	653.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO14/08/202404/12/202412.6362	Tasa Variable	247,477.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	2,049,037.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	121,106.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/08/202413/12/202411.065		
Tasa Variable		2,011,065.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202411/10/202412.6389	Tasa Variable	105,800.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202403/12/202412.6425	Tasa Variable	110,417.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202402/12/202412.6425	Tasa Variable	316,646.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	17,542.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	810,094.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	87,720.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	369,316.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	125,285.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202411/12/202412.6425	Tasa Variable	121,427.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202415/10/202412.6425	Tasa Variable	494,815.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	338,058.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	4,419.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	472,368.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	45,317.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO15/08/202404/12/202412.6425	Tasa Variable	4,419.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202410/10/202412.1373	Tasa Variable	7,921,723.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202411/10/202412.6373	Tasa Variable	183,037.42
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	177,681.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/11/202412.6315	Tasa Variable	106,314.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202403/10/202412.6373	Tasa Variable	199,635.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/10/202412.6373	Tasa Variable	464,188.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	254,637.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	30,347.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	1,681,220.94
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202406/02/202512.5925	Tasa Variable	2,901,937.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202410/10/202412.1373	Tasa Variable	2,314,881.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202414/10/202412.6373	Tasa Variable	1,483.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202429/11/202412.1315	Tasa Variable	12,433,960.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202409/12/202412.6315	Tasa Variable	408,810.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	94,951.72

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 74 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202409/12/202412.6315	Tasa Variable	438,698.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	5,967.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	130,252.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202404/12/202412.6315	Tasa Variable	7,062.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202406/02/202512.5925	Tasa Variable	5,492,387.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO16/08/202406/01/202512.5925	Tasa Variable	10,833.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202414/10/202412.6313	Tasa Variable	39,366.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202414/10/202412.6313	Tasa Variable	861,575.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202414/10/202412.6313	Tasa Variable	96,505.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202415/11/202412.6253	Tasa Variable	2,804.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202409/12/202412.6253	Tasa Variable	2,325,320.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/12/202412.6253	Tasa Variable	61,838.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202411/11/202412.6253	Tasa Variable	48,722.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202409/12/202412.6253	Tasa Variable	155,006.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/12/202412.6253	Tasa Variable	539,444.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202411/11/202412.6253	Tasa Variable	284,275.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202406/12/202412.6253	Tasa Variable	582,152.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/10/202412.6313	Tasa Variable	175,267.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202406/12/202412.6253	Tasa Variable	627,466.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/11/202412.6253	Tasa Variable	103,659.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/12/202412.6253	Tasa Variable	261,945.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/12/202412.6253	Tasa Variable	46,651.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202404/12/202412.6253	Tasa Variable	64,446.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202410/02/202512.6024	Tasa Variable	301,089.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO19/08/202406/01/202512.6024	Tasa Variable	5,584.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/08/202423/01/202510.84	Tasa Variable	2,507,774.11	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202414/10/20246.32841	Tasa Variable	77,116.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202409/12/20246.23969	Tasa Variable	31,089.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/08/202414/02/202511.0725	Tasa Variable	4,017,223.89	
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202411/10/202412.6283	Tasa Variable	34,015.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202408/10/202412.6283	Tasa Variable	1,473,038.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/10/202412.6283	Tasa Variable	141,402.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202429/11/202412.6092	Tasa Variable	352,274.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202413/12/202412.6092	Tasa Variable	668,945.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202409/12/202412.6092	Tasa Variable	74,508.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	5,968.59
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	764,898.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	38,002.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	786,073.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	187,017.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202404/12/202412.6092	Tasa Variable	9,495.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/08/202406/01/202512.5679	Tasa Variable	118,697.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202411/11/202412.6316	Tasa Variable	29,993.62
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	306,420.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	334,683.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	239,127.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202414/02/202512.5917	Tasa Variable	594,774.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202414/10/202412.639	Tasa Variable	746.79
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202402/12/202412.6316	Tasa Variable	31,743.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	1,567,363.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	14,853.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	2,006,554.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/08/202419/11/202411.0525	Tasa Variable	602,210.50	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 75 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202411/10/202412.639	Tasa Variable	50,146.05
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202411/10/202412.639	Tasa Variable	4,133,122.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/10/202412.639	Tasa Variable	1,188,789.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202411/12/202412.6316	Tasa Variable	88,953.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202409/12/202412.6316	Tasa Variable	1,095,084.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	1,340,159.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	388,669.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202404/12/202412.6316	Tasa Variable	15,825.76
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202406/01/202512.5917	Tasa Variable	1,241,237.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO21/08/202406/01/202512.5917	Tasa Variable	18,611.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/08/202419/11/202411.0525		Tasa Variable	4,014,736.67
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202408/10/202412.6376	Tasa Variable	101,742.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/10/202412.6376	Tasa Variable	985,812.08
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/10/202412.6376	Tasa Variable	172,726.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202413/11/202412.6182	Tasa Variable	345,917.19
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/12/202412.6182	Tasa Variable	22,126.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/12/202412.6182	Tasa Variable	382,625.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/11/202412.6182	Tasa Variable	143,788.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202406/02/202512.5715	Tasa Variable	157,807.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202418/12/202412.6182	Tasa Variable	72,453.80
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202425/10/202412.6182	Tasa Variable	39,276.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/11/202412.6182	Tasa Variable	211,796.03
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/12/202412.6182	Tasa Variable	227,085.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/12/202412.6182	Tasa Variable	5,673.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202413/02/202512.5715	Tasa Variable	53,013.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202404/12/202412.6182	Tasa Variable	87,274.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO22/08/202406/01/202512.5715	Tasa Variable	2,122.72
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/08/202415/08/202811.2225		Tasa Variable	6,884,080.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202414/10/20246.30176	Tasa Variable	96,000.76
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202421/11/202411.05		Tasa Variable	400,982.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202410/10/202412.6333	Tasa Variable	223,168.84
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202414/10/202412.6333	Tasa Variable	26,410.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202417/12/202412.6046	Tasa Variable	161,526.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202411/11/202412.6046	Tasa Variable	211,177.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202409/12/202412.6046	Tasa Variable	22,533.90
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	42,124.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	189,237.21
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/11/202412.6046	Tasa Variable	14,213.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	533,298.29
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	11,183,979.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202418/10/202412.6333	Tasa Variable	6,322,739.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/10/202412.6333	Tasa Variable	38,017.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202416/12/202412.6046	Tasa Variable	174,594.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	178,061.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202416/12/202412.6046	Tasa Variable	5,780.23
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	124,440.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	2,914,101.69
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202404/02/202512.5422	Tasa Variable	2,688.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/08/202406/01/202512.5422	Tasa Variable	357,580.55
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202420/12/202411.045		Tasa Variable	1,003,374.86
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202420/12/202411.045		Tasa Variable	1,003,374.86

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 76 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202420/12/202411.045		
Tasa Variable 1,003,374.86		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202420/12/202411.045		
Tasa Variable 1,003,374.86		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202421/11/202411.05	Tasa	
Variable 20,049,111.11		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202431/07/202511.1268		
Tasa Variable 50,602,701.67		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202421/10/202412.6333	Tasa Variable	13,876.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202410/10/202412.6333	Tasa Variable	338,870.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/10/202412.6333	Tasa Variable	232,565.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202414/10/202412.6333	Tasa Variable	2,534.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202421/10/202412.6333	Tasa Variable	817,702.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/10/202412.6333	Tasa Variable	229,088.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/10/202412.6333	Tasa Variable	1,655,502.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/10/202412.6333	Tasa Variable	66,434.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202421/10/202412.6333	Tasa Variable	2,256.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202408/11/202412.6046	Tasa Variable	248,920.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202412/11/202412.6046	Tasa Variable	79,210.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202416/12/202412.6046	Tasa Variable	2,310,981.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202410/12/202412.6046	Tasa Variable	4,054,620.14
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/11/202412.6046	Tasa Variable	255,768.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202416/12/202412.6046	Tasa Variable	1,187,356.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202404/12/202412.6046	Tasa Variable	247,366.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202419/11/202412.6046	Tasa Variable	28,916.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202413/02/202512.5422	Tasa Variable	233,283.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO23/08/202406/01/202512.5422	Tasa Variable	73,887.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202421/10/20246.27131	Tasa Variable	493,168.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202416/12/20246.15475	Tasa Variable	253,187.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202414/10/202412.6386	Tasa Variable	7,732.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202421/10/202412.6386	Tasa Variable	2,122.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202416/12/202412.619	Tasa Variable	384,741.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202419/11/202412.619	Tasa Variable	8,479.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202419/11/202412.619	Tasa Variable	126,123.20
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202421/10/202412.6386	Tasa Variable	10,831.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202416/12/202412.619	Tasa Variable	821,676.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO26/08/202419/11/202412.619	Tasa Variable	66,182.21
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/08/202421/10/20245.54544		
Tasa Variable 9,847,566.69		
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/08/202425/11/202411.035		
Tasa Variable 400,735.67		
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202401/11/20246.28064	Tasa Variable	963,542.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202416/12/20246.1737	Tasa Variable	13,006.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202425/10/202412.6338	Tasa Variable	33,669.18
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202410/10/202412.6338	Tasa Variable	72,388.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202407/10/202412.6338	Tasa Variable	3,843.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/10/202412.6338	Tasa Variable	79,148.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202413/12/202412.5914	Tasa Variable	2,441,198.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202421/11/202412.5914	Tasa Variable	49,714.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202428/10/202412.5914	Tasa Variable	122,205.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	588,532.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	50,337.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/11/202412.5914	Tasa Variable	37,175.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202406/01/202512.5079	Tasa Variable	83,500.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202425/10/202412.6338	Tasa Variable	75,340.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	12,936.72

