

Scotiabank Inverlat

BANCO LÍDER EN LAS AMÉRICAS

Scotiabank[®]

Scotiabank Indicadores Financieros	2021			2020	
	T3	T2	T1	T4	T3
ROE (Utilidad neta del trimestre anualizada / Capital contable promedio)	22.3	13.8	11.4	7.9	2.6
ROA (Utilidad neta del trimestre anualizada / Activo total promedio)	2.1	1.2	1.0	0.7	0.2
MIN (Margen financiero del trimestre ajustado por riesgos crediticios anualizado / Activos productivos promedio)	3.1	3.3	3.2	2.8	2.2
Eficiencia Operativa (Gastos de administración y promoción del trimestre anualizados / Activo total promedio)	1.5	2.8	3.0	3.0	3.0
Índice de Morosidad (Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)	3.98	3.78	3.57	3.05	2.62
Índice de Cobertura de Cartera de Crédito Vencida (Saldo de la estimación preventiva para riesgos crediticios al cierre del trimestre / Saldo de la cartera de crédito vencida al cierre del trimestre)	100.4	107.8	116.1	134.8	143.8
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	*18.20	17.67	16.83	15.94	15.91
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales (crédito, mercado y operacional)	*14.85	15.11	14.39	13.91	13.85
Liquidez (Activos líquidos / Pasivos líquidos)	66.6	78.1	69.1	64.0	76.5

* Sujeto a aprobación del Banco Central.

Scotiabank Información Financiera	3 meses				9 meses		
	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%	30 sep 2020	30 sep 2021	A/A Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)							
Ingresos por intereses	11,764	10,970	10,871	-8%	37,067	32,809	-11%
Gastos por intereses	(5,378)	(4,897)	(4,873)	9%	(18,304)	(14,428)	21%
Margen Financiero	6,386	6,073	5,998	-6%	18,763	18,381	-2%
Comisiones	906	1,196	1,309	44%	2,821	3,589	27%
Intermediación	646	377	395	-39%	1,826	976	-47%
OI OE	257	575	442	72%	1,140	1,482	30%
Ingresos no Financieros	1,809	2,148	2,146	19%	5,787	6,047	4%
Total Ingresos	8,195	8,221	8,144	-1%	24,550	24,428	0%
Gastos de Administración y Promoción	(4,880)	(4,659)	(2,427)	50%	(13,960)	(11,891)	15%
PTPP	3,315	3,562	5,717	72%	10,590	12,537	18%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(2,951)	(912)	(1,120)	62%	(8,011)	(3,381)	58%
Resultado de la Operación	364	2,650	4,597	> +100%	2,579	9,156	> +100%
Participación en el Resultado de Subsidiarias no Consolidadas, Asociadas y no Controladora	-	1	-	0%	1	-	-100%
Utilidad antes de Impuestos a la Utilidad	364	2,651	4,597	> +100%	2,580	9,156	> +100%
Impuestos a la Utilidad	(5)	(627)	(1,146)	> -100%	(643)	(2,069)	> -100%
Utilidad después de Impuestos a la Utilidad	359	2,024	3,451	> +100%	1,937	7,087	> +100%

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

En el tercer trimestre de 2021, la utilidad neta consolidada de Scotiabank Inverlat, S.A. de C.V. (Scotiabank), se ubicó en \$3,451 millones, un incremento de \$3,092 millones respecto al mismo periodo del año pasado, debido principalmente a la PTU diferida por la fusión de SECOSA con Banco, creación de reservas voluntarias en 2020, menores requerimientos de reservas en cartera de menudeo, mayores comisiones cobradas, así como menores gastos; compensados parcialmente por el incremento en impuestos y mayores requerimientos de reservas en cartera comercial.

Respecto al trimestre anterior, la utilidad neta mostró un incremento de \$1,427 millones o 71%, debido principalmente a la PTU diferida por la fusión de SECOSA con Banco; compensado parcialmente por el incremento en impuestos.

La utilidad neta acumulada al cierre de septiembre 2021 se ubicó en \$7,087 millones un incremento anual de \$5,150 millones o 266%; debido principalmente a la creación de reservas voluntarias en 2020; así como en 2021, menores gastos por servicios profesionales, el efecto de la PTU diferida por la fusión de SECOSA con Banco, la aplicación y liberación de reservas voluntarias, menores requerimientos de reservas en cartera de menudeo; compensados parcialmente por el incremento en impuestos y mayores requerimientos de reservas en cartera comercial.