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 77 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	13,346.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	12,531.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	13,254.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	13,186.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	12,844.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	12,265.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202404/12/202412.5914	Tasa Variable	11,276.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/08/202410/02/202512.5079	Tasa Variable	1,229,783.47
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/08/202422/10/20245.45544	Tasa Variable	9,847,542.07
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/08/202421/02/202511.05	Tasa Variable	35,486,926.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/08/202421/02/202511.05	Tasa Variable	4,537,854.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/08/202421/10/202412.6339	Tasa Variable	275,884.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/08/202419/11/202412.5938	Tasa Variable	261,371.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO28/08/202425/10/202412.6339	Tasa Variable	76,332.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202424/02/202511.0364	Tasa Variable	49,205,366.96
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202424/02/202511.0364	Tasa Variable	5,662,124.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202423/10/20245.53544	Tasa Variable	7,878,051.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/08/202419/02/202511.0525	Tasa Variable	1,003,684.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202421/10/20246.26197	Tasa Variable	40,990.68
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202402/12/202410.84	Tasa Variable	6,001,806.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202424/10/20245.57544	Tasa Variable	9,847,574.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202425/10/202412.6378	Tasa Variable	40,438.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202418/10/202412.6378	Tasa Variable	2,131,083.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202421/10/202412.6378	Tasa Variable	21,836.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202415/11/202412.6125	Tasa Variable	22,483.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202426/12/202412.6125	Tasa Variable	245,948.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202402/12/202412.6125	Tasa Variable	218,532.20
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202420/02/202511.045	Tasa Variable	1,003,374.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202411/10/202412.6378	Tasa Variable	31,142.17
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202422/10/202412.6378	Tasa Variable	8,256,796.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202426/12/202412.6125	Tasa Variable	120,226.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202409/12/202412.6125	Tasa Variable	167,181.05
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202425/02/202511.035	Tasa Variable	54,850,694.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO29/08/202426/12/202412.6125	Tasa Variable	130,326.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/08/202429/08/202911.01	Tasa Variable	1,670,204.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202428/11/202410.84	Tasa Variable	400,120.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202421/10/20246.25718	Tasa Variable	404,100.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202425/10/202412.6366	Tasa Variable	265,098.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202410/10/202412.6366	Tasa Variable	193,198.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202401/11/202412.6222	Tasa Variable	118,187.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202416/12/202412.6222	Tasa Variable	247,596.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202411/02/202512.5603	Tasa Variable	384,242.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202418/10/202412.6366	Tasa Variable	709,211.36

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 78 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202428/10/202412.6366	Tasa Variable	30,860.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202431/10/202412.6222	Tasa Variable	100,026.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202419/11/202412.6222	Tasa Variable	77,235.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202420/02/202512.5603	Tasa Variable	6,749,283.37
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202421/02/202511.05	Tasa Variable	1,002,455.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202428/10/202412.6366	Tasa Variable	317,019.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202425/11/202412.6222	Tasa Variable	1,580,082.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202425/11/202412.6222	Tasa Variable	97,645.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/08/202420/02/202512.5603	Tasa Variable	403,474.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202427/12/202411.02	Tasa Variable	1,001,224.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/08/202426/02/202511.0199	Tasa Variable	80,122,443.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202411/10/202412.1334	Tasa Variable	16,070.36
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202425/10/202412.1334	Tasa Variable	180,078.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202427/12/202412.1183	Tasa Variable	339,698.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202414/10/202412.1334	Tasa Variable	2,962.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202428/10/202412.1334	Tasa Variable	311,080.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202413/12/202412.1183	Tasa Variable	347,807.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202423/12/202412.1183	Tasa Variable	1,250,148.49
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202425/11/202412.1183	Tasa Variable	68,734.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202423/12/202412.1183	Tasa Variable	1,118,707.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202425/11/202412.1183	Tasa Variable	1,777.24
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202424/02/202512.0624	Tasa Variable	250,467.28
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202428/10/202412.1334	Tasa Variable	29,371.40
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202428/10/202412.1334	Tasa Variable	463.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO02/09/202425/11/202412.1183	Tasa Variable	8,746.12
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/09/202428/02/202510.84	Tasa Variable	20,006,022.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/09/202423/12/202412.0718	Tasa Variable	419,172.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/09/202409/12/202412.0718	Tasa Variable	56,122.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO03/09/202424/02/202512.0194	Tasa Variable	1,135,236.34
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/09/202402/12/202411.0976	Tasa Variable	403,452.59
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/09/202429/10/20245.60544	Tasa Variable	11,009,597.90
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/09/202428/02/202510.84	Tasa Variable	44,263,324.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO03/09/202429/08/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/09/202428/10/20246.21662	Tasa Variable	590,048.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/09/202402/12/20246.21662	Tasa Variable	1,699.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/09/202423/12/20246.10877	Tasa Variable	495,249.62
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/09/202430/10/20245.60544	Tasa Variable	9,847,583.03
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/09/202403/03/202511.085	Tasa Variable	26,720,314.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/09/202403/03/202511.085	Tasa Variable	11,091,451.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO04/09/202414/02/202512.0397	Tasa Variable	386,170.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202414/10/202412.1009	Tasa Variable	80,206.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202429/11/202411.5625	Tasa Variable	1,459,180.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202403/03/202512.0032	Tasa Variable	338,244.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202428/10/20246.21153	Tasa Variable	611,249.09
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/09/202431/10/20245.64544		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 79 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Variable 11,423,209.00	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202401/11/202412.1009	Tasa Variable 54,416.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202420/12/202412.0625	Tasa Variable 689,933.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202404/10/202412.1009	Tasa Variable 17,559.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202420/12/202412.0625	Tasa Variable 7,845.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202423/12/202412.0625	Tasa Variable 574,488.19
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202424/02/202512.0032	Tasa Variable 31,923.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202404/11/202412.1009	Tasa Variable 258,078.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202402/01/202512.0625	Tasa Variable 437,926.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202416/12/202412.0625	Tasa Variable 78,100.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202404/12/202412.0625	Tasa Variable 200,388.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202404/12/202412.0625	Tasa Variable 482,778.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO05/09/202406/01/202512.0032	Tasa Variable 51,366.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/09/202414/06/202911.2225	
Tasa Variable 2,458,461.86	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202405/12/202411.075	
Tasa Variable 403,076.39	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/11/202412.0839	Tasa Variable 83,472.01
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 1,925.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 137,101.35
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 1,278,078.25
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 22,376.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202427/02/202511.9674	Tasa Variable 8,550,006.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202401/11/20245.63544	
Tasa Variable 10,832,350.49	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202411/10/202412.0839	Tasa Variable 393,396.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202425/10/202412.0839	Tasa Variable 179,102.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202401/11/202412.0839	Tasa Variable 1,279,191.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/11/202412.0839	Tasa Variable 5,949.68
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202427/12/202412.0271	Tasa Variable 476,042.21
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202430/12/202412.0271	Tasa Variable 671,740.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 95,225.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 507,732.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 84,444.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/12/202412.0271	Tasa Variable 14,951.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202406/01/202511.9674	Tasa Variable 12,065.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202406/01/202511.9674	Tasa Variable 54,506.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202411/10/202412.0839	Tasa Variable 269,356.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202404/11/202412.0839	Tasa Variable 91,010.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202427/12/202412.0271	Tasa Variable 350,136.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202430/12/202412.0271	Tasa Variable 2,015,379.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202430/12/202412.0271	Tasa Variable 92,493.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202425/10/202412.0839	Tasa Variable 177,843.27
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202418/10/202412.0839	Tasa Variable 361,046.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202417/10/202412.0839	Tasa Variable 694,105.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202423/12/202412.0271	Tasa Variable 108,065.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202430/12/202412.0271	Tasa Variable 565,244.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO06/09/202402/12/202412.0271	Tasa Variable 79,620.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202405/03/202511.075	
Tasa Variable 2,015,381.94	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/09/202408/08/202911.2225	
Tasa Variable 9,900,772.24	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202406/03/202511.0725	
Tasa Variable 2,013,533.06	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/11/20246.14607	Tasa Variable 438,590.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/11/20246.14607	Tasa Variable 11,942.27