Las principales variaciones se ven reflejadas en los cuadros siguientes:

Scotiabank Comisiones y Tarifas (netas)	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%	30 sep 2020	30 sep 2021	A/A Δ%
Comisiones de Crédito	91	186	147	62%	271	487	80%
Manejo de cuenta	80	72	109	36%	241	247	2%
Tarjeta de Crédito y Débito	389	444	434	12%	1,208	1,292	7%
Actividades fiduciarias	59	88	59	0%	161	195	21%
Servicios de banca electrónica	117	138	141	21%	348	399	15%
Compraventa de valores	12	13	7	-42%	37	34	-8%
Cartas de crédito sin refinanciamiento	44	52	44	0%	142	138	-3%
Otras	114	203	368	> +100%	413	797	93%
Total de Comisiones y Tarifas (netas)	906	1,196	1,309	44%	2,821	3,589	27%

Scotiabank Otros Ingresos/Egresos de la Operación	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%	30 sep 2020	30 sep 2021	A/A Δ%
Otras Recuperaciones	-	6	8	0%	3	14	> +100%
Gastos por Adquisición de Cartera de Crédito	(3)	-	1	> +100%	(13)	(1)	92%
Castigos y Quebrantos	(208)	(87)	(98)	53%	(407)	(380)	7%
Resultado neto por Venta de Bienes Adjudicados	20	33	24	20%	58	112	93%
Intereses por Préstamos a Empleados	1	-	19	> +100%	3	20	> +100%
Ingresos por Arrendamiento	20	19	3	-85%	62	41	-34%
Otras partidas de los Ingresos/Egresos de la operación	427	604	568	33%	1,557	1,759	13%
Pérdida por Cesión de Cartera de Crédito	-	-	(83)	0%	(123)	(83)	33%
Total de Otros Ingresos/Egresos de la operación	257	575	442	72%	1,140	1,482	30%

Scotiabank Gastos de Administración y Promoción	3 meses				9 meses		
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%	30 sep 2020	30 sep 2021	A/A Δ%
Gastos de Personal	(83)	(86)	121	> +100%	(250)	(68)	73%
Gastos de Operación	(4,797)	(4,573)	(2,548)	47%	(13,710)	(11,823)	14%
Total de Gastos de Administración y Promoción	(4,880)	(4,659)	(2,427)	50%	(13,960)	(11,891)	15%

En el tercer trimestre de 2021, la estimación preventiva para riesgos crediticios se ubicó en \$1,120 millones, una disminución de \$1,831 millones o 62% respecto al mismo periodo del año anterior; debido a la creación de reservas voluntarias registradas en 2020, así como menores requerimientos en cartera de consumo, tarjeta de crédito, automotriz e hipotecaria; compensados parcialmente con un mayor requerimiento de cartera comercial, en el trimestre.

La estimación preventiva para riesgos crediticios muestra un incremento de \$208 millones o 23% respecto al trimestre anterior, debido principalmente a mayores requerimientos en cartera comercial; compensado parcialmente por una mayor liberación de reservas adicionales, menores requerimientos en cartera hipotecaria, tarjeta de crédito, consumo y automotriz.

La estimación preventiva para riesgos crediticios acumulada al cierre de septiembre 2021, ascendió a \$3,381 millones, una disminución anual de \$4,630 millones o 58%, debido principalmente a la creación de reservas voluntarias registradas en 2020; así como la aplicación y liberación de reservas voluntarias en 2021, menores requerimientos en tarjeta de crédito, consumo y automotriz; compensados parcialmente por mayores requerimientos en cartera comercial e hipotecaria.

Scotiabank Impuestos	3 meses				9 meses		
	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%	30 sep 2020	30 sep 2021	A/A Δ%
(millones de pesos; consolidado con subsidiarias)							
Impuesto a la Utilidad Causado	(508)	(247)	(761)	-50%	(1,907)	(1,464)	23%
Impuesto a la Utilidad Diferido	503	(380)	(385)	> -100%	1,264	(605)	> -100%
Total de Impuestos a la Utilidad	(5)	(627)	(1,146)	> -100%	(643)	(2,069)	> -100%

En el tercer trimestre de 2021, se registró un impuesto neto a cargo por \$1,146 millones, un incremento de \$1,141 millones respecto al mismo periodo del año pasado, principalmente por una mayor utilidad en el periodo.

Respecto al trimestre anterior, el total de impuestos netos incrementó en \$519 millones u 83%, principalmente por una mayor utilidad del periodo.