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 80 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/11/202412.08	Tasa Variable	674,035.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202426/12/202412.0129	Tasa Variable	387,454.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202430/12/202411.5129	Tasa Variable	31,588,059.98
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202416/12/202412.0129	Tasa Variable	58,320.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/12/202412.0129	Tasa Variable	768,241.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202430/12/202412.0129	Tasa Variable	119,264.12
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	584,728.86
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	439,375.54
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202404/11/20245.65544	Tasa Variable	19,695,193.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202407/03/202511.0725	Tasa Variable	5,033,832.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/11/202412.08	Tasa Variable	66,391.41
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202407/10/202412.08	Tasa Variable	19,682.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202421/10/202412.08	Tasa Variable	74,805.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202430/12/202412.0129	Tasa Variable	229,820.62
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/12/202412.0129	Tasa Variable	329,286.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202406/01/202512.0129	Tasa Variable	419,999.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202425/10/202412.08	Tasa Variable	19,307.58
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202402/12/202412.0129	Tasa Variable	2,330.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/12/202412.0129	Tasa Variable	265,830.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO09/09/202404/12/202412.0129	Tasa Variable	82,872.51
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/09/202409/12/202411.0638	Tasa Variable	452,904.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/09/202407/03/202511.0638	Tasa Variable	2,012,907.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/10/202412.0663	Tasa Variable	13,075.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202407/10/202412.0663	Tasa Variable	16,948.47
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/11/202412.0663	Tasa Variable	438,868.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202429/11/202411.9901	Tasa Variable	765,693.74
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202411/11/202411.9901	Tasa Variable	82,558.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/12/202411.9901	Tasa Variable	12,387.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202403/03/202511.9105	Tasa Variable	228,550.91
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202425/10/202412.0663	Tasa Variable	82,816.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/11/202412.0663	Tasa Variable	1,427.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	172,960.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	126,079.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/12/202411.9901	Tasa Variable	45,110.28
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/09/202409/12/202411.0638	Tasa Variable	35,225,885.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202401/11/202412.0663	Tasa Variable	7,187,660.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202404/11/202412.0663	Tasa Variable	163,391.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO10/09/202406/01/202511.9901	Tasa Variable	86,402.09
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/20246.12552	Tasa Variable	236,739.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202430/12/20245.95821	Tasa Variable	110,427.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/09/202410/03/202511.0675	Tasa Variable	2,012,297.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202418/10/202412.0652	Tasa Variable	530,360.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202407/10/202412.0652	Tasa Variable	275,862.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/202412.0652	Tasa Variable	315,769.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202407/10/202412.0652	Tasa Variable	37,791.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202406/12/202411.9868	Tasa Variable	133,033.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202411/11/202411.9868	Tasa Variable	33,172.52
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202423/12/202411.9868	Tasa Variable	109,292.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202430/12/202411.9868	Tasa Variable	101,818.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/12/202411.9868	Tasa Variable	358,539.21

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 81 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/12/202411.9868	Tasa Variable	20,110.38
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202418/10/202412.0652	Tasa Variable	100,588.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202407/03/202511.8986	Tasa Variable	1,513,948.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202407/10/202412.0652	Tasa Variable	13,738.77
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202403/01/202511.9868	Tasa Variable	73,960.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202411/11/202411.9868	Tasa Variable	907.55
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202416/12/202411.9868	Tasa Variable	5,638.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202403/03/202511.8986	Tasa Variable	733,458.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/09/202405/11/20245.66544	Tasa Variable	19,695,198.95
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/09/202409/12/202411.0675	Tasa Variable	5,030,743.06
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202408/11/202412.0652	Tasa Variable	69,166.10
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202428/10/202412.0652	Tasa Variable	22,578.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202403/01/202511.9868	Tasa Variable	596,170.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202406/01/202511.9868	Tasa Variable	609,240.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202406/01/202511.9868	Tasa Variable	363,244.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202403/03/202511.8986	Tasa Variable	3,362.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/202412.0652	Tasa Variable	45,599.26
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/202412.0652	Tasa Variable	1,062,965.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/202412.0652	Tasa Variable	1,136,628.44
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202404/11/202412.0652	Tasa Variable	50,097.59
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO11/09/202403/12/202411.9868	Tasa Variable	14,106.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/09/202410/12/202411.0675	Tasa Variable	15,092,229.17
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202411/03/202511.065	Tasa Variable	2,011,679.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202404/11/202412.0723	Tasa Variable	22,375.03
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202413/12/202411.9955	Tasa Variable	165,740.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202406/01/202511.9955	Tasa Variable	205,605.70
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202411/03/202511.9026	Tasa Variable	53,860.69
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202404/02/202511.9026	Tasa Variable	591,684.52
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202406/11/20245.67544	Tasa Variable	19,695,204.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202425/10/202412.0723	Tasa Variable	171,126.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202425/10/202412.0723	Tasa Variable	170,423.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202425/11/202411.9955	Tasa Variable	65,733.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202404/12/202411.9955	Tasa Variable	116,437.71
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202411/12/202410.84	Tasa Variable	1,440,433.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202408/01/202511.9955	Tasa Variable	89,662.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202430/12/202411.9955	Tasa Variable	109,961.15
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO12/09/202404/12/202411.9955	Tasa Variable	38,650.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202410/12/202411.065	Tasa Variable	5,029,199.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202407/02/202510.84	Tasa Variable	40,012,044.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202407/03/202510.84	Tasa Variable	40,012,044.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/09/202411/03/202511.065	Tasa Variable	3,520,439.51
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/11/202412.0686	Tasa Variable	24,736.85
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202407/01/202511.9906	Tasa Variable	254,211.46
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	3,087,287.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	191,669.53
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	70,385.16

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 82 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	15,641.15
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202407/11/20245.63544	Tasa Variable	19,695,182.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202410/12/202410.84	Tasa Variable	1,440,433.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/11/202412.0686	Tasa Variable	2,265,041.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	1,297,969.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	319,665.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202411/03/202511.897	Tasa Variable	281.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/02/202511.897	Tasa Variable	2,519,350.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/02/202511.897	Tasa Variable	5,973.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202412/11/202410.84	Tasa Variable	10,003,011.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202412/03/202511.065	Tasa Variable	6,033,195.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202411/12/202411.065	Tasa Variable	4,474,619.63
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202411/12/202411.065	Tasa Variable	8,044,260.00
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202431/10/202412.0686	Tasa Variable	8,277.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202411/11/202412.0686	Tasa Variable	141,842.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202431/10/202412.0686	Tasa Variable	437,347.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/11/202412.0686	Tasa Variable	25,083.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202411/11/202412.0686	Tasa Variable	6,003.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202409/01/202511.9906	Tasa Variable	21,044.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/01/202511.9906	Tasa Variable	1,768,069.43
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/12/202411.9906	Tasa Variable	100,412.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202404/12/202411.9906	Tasa Variable	492,947.02
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202409/12/202411.9906	Tasa Variable	17,446.08
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202411/03/202511.897	Tasa Variable	19,755.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO13/09/202406/03/202511.897	Tasa Variable	6,812,411.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO13/09/202421/02/202511.05	Tasa Variable	5,012,277.78
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202418/10/202412.0642	Tasa Variable	15,195.57
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202404/10/202412.0642	Tasa Variable	27,841.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202425/10/202412.0642	Tasa Variable	29,718.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202414/10/202412.0642	Tasa Variable	7,404.92
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202411/11/202412.0642	Tasa Variable	1,208,306.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202407/01/202511.9745	Tasa Variable	597,599.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202419/11/202411.9745	Tasa Variable	262,602.50
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	168,962.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	369,859.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	959,906.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202404/02/202511.8759	Tasa Variable	42,048.96
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202428/10/202412.0642	Tasa Variable	14,836.32
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	270,987.81
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	70,331.16
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	48,915.25
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202408/11/20245.60544	Tasa Variable	15,362,229.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202411/11/202412.0642	Tasa Variable	146,574.07
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202413/12/202411.9745	Tasa Variable	359,378.65
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202404/12/202411.9745	Tasa Variable	65,861.73
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202404/12/202411.9745	Tasa Variable	197,169.61
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202406/01/202511.9745	Tasa Variable	56,098.67
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202414/03/202511.8759	Tasa Variable	534,851.97

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 83 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202411/03/202511.8759	Tasa Variable	33,173.04
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202416/12/202411.0725	Tasa Variable	451,937.69
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202413/12/202411.0725	Tasa Variable	20,086,119.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202414/01/202511.0725	Tasa Variable	3,012,917.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/09/202416/12/202410.84	Tasa Variable	1,440,433.60
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202411/11/202412.0529	Tasa Variable	51,219.80
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202405/11/202412.0529	Tasa Variable	5,892,022.13
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202428/10/202412.0529	Tasa Variable	257,098.99
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	96,624.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202404/12/202411.9343	Tasa Variable	157,206.95
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202410/03/202511.8132	Tasa Variable	297,615.75
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202411/11/20246.06337	Tasa Variable	332,895.54
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/01/20255.88149	Tasa Variable	121,441.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202414/03/202511.0606	Tasa Variable	14,055,917.48
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202411/11/202412.0529	Tasa Variable	65,394.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202407/10/202412.0529	Tasa Variable	831.90
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202404/11/202412.0529	Tasa Variable	89,095.11
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202428/10/202412.0529	Tasa Variable	350,869.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202419/11/202411.9343	Tasa Variable	39,231.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	70,270.87
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	137,428.89
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO17/09/202417/10/202412.0642	Tasa Variable	991.74
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202415/01/202511.0606	Tasa Variable	4,517,973.48
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202417/12/202410.84	Tasa Variable	1,440,433.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202428/02/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202403/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202412/11/20245.58544	Tasa Variable	19,695,155.23
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202404/10/202412.0529	Tasa Variable	14,477.04
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202404/10/202412.0529	Tasa Variable	437,292.72
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202409/12/202411.9343	Tasa Variable	19,985.45
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/01/202511.9343	Tasa Variable	71,138.93
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO18/09/202406/02/202511.8132	Tasa Variable	32,595.65
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202404/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202416/01/202511.0606	Tasa Variable	1,003,994.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202405/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202406/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202407/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202410/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202411/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 84 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202412/03/202510.84 Tasa Variable 5,001,505.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202413/03/202510.84 Tasa Variable 5,001,505.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/09/202414/03/202510.84 Tasa Variable 5,001,505.56	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202416/01/202511.0525 Tasa Variable 5,520,262.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/11/20246.01963 Tasa Variable 18,198.45	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202415/11/202412.0428 Tasa Variable 920,421.81	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202428/10/202412.0428 Tasa Variable 1,928,441.48	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/11/202412.0428 Tasa Variable 307,862.75	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202410/01/202511.9175 Tasa Variable 698,089.22	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/12/202411.9175 Tasa Variable 2,360.25	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175 Tasa Variable 186,857.45	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175 Tasa Variable 1,361,289.21	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202414/03/202511.7859 Tasa Variable 801,987.44	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859 Tasa Variable 39,972.42	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/11/202412.0428 Tasa Variable 147,037.37	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202411/11/202412.0428 Tasa Variable 6,714.25	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202409/12/202411.9175 Tasa Variable 64,944.72	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175 Tasa Variable 50,843.16	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175 Tasa Variable 134,855.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859 Tasa Variable 52,114.46	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859 Tasa Variable 9,409.80	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202418/03/202511.0525 Tasa Variable 2,007,368.33	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/11/202412.0428 Tasa Variable 1,616,225.73	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202406/01/202511.9175 Tasa Variable 134,107.65	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202418/03/202511.7859 Tasa Variable 16,913.94	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859 Tasa Variable 1,253,210.65	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO19/09/202404/02/202511.7859 Tasa Variable 109,354.90	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/09/202431/07/202511.0149 Tasa Variable 25,091,790.83	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202417/01/202511.045 Tasa Variable 6,521,936.60	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202411/11/202412.0286 Tasa Variable 156,991.96	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202405/11/202412.0286 Tasa Variable 793,469.50	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202414/10/202412.0286 Tasa Variable 51,558.54	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202419/11/202412.0286 Tasa Variable 629,325.67	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202425/11/202411.8917 Tasa Variable 2,284.53	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917 Tasa Variable 453,585.73	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917 Tasa Variable 648,169.80	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202415/11/202412.0286 Tasa Variable 634,078.40	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202411/11/202412.0286 Tasa Variable 1,162,243.54	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202419/11/202412.0286 Tasa Variable 25,481.89	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202422/11/202411.8917 Tasa Variable 313,586.94	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917 Tasa Variable 40,443.60	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917 Tasa Variable 41,090.92	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202404/02/202511.7533 Tasa Variable 43,845.97	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/09/202419/12/202410.84 Tasa Variable 720,216.80	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202419/11/202412.0286 Tasa Variable 317,207.67	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202419/11/202412.0286 Tasa Variable 1,337.17	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917 Tasa Variable 2,419,285.42	
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917 Tasa Variable 30,888.36	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 85 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202413/01/202511.8917	Tasa Variable	2,754.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	594,843.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	312,573.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202406/01/202511.8917	Tasa Variable	63,530.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202416/12/202411.8917	Tasa Variable	19,592.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO20/09/202404/02/202511.7533	Tasa Variable	906,397.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/09/202419/12/202411.045	Tasa Variable	20,067,497.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	19/09/202418/12/202410.84	Tasa Variable	1,440,433.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	20/09/202431/08/202911.01	Tasa Variable	137,609,632.27
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202419/11/20245.95327	Tasa Variable	67,697.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202415/11/202412.0178	Tasa Variable	2,980,254.68
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/10/202412.0178	Tasa Variable	464,075.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/11/202412.0178	Tasa Variable	37,222.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202419/11/202412.0178	Tasa Variable	5,161.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/12/202411.8698	Tasa Variable	714,228.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	1,300,518.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	168,667.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	111,918.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/12/202411.8698	Tasa Variable	620,519.48
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202416/12/202411.8698	Tasa Variable	192,774.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/11/202412.0178	Tasa Variable	22,572.33
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/11/202412.0178	Tasa Variable	18,894.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/11/202412.0178	Tasa Variable	45,101.14
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/11/202412.0178	Tasa Variable	18,826.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202413/01/202511.8698	Tasa Variable	4,239.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	96,907.25
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	34,969.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	283,510.09
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/12/202411.8698	Tasa Variable	10,685.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/12/202411.8698	Tasa Variable	279,909.32
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/12/202411.8698	Tasa Variable	1,870.60
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202413/12/202411.8698	Tasa Variable	46,247.15
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202425/11/202411.8698	Tasa Variable	262,124.13
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	103,865.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202406/01/202511.8698	Tasa Variable	370,352.74
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202412/03/202511.7195	Tasa Variable	346,617.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO23/09/202404/02/202511.7195	Tasa Variable	116,074.18
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/09/202420/12/202411.05	Tasa Variable	20,049,111.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	23/09/202421/03/202511.05	Tasa Variable	14,859,660.31
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/09/202423/12/202411.0364	Tasa Variable	400,858.39
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	24/09/202421/01/202511.0364	Tasa Variable	6,513,948.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202414/10/20246.05722	Tasa Variable	88,318.87
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202414/10/20246.05722	Tasa Variable	17,510.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202419/11/20245.89125	Tasa Variable	165,558.97
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202411/11/20245.89125	Tasa Variable	22,787.11
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202425/10/202411.9734	Tasa Variable	41,472.24
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202410/01/202511.7766	Tasa Variable	259,300.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	983,613.44
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	3,943,480.11

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 86 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202404/12/202411.7766	Tasa Variable	32,538.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202411/11/202411.9734	Tasa Variable	41,421.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202404/11/202411.9734	Tasa Variable	16,349.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	52,497.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202418/03/202511.6386	Tasa Variable	692.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202413/01/202511.7766	Tasa Variable	290,432.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO24/09/202406/01/202511.7766	Tasa Variable	646,784.08
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202422/01/202511.035		Tasa Variable	6,511,954.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202421/03/202511.035		Tasa Variable	500,919.58
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202407/03/202511.035		Tasa Variable	500,919.58
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202411/10/20246.05478	Tasa Variable	174,282.37
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202414/10/20246.05478	Tasa Variable	38,003.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202429/11/20245.86795	Tasa Variable	154,122.98
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/01/20255.73369	Tasa Variable	12,963.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202401/11/202411.9568	Tasa Variable	32,472.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/11/202411.9568	Tasa Variable	21,168.64
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202429/11/202411.7509	Tasa Variable	48,169.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202410/12/202411.7509	Tasa Variable	170,540.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	21,531.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	46,615.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,590,506.86
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202418/03/202511.607	Tasa Variable	6,384.39
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202405/03/202511.607	Tasa Variable	306,152.57
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	42,107.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/11/202411.9568	Tasa Variable	35,915.50
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202407/11/202411.9568	Tasa Variable	848,364.81
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202416/12/202411.7509	Tasa Variable	31,852.75
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/01/202511.7509	Tasa Variable	50.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	716,594.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,559.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202421/03/202511.607	Tasa Variable	2,359,802.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/03/202511.607	Tasa Variable	432,056.88
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202413/03/202511.607	Tasa Variable	6,428,804.41
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	2,184,408.38
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202422/11/202410.84		Tasa Variable	14,004,215.56
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202408/11/202411.9568	Tasa Variable	2,051,076.02
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202414/10/202411.9568	Tasa Variable	3,428.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/11/202411.9568	Tasa Variable	143,227.17
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	207,902.70
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,968.91
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202406/01/202511.7509	Tasa Variable	1,285.00
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/02/202511.607	Tasa Variable	17,775.83
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO25/09/202404/03/202511.607	Tasa Variable	533,841.89
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/09/202425/09/202911.205		Tasa Variable	95,778,533.00
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202410/03/202511.0199		Tasa Variable	500,765.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202424/03/202511.0199		Tasa Variable	500,765.27
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/09/202423/01/202511.0199		Tasa Variable	6,509,948.52
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202401/11/202411.9466	Tasa Variable	433,219.98

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 87 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/11/202411.9466	Tasa Variable	263,797.71
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/12/202411.7179	Tasa Variable	345.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202401/11/202411.9466	Tasa Variable	384,333.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202411/11/202411.9466	Tasa Variable	143,709.31
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/11/202411.9466	Tasa Variable	56,766.73
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202420/12/202411.7179	Tasa Variable	94,000.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202416/12/202411.7179	Tasa Variable	3,138.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	69,022.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	272,205.47
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202406/01/202511.7179	Tasa Variable	258,715.92
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/12/202411.7179	Tasa Variable	3,797.12
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/02/202511.5576	Tasa Variable	48,323.96
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202422/11/202411.9466	Tasa Variable	215,780.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202411/11/202411.9466	Tasa Variable	23,171.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202401/11/202411.9466	Tasa Variable	527,898.30
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202411/11/202411.9466	Tasa Variable	83,563.51
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202404/11/202411.9466	Tasa Variable	385,461.40
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202420/12/202411.7179	Tasa Variable	425,406.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO26/09/202425/03/202511.5576	Tasa Variable	17,827.60
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	26/09/202423/06/202510.51	Tasa Fija	20,029,194.44
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202426/12/202411.02	Tasa Variable	400,489.78
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202425/03/202511.02	Tasa Variable	500,612.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202426/03/202510.84	Tasa Variable	5,001,505.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202424/01/202511.02	Tasa Variable	6,007,346.67
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202411/03/202511.02	Tasa Variable	500,612.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/12/20245.84317	Tasa Variable	61,445.46
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202407/10/202411.9417	Tasa Variable	196,175.18
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202407/11/202411.9417	Tasa Variable	553,230.06
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202407/10/202411.9417	Tasa Variable	4,449.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	10,229.10
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	1,486,061.99
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202404/12/202411.7292	Tasa Variable	40,736.07
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	77,995.82
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/03/202511.5739	Tasa Variable	6,049,928.57
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO	27/09/202426/12/202411.02	Tasa Variable	20,024,488.89
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202414/11/202411.9417	Tasa Variable	685.85
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202417/01/202511.7292	Tasa Variable	252,221.35
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/01/202511.7292	Tasa Variable	1,138,075.78
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	144,775.61
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	147,755.38
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202404/02/202511.5739	Tasa Variable	189,742.20
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202419/11/202411.9417	Tasa Variable	4,654,788.04
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202425/11/202411.9417	Tasa Variable	687,281.26
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202425/11/202411.9417	Tasa Variable	188,493.72
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202404/11/202411.9417	Tasa Variable	1,245,176.36
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202425/11/202411.9417	Tasa Variable	81,770.93
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202420/01/202511.7292	Tasa Variable	3,205,562.22
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202423/12/202411.7292	Tasa Variable	351,046.01
NACIONAL FINANCIERA	S.N.C.NO27/09/202406/01/202511.7292	Tasa Variable	41,318.62

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 88 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/09/202404/12/202411.7292	Tasa Variable	327,277.97
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/09/202423/12/202411.7292	Tasa Variable	51,027.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO27/09/202404/02/202511.5739	Tasa Variable	53,094.73
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/09/202428/09/202913.74	Tasa Variable	32,962,575.92
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202412/03/202510.84		500,150.56
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202425/03/202510.84		500,150.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202425/11/20245.80367		741,633.83
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202422/11/202411.9625		21,474.22
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202425/11/202411.9625		673,757.05
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202420/12/202411.7831		106,169.88
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202420/01/202511.7831		53,267.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		58,628.63
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202420/01/202511.7831		919,173.39
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		758,233.29
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.84		5,001,505.56
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202422/11/202411.9625		3,562,213.34
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202425/11/202411.9625		108,672.31
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202417/01/202511.7831		620,500.30
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		159,965.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		10,625.64
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202428/03/202511.6369		2,667,856.84
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202425/03/202511.6369		7,670.97
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202427/01/202510.84		7,502,258.33
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202422/11/202411.9625		788,524.82
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		509,454.29
NACIONAL FINANCIERA S.N.C.NO30/09/202406/01/202511.7831		77,498.01
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202427/12/202410.84		20,006,022.22
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.84		100,030,111.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.84		100,030,111.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/09/202428/03/202510.84		100,030,111.11
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO17/10/201917/10/202411.0725	Tasa Variable	221,123.42
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/11/201926/11/202411.0199	Tasa Variable	500,765.26
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/12/201917/10/202411.0725	Tasa Variable	152,744.02
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO16/01/202016/01/202511.0725	Tasa Variable	4,761,154.30
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/01/202017/10/202411.0725	Tasa Variable	138,221.10
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/02/202026/11/202411.0199	Tasa Variable	569,290.84
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO11/03/202010/01/20255.06821	Tasa Variable	3,838,034.79
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/03/202026/03/20256.76	Tasa Fija	690,874.06
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/04/202004/04/202511.075		

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 89 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Tasa Variable 1,763,459.19	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202025/10/202411.02 Tasa Variable 206,502.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 775,986.09	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 2,253,490.23	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/04/202027/03/20255.8 Tasa Fija 1,821,869.63	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202007/05/202511.0725 Tasa Variable 1,006,766.55	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202026/11/202411.0199 Tasa Variable 138,393.26	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO19/05/202027/03/20255.66 Tasa Fija 2,029,610.60	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/06/202020/06/202511.05 Tasa Variable 1,503,683.16	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/06/202026/06/202511.0199 Tasa Variable 3,004,591.50	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202511.02 Tasa Variable 5,907,224.10	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202510.84 Tasa Variable 6,001,806.63	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202511.02 Tasa Variable 6,007,346.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO06/07/202027/03/202511.02 Tasa Variable 6,007,346.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 57,357.01	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/07/202021/07/20255.83 Tasa Fija 444,003.35	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/08/202025/08/202511.035 Tasa Variable 4,174,329.79	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/09/202019/09/202511.05 Tasa Variable 2,004,911.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO22/09/202019/09/202511.05 Tasa Variable 2,004,911.28	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/09/202006/12/202411.075 Tasa Variable 6,046,145.67	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO30/10/202030/10/202510.84 Tasa Variable 44,060,882.32	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/11/202004/11/202511.085 Tasa Variable 37,042,866.95	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO02/02/202130/01/202611.0977 Tasa Variable 5,717,325.76	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/202811.0725 Tasa Variable 124,812,363.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/03/202107/02/202811.0725 Tasa Variable 47,709,121.82	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/03/202110/03/202511.0638 Tasa Variable 5,489,895.36	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO31/03/202131/03/202610.84 Tasa Variable 3,150,948.54	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO05/04/202101/04/202611.08 Tasa Variable 44,688,098.64	
FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202131/03/20266.12 Tasa	

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
 FINANCIERA

PAGINA 90 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fija 979,259.60	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/04/202131/03/20266.12 Tasa
Fija 8,022,270.13	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO15/04/202115/04/202511.0725
Tasa Variable 329,537.87	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/04/202123/04/202611.05 Tasa
Fija 5,593,367.73	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO28/04/202128/04/202610.84 Tasa
Fija 851,598.43	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/05/202115/04/202511.0725
Tasa Variable 805,537.17	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/05/202120/05/202611.045
Tasa Variable 100,337,486.21	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 5,273,538.77	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO21/05/202128/02/202511.4069
Tasa Variable 1,010,761.46	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO25/05/202130/04/20266.28 Tasa
Fija 4,966,342.43	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 75,540,837.06	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO26/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 82,927,519.30	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO27/05/202126/05/20266.14 Tasa
Fija 93,412,925.74	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO04/06/202115/05/202511.0725
Tasa Variable 334,768.59	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO10/06/202110/06/202511.0638
Tasa Variable 1,366,389.29	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/07/202109/07/20267.04 Tasa
Fija 1,795,976.19	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO12/07/202129/06/202610.84 Tasa
Variable 47,614,332.89	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202131/12/202510.84 Tasa
Variable 171,688,181.66	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/07/202131/12/202510.84 Tasa
Variable 57,872,420.78	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/07/202129/07/202610.84 Tasa
Variable 6,601,987.35	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO23/08/202123/04/202611.05 Tasa
Variable 809,482.78	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/09/202114/09/20266.57 Tasa
Fija 5,591,669.27	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO14/09/202115/07/202611.0725
Tasa Variable 200,562,915.57	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO09/09/202109/09/202611.0725
Tasa Variable 139,301,905.01	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO08/10/202114/09/20267.17 Tasa
Fija 2,952,488.10	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa
Fija 25,005,131.95	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO29/10/202129/10/20267.39 Tasa
Fija 25,005,131.95	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO18/11/202129/07/202610.84 Tasa
Variable 6,949,460.45	FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO07/12/202107/12/20267.38 Tasa

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 91 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

Fija 1,151,635.44

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202120/12/20287.4 Tasa

Fija 9,127,735.07

FIDEICOMISOS INSTITUIDOS EN RELACIÓN CON LA AGRICULTURANO20/12/202120/12/20287.4 Tasa

Fija 24,528,049.91

TOTAL 4,204,813,429.98 2,947,685,707.88 3,498,006,510.31 1,736,281,762.58

9,374,290,035.03 3,336,385,781.19 277,834,045.74 91,832,539.09 3,005,482,824.78

159,938,247.66 302,254,436.35 449,890,132.36

Total bancarios 4,204,813,429.98 2,947,685,707.88 3,498,006,510.31 1,736,281,762.58

9,374,290,035.03 3,336,385,781.19 4,220,834,227.74 5,043,314,963.09

4,995,456,958.78 159,938,247.66 302,254,436.35 449,890,132.36

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]

Bursátiles y colocaciones privadas [sinopsis]

Bursátiles listadas en bolsa (quirografarios)

CEBUR_SCOTIAB_23No18/08/202302/03/2026TIIIE28 + 0.047,125,499,300

CEBUR_SCOTIAB_24No26/02/202425/02/2027TIIIE Fondeo + 0.325,189,390,200

CEBUR_SCOTIAB_24-2No26/02/202417/02/2031TF 9.24 + 0.51,008,708,700

CEBUR_SCOTIAB_24-2No26/02/202417/02/2031TF 9.24 + 0.53,801,901,100

CEBUR_SCOTIAB_24-3No13/09/202405/09/2031TF 9.893,969,611,100

CEBUR_SCOTIAB_24VNo13/09/202413/09/2027TIIIE Fondeo + 0.324,324,520,000

PRLV_BSCTIA_24412No11/04/202408/10/202411.304,804,697

PRLV_BSCTIA_24412No11/04/202408/10/202411.30207,703,168

PRLV_BSCTIA_24414No12/10/202310/10/202411.8055,839,164

PRLV_BSCTIA_24422No16/08/202415/10/202410.9850,904,168

PRLV_BSCTIA_24431No22/08/202421/10/202410.9450,899,996

PRLV_BSCTIA_24434No26/10/202324/10/202411.8555,955,424

PRLV_BSCTIA_24452No09/05/202405/11/202411.27527,674

PRLV_BSCTIA_24452No09/05/202405/11/202411.2786,487,449

PRLV_BSCTIA_24463No16/07/202413/11/202411.0841,466,662

PRLV_BSCTIA_24472No22/05/202419/11/202411.303,804,529

PRLV_BSCTIA_24472No23/02/202419/11/202411.4654,222,480

PRLV_BSCTIA_24472No22/05/202419/11/202411.30107,400,975

PRLV_BSCTIA_24473No22/08/202420/11/202410.9751,351,243

PRLV_BSCTIA_24475No27/02/202422/11/202411.4057,380,230

PRLV_BSCTIA_24482No30/05/202426/11/202411.3045,386,489

PRLV_BSCTIA_24482No30/05/202426/11/202411.30113,019,644

PRLV_BSCTIA_24512No20/06/202417/12/202411.4018,649,465

PRLV_BSCTIA_24512No20/06/202417/12/202411.40166,156,236

PRLV_BSCTIA_24515No21/12/202320/12/202411.4590,981,604

PRLV_BSCTIA_24522No26/12/202324/12/202411.45468,935,725

PRLV_BSCTIA_24525No29/08/202427/12/202410.9553,785,021

PRLV_BSCTIA_24532No04/07/202431/12/202411.275,276,398

PRLV_BSCTIA_24532No04/07/202431/12/202411.2751,302,430

PRLV_BSCTIA_25012No11/07/202407/01/202511.27164,412,625

PRLV_BSCTIA_25015No16/07/202410/01/202511.1842,185,434

PRLV_BSCTIA_25031No22/07/202420/01/202511.2657,497,847

PRLV_BSCTIA_25032No25/07/202421/01/202511.284,902,333

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 93 / 93

CONSOLIDADO

Impresión Final

interés y/o sobretasaDenominación [eje]
 Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
 Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
 Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]
 Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año
 [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años
 o más [miembro]
 Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo [sinopsis]
 Otros pasivos circulantes y no circulantes con costo

TOTAL - - - - -
 Total otros pasivos circulantes y no circulantes con costo - - - - -
 - - - - -

Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de
 interés y/o sobretasaDenominación [eje]
 Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
 Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
 Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]
 Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año
 [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años
 o más [miembro]
 Proveedores [sinopsis]
 Proveedores

TOTAL - - - - -
 Total proveedores - - - - -
 Institución Extranjera (Si/No)Fecha de firma/contratoFecha de vencimientoTasa de
 interés y/o sobretasaDenominación [eje]
 Moneda nacional [miembro]Moneda extranjera [miembro]
 Intervalo de tiempo [eje]Intervalo de tiempo [eje]
 Año actual [miembro]Hasta 1 año [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]
 Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años o más [miembro]Año actual [miembro]Hasta 1 año
 [miembro]Hasta 2 años [miembro]Hasta 3 años [miembro]Hasta 4 años [miembro]Hasta 5 años
 o más [miembro]
 Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo [sinopsis]
 Otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo

TOTAL - - - - -
 Total otros pasivos circulantes y no circulantes sin costo - - - - -
 - - - - -
 Total de créditos17,240,054,300.9817,285,019,238.8810,623,505,810.3111,250,191,962.58
 9,374,290,035.0318,931,606,681.194,220,834,227.745,043,314,963.094,995,456,958.78
 629,518,033.47302,254,436.35449,890,132.36

Comentarios:
 El tipo de cambio tomado al cierre de septiembre es de 19.6921

(VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 1 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

Instrumentos
Financieros Derivados

I. INFORMACIÓN CUALITATIVA

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

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

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

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

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

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

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

1) Ofrecer en el mercado instrumentos financieros derivados, con un perfil riesgo-rendimiento específico, para satisfacer las necesidades de los clientes de acuerdo

con su perfil de riesgo.

2) Ofrecer soluciones a clientes que les permitan cumplir sus objetivos de reducir, eliminar o modificar los riesgos asumidos respetando el perfil de riesgo de cada cliente.

3) Realizar negociación o arbitraje con productos derivados con el propósito de generar mayores ingresos.

4) Cubrir productos específicos o riesgos generales, así como optimizar la gestión del fondeo.

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

1) Negociación: La compra/venta del instrumento esperando obtener una ganancia como consecuencia de un cambio favorable en el precio.

2) Cobertura: Se desea asegurar, el día en que se pacta, el precio futuro de un activo subyacente y, en su caso, su disponibilidad, con el fin de reducir riesgos.

3) Arbitraje: Posiciones largas y cortas en dos mercados distintos.

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

1) Manual de Operación de Derivados.

2) Política de Administración de Riesgo de Mercado y Estructural.

3) Manual de Funciones y Procedimientos de la Dirección de Riesgos de Mercado (TFRM).

4) Política de Gestión del Riesgo de Nuevas Iniciativas

5) Política de Riesgo de Contraparte

6) Política de Sobregiros

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

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

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

Núm. Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

1. Flujos de Efectivo Pagarés con rendimiento liquidable al vencimiento de tasa fija Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

2. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado tanto a la tasa fija del bono (posible incremento en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) como a los potenciales impactos en las

variaciones del tipo de cambio de la moneda del subyacente. Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

3. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante Activa Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)

4. Valor Razonable Cartera Comercial o Bonos de tasa fija en Moneda Nacional o Extranjera Activa Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

5. Flujos de Efectivo Certificados Bursátiles de tasa flotante denominados en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

6. Valor Razonable Bonos de tasa fija en moneda funcional Pasiva Cobertura ante una posible baja en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa flotante y recibiendo tasa fija)

7. Flujos de Efectivo Reportos Pasiva Cobertura ante una posible alza en las tasas de interés Swap de tasas de interés (pagando tasa fija y recibiendo tasa flotante)

Núm. Tipo de Cobertura Posición Cubierta Tipo de posición cubierta Condición de Mercado Derivado

8. Flujos de Efectivo Cartera Comercial de tasa flotante en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la tasa variable del crédito (cambios en tasas de mercado del subyacente en moneda extranjera) así como a las variaciones de tipo de cambio principalmente USD-MXN Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa flotante en moneda extranjera y recibiendo tasa flotante en moneda nacional)

9. Flujo de Efectivo Bonos de tasa fija en moneda extranjera Activa Cubrir el riesgo asociado a la volatilidad en flujos de efectivo por variaciones en el nivel de tipo de cambio al convertir una moneda extranjera a pesos Cross Currency Interest Rate Swap (pagando tasa fija en moneda extranjera y recibiendo tasa fija en moneda nacional)

En lo que respecta a los productos de negociación aprobados Casa se encuentran: Subyacente Futuros Opciones Swaps

MRMRMRMEMRME

Acciones, un grupo o canasta de acciones, títulos referenciados a acciones que coticen en una bolsa de valores.

Índices de precios sobre acciones que coticen en una bolsa de valores.

Tasas de interés nominales, reales o sobretasas, tasas referidas a cualquier título de deuda e índices con base en dichas tasas

Operaciones de Opción sobre futuros de índice.

Moneda nacional, Divisas y UDIS;

Oro y Plata

Operaciones a Futuro sobre Contratos de Intercambio (Swaps) en especie y por diferenciales.

1). Los productos específicos, monedas, plazos y subyacentes aprobados se encuentran descritos en las hojas de control de límites emitidas y aprobadas por BNS. Se precisa que todos los instrumentos financieros derivados SCSwaps, CCS (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:

- 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
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 5 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Scotiabank-

Brechas de liquidez acumuladas

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD) 60,45458,042

Liquidity Buffer 134,348130,471

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

INVENTARIO DE MODELOS DE DERIVADOS

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

INSTRUMENTOS VALUADOS A VALOR RAZONABLE

Producto Subyacente Moneda Modelo de Valuación Factor de Valuación Fuente de Precios

Cross Currency Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

FX Rate VALMER

Interest Rate Swap (All Interest Rate) MXN, CAD, USD,

EUR, JPY, GBP Swap Interest Rate Curve VALMER

Interest Rate Cap/Floor (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's Interest Rate

Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

OTC Binary Interest rate Option (All Interest Rate) MXN, USD Cap/Floor Black's

Interest Rate Curve VALMER

Surface Bloomberg/Reuters

IRS Futures TIIE Fondeo MXN Price Price VALMER

Listed Interest Rate Swap (CME) TIIE Fondeo MXN Swap Interest Rate Curve VALMER

OTC European Index Call Spread Option OTC European Index Call Spread Option

MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Call Spread Option Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Basket Option Equity Index, Common Stock MXN, CAD, USD,

EUR, JPY Basket Asian AN/Alytic Multi-Factor Curve VALMER

Price K2

Surface Trader's mark

Correlation

Dividend

OTC European Equity Option Common Stock, Equity Index, ETF and Bond Index with

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,

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 6 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

EUR,JPY Equity OptionCurveVALMER
PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
OTC Single Stock Autocallable OptionCommon Stock, Equity Index, ETF MXN,CAD,USD,
EUR,JPY EqOpt Autocallable NoteCurveVALMER

PriceK2
SurfaceTrader's mark
Correlation
Dividend

Equity Index FutureEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Equity FutureEquity StockMXNPriceOPICSVALMER
Interest Rate Future(All Interest Rate)MXNPriceOPICSVALMER
Listed Equity Index Future OptionEquity IndexMXNPriceOPICSVALMER
Listed Single Stock OptionCommon StockMXNPriceOPICSVALMER

FX FuturesFX SpotUSD,BRL,CLP,COP,
MXN,PEN,AUD,EUR,
JPY,GBP,CHF,CADPriceOPICSVALMER

OTC Foreign Exchange (FX) American OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYCox, Ross and RubinsteinCurveVALMER
FX Rate

Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European Barrier OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYMerton, Reiner and Rubinstein CurveVALMER
FX Rate

Surface
OTC Foreign Exchange (FX) European OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYGarman and KohlhagenCurveVALMER
FX Rate

Surface
OTC FX Binary OptionFX SpotMXN,CAD,USD,
EUR,JPYBlack-ScholesCurveVALMER
FX Rate

Surface
Price
Foreign Exchange (FX) Forward/Non Delivery ForwardFX SpotMXN,USD,CAD,EUR,
BRL,CLP,COP,PEN,
AUD,JPY,GBP,CHF ForexCurveVALMER

FX Rate

FX Rate

FX Rate

INSTRUMENTOS VALUADOS A COSTO

ProductoSubyacenteMonedaMódulo de ValuaciónFactor de ValuaciónFuente de Precios
Listed Structured Notes Common Stock MXN,CAD,USD,
EUR,JPY PricePriceVALMER

POLÍTICAS LÍNEAS DE CRÉDITO

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

estableciendo:

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

a) Con Instituciones de Crédito y Casas de Bolsa:

- Necesidades de tesorería del Banco
- Relación de corresponsalía
- Límites recíprocos

b) Con Personas Físicas con Actividad Empresarial y/o Personas Morales:

- Operaciones puramente financieras, dentro del objeto social, naturaleza y destino de los negocios de la contraparte.

c) Con entidades del Gobierno Federal y del Sector Público:

- Operaciones financieras para cubrir aspectos de tipo regulatorio y de cobertura.

PRODUCTOS DEL MERCADO FINANCIERO AUTORIZADOS PARA OPERAR EN EL BANCO

1) Tesorería: Call Money

2) Valores: Compra de Valores y Reporto de Valores

3) Derivados: Derivados MexDer y Derivados Extrabursátiles

4) Cambios: FOREX

5) Comercio Exterior: Créditos Documentarios (Confirmación Notificación)

6) Garantías otorgadas por el Banco: Derivados Extrabursátiles y Reportos

7) Metales

SUJETOS DE CRÉDITO

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

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

REGLAS PARTICULARES

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

IDONEIDAD DEL CLIENTE

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

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

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

POLÍTICAS DE VAR

Para efectos de la gestión del Riesgo de Mercado se calcula el VaR a las

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

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

B) DESCRIPCIÓN DE POLÍTICAS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN

MÉTODOS Y TÉCNICAS DE VALUACIÓN:

CÁLCULO DE SENSIBILIDADES

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

PORTAFOLIO DE RENTA FIJA (BONOS)

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

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

BONOS DE TASA FLOTANTE

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

Con metodología se asume que la 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.

EFFECTIVIDAD DE LA COBERTURA:

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

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

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

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

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

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 2024 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas. Durante el tercer trimestre de 2024 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, se determina como parte de la afectación/cambio en el valor del derivado de cobertura y consecuentemente en resultados, la pérdida esperada asociada al instrumento (deterioro). Dicha pérdida esperada se determina con base en el cálculo del Ajuste por Valuación Crediticia o CVA (por sus siglas en inglés), el cual a su vez se determina con base en los sistemas especializados internos.

C) INFORMACIÓN DE RIESGOS POR EL USO DE DERIVADOS

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

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

Al cierre de septiembre de 2024 y promedio del tercer trimestre 2024 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank-

(millones de pesos) Posición

(Cierre) Posición

(Promedio)

Liquidity Buffer 134,348,130,471

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)NormalEscenario

PosibleEscenario

ProbableEscenario

Estrés

Gap 30d Gap Acum60,45454,84554,84454,842

Cambios en el Gap respecto al escenario normal(5,609)(5,610)(5,612)

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 γ_1 y γ_5 .

γ_1 mide cual es el cambio de la exposición delta del portafolio, ante un cambio de 1% en el valor del subyacente, mientras que γ_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

Cifras expresadas en pesos

A) ANÁLISIS DE SENSIBILIDADES DEL PORTAFOLIO DE OPERACIONES DERIVADAS DE TASA.
Resumen Sensibilidades (PV01) - Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a septiembre 30, 2024

	0 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(347,953.69)	(69,941.60)	(177,804.18)	10,870.24	(584,848.44)	(1,169,677.67)
CCS	(332.92)	150.99	207.59	17.85	43.55	587.06
Caps&Floors	(5,341.44)	438.87	(5.40)	(0.35)	(4,900.55)	(9,808.87)
Binary Caps&Floors	-----					
TIIE Futures	-----					
Total DERIVATIVES	(353,628.05)	(69,351.74)	(177,601.99)	10,887.74	(589,705.44)	(1,179,399.48)

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 13 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD

SUPUESTOS DE CÁLCULO.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- a) Bajo el escenario probable una pérdida de (176.24) Millones de pesos.
- b) Con escenario poco probable un P&L de (352.49) Millones de pesos.
- c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (861.66) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad Instrumento Sensibilidad MTM Probable

Shock

(+/-) P&L Stress 1

Shock

(+/-) P&L Stress 2

Shock

(+/-) P&L

- 1pb a la tasa Futuros de TIIIE y Bono M --50.00-100.00-200.00-

- 1pb a la tasa IRS & CCS & Delta Caps (1.18) 121.68 50.00 (58.97) 100.00 (117.94) 200.00 (235.88)

Volatilidad al 1% Caps & Floors (0.01) 2.37 0.10 (0.00) 0.40 (0.00) 1.00 (0.01)

a FX %Forwards 1.85 36.53 0.10 (3.65) 0.20 (7.31) 0.50 (18.26)

a FX %Opciones Divisa --0.10-0.20-0.50 0.00

Total (62.62) (125.25) (254.15)

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

Opciones Delta Vega Gamma

Options AAPL.OQ ---

Options BNPUI5.INDX 6,588.00 23,902.00 220.00

Options ENHFO5.INDX ---

Options ENHGE5.INDX ---

Options INTC.OQ ---

Options MEXBOL.INDX ---

Options MSFDV1.INDX ---

Options QQQ.OQ ---

Options SHELL.AS ---

Options SPX.INDX ---

Options SPXFP.INDX ---

Options SPXSR5.INDX ---

Options STX50E.INDX ---

Total 6,588.00 23,902.00 220.00

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 14 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

Análisis de Stress

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

Escenarios a la baja(0.1)(0.3)(0.5)

Options AAPL.OQ---

Options BNPUI5.INDX(658.80)(1,976.40)(3,294.00)

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options INTC.OQ---

Options MEXBOL.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

Options SPX.INDX---

Options SPXFP.INDX---

Options SPXSR5.INDX---

Options STX50E.INDX---

Total(658.80)(1,976.40)(3,294.00)

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

Escenarios al alza0.050.150.2

Options AAPL.OQ---

Options BNPUI5.INDX329.40988.201,317.60

Options ENHFO5.INDX---

Options ENHGE5.INDX---

Options INTC.OQ---

Options MEXBOL.INDX---

Options MSFDV1.INDX---

Options QQQ.OQ---

Options SHELL.AS---

Options SPX.INDX---

Options SPXFP.INDX---

Options SPXSR5.INDX---

Options STX50E.INDX---

Total329.40988.201,317.60

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

EscenarioMonto

Probable(658.80)

Poco Probable(1,976.40)

Muy poco Probable(3,294.00)

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 2024 se tienen los siguientes saldos:

ContraparteColateral Recibido MXNColateral Enviado MXNColateral Recibido USD Colateral Enviado USD

CLIENTE 1--19,555,000(13,180,000)

CLIENTE 2970,000,000(812,000,000)--

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2024

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 15 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

CLIENTE 3--755,000-
CLIENTE 4--4,525,000-
CLIENTE 5- (34,900,000) --
CLIENTE 639,600,000 (533,854,889) 37,825,000 (32,575,000)
CLIENTE 7--27,210,000 (31,390,000)
CLIENTE 8--162,980,000 (194,570,000)
CLIENTE 9--114,300,000 (247,800,000)
CLIENTE 10--570,000-
SUBTOTAL1,009,600,000 (1,380,754,889) 367,720,000 (519,515,000)

Contraparte Colateral Recibido MXN Colateral Enviado MXN Colateral Recibido USD
Colateral Enviado USD

CLIENTE 11--5,910,000 (830,000)
CLIENTE 12--- (100,000)
CLIENTE 13--27,890,000 (26,650,000)
CLIENTE 14--- (580,000)
CLIENTE 1595,400,000 (49,200,000) --
CLIENTE 16230,300,000 (382,300,000) --
CLIENTE 17300,000 ---
CLIENTE 18339,600,000 (199,500,000) 111,810,000 (102,160,000)
CLIENTE 19333,214,685 (852,937,172) --
CLIENTE 201,000,000 ---
CLIENTE 2126,400,000 ---
CLIENTE 22--4,230,000 (5,200,000)
CLIENTE 23--1,750,000-
CLIENTE 24--680,000 (340,000)
CLIENTE 25--260,000 (2,960,000)
CLIENTE 26--6,500,000 (21,870,000)
TOTAL2,035,814,685 (2,864,692,061) 526,750,000 (680,205,000)

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

Producto Fecha Cliente Divisa Monto Motivo del incumplimiento
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 10/07/2024 Cliente 1MXN (51,234) Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 12/07/2024 Cliente 2MXN 115,617 Falla
del sistema propio
Pagos por Operaciones de Opción 17/07/2024 Cliente 3MXN 1,665,500 Pago cuenta erronea
Pagos por Operaciones Cambiarias 22/07/2024 Cliente 4MXN 893,740 Falta de liquidez
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 29/07/2024 Cliente 5MXN (1,000,742) En
espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 29/08/2024 Cliente 6MXN (1,099,126) En
espera de instrucción
Pagos por Operaciones de Opción 03/09/2024 Cliente 7MXN 2,828,143 No realizó unwind
Pagos por Operaciones de Opción 04/09/2024 Cliente 8USD 50,000 Otros
Pagos por Operaciones de Opción 04/09/2024 Cliente 9MXN (920,000) Otros
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 18/09/2024 Cliente 10EUR 114,653 Otros
Pagos por Operaciones de Opción 19/09/2024 Cliente 11MXN 18,650,000 Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción 19/09/2024 Cliente 12MXN (200,000) Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción 19/09/2024 Cliente 13USD (1,000,000) Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 26/09/2024 Cliente 14USD 4,098 Pago
incompleto
Pagos por Operaciones de Opción 26/09/2024 Cliente 15MXN 18,650,000 Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción 26/09/2024 Cliente 16MXN (200,000) Se rechazó pago
Pagos por Operaciones de Opción 26/09/2024 Cliente 17USD (1,000,000) Se rechazó pago
Pagos por Operaciones Adelantadas (Forwards) 27/09/2024 Cliente 18USD 14,824,848
Otros

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 16 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

Pagos por Operaciones de Intercambio (Swaps) 30/09/2024 Cliente 19MXN(1,039,802)
Otros

DESCRIBIR Y NUMERAR LOS INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS QUE HAYAN VENCIDO
DURANTE EL TRIMESTRE
Cifras expresadas en pesos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2024**

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

INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

PAGINA 17 / 17

CONSOLIDADO

Impresión Final

LIQUIDADOS ANTICIPADAMENTE

RESUMEN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS

Cifras expresadas en pesos

(VER ARCHIVO COMPLETO EN PDF)