Los impuestos netos acumulados al cierre de septiembre 2021 ascendieron a \$2,069 millones, un incremento anual de \$1,426 millones, principalmente a una mayor utilidad del periodo, disminuido por una mayor inflación.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%
Disponibilidades, Valores y Derivados	222,901	248,321	197,885	-11%
Cartera Vigente	412,269	395,794	401,686	-3%
Cartera Vencida	11,085	15,533	16,655	50%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,940)	(16,741)	(16,725)	-5%
Otros Activos	36,139	41,413	50,170	39%
Activo Total	666,454	684,320	649,671	-3%
Depósitos	407,167	437,347	407,753	0%
Préstamos bancarios	65,675	56,310	50,255	-23%
Obligaciones Subordinadas	9,094	9,049	9,096	0%
Otros Pasivos	129,850	121,959	118,512	-9%
Capital	54,668	59,655	64,055	17%
Total Pasivo y Capital	666,454	684,320	649,671	-3%

Al 30 de septiembre de 2021, el total de activos de Scotiabank se ubicó en \$649,671 millones, una disminución de \$16,783 millones o 3% respecto al cierre de septiembre de 2020, debido principalmente a menores volúmenes en deudores por reporto, cartera de crédito vigente y en disponibilidades (divisas por entregar y recibir); compensados parcialmente por un incremento en deudores por liquidación de operaciones (Otros Activos).

Respecto al trimestre anterior, los activos totales disminuyeron \$34,649 millones o 5%, debido principalmente a menores volúmenes en disponibilidades (depósitos en Banco de México), inversiones en valores gubernamentales y deudores por reporto; compensados parcialmente por mayores volúmenes en cartera de crédito vigente y vencida, así como deudores por liquidación de operaciones y PTU diferida a favor por la fusión de SECOSA con Banco (Otros Activos).

El total del pasivo ascendió a \$585,616 millones al 30 de septiembre de 2021, una disminución de \$26,170 millones o 4% respecto al año pasado, debido principalmente a menores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones (Otros Pasivos), préstamos bancarios de largo y corto plazo, derivados con fines de negociación y cobertura (Otros Pasivos); compensados parcialmente por un mayor volumen en valores asignados por liquidar y acreedores por reporto (Otros Pasivos).

Respecto al trimestre anterior, el pasivo total disminuyó \$39,049 millones o 6%, debido principalmente a menores volúmenes en depósitos de clientes, préstamos bancarios de corto y largo plazo, valores asignados por liquidar (Otros Pasivos), así como títulos de créditos emitidos y en mercado de dinero (depósitos).

Scotiabank – Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%
Tarjeta de Crédito y Otros Préstamos Personales	41,904	35,532	34,865	-17%
Créditos a la Vivienda	144,258	149,082	156,185	8%
Total Préstamos de Menudeo	186,162	184,614	191,050	3%
Actividad Empresarial o Comercial	180,787	176,490	176,479	-2%
Entidades Financieras	31,618	23,203	22,119	-30%
Entidades Gubernamentales	13,702	11,487	12,038	-12%
Total de Préstamos Comerciales, Financieras y Gubernamentales	226,107	211,180	210,636	-7%
Total Cartera Vigente	412,269	395,794	401,686	-3%

La cartera vigente de préstamos de menudeo incrementó \$4,888 millones o 3% respecto al año pasado y \$6,436 millones o 3% respecto al trimestre anterior. Ambos incrementos se debieron a mayores volúmenes en cartera de vivienda; compensado parcialmente con menores volúmenes en tarjeta de crédito y otros préstamos personales.

El total de préstamos vigentes con entidades comerciales, financieras y gubernamentales mostró una disminución anual de \$15,471 millones o 7% en todos los portafolios y trimestral de \$544 millones; debido a menores volúmenes en créditos de entidades financieras y comerciales; compensados con mayores volúmenes en entidades gubernamentales.

Scotiabank – Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%
Cartera Vencida	11,085	15,533	16,655	50%
Estimación Preventiva para Riesgos Crediticios	(15,940)	(16,741)	(16,725)	-5%
Cartera Vencida Neta	(4,855)	(1,208)	(70)	99%
Cartera Vencida Bruta a Cartera Total	2.62%	3.78%	3.98%	136 pb

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021	A/A Δ%
Total Depósitos Vista y Ahorro	189,258	223,677	212,446	12%
Público en General	154,041	174,924	162,311	5%
Mercado de Dinero	27,230	4,801	2,006	-93%
Total Depósitos a Plazo	181,271	179,725	164,317	-9%
Títulos de Crédito Emitidos	36,030	33,336	30,142	-16%
Cuenta global de captación sin movimientos	608	609	848	39%
Total de Depósitos	407,167	437,347	407,753	0%

Al 30 de septiembre de 2021, el total de depósitos se ubica en \$407,753 millones, un incremento de \$586 millones respecto al año pasado, debido principalmente a mayores depósitos a la vista y ahorro por \$23,428 millones o 12%; compensado con menores depósitos a plazo por \$16,954 millones o 9% y títulos de crédito emitidos por \$5,888 millones o 16% debido al vencimiento de certificados bursátiles.

Respecto al trimestre anterior, el total de depósitos disminuyó \$29,594 millones o 7%, debido a menores volúmenes de depósitos a plazo por \$15,408 millones o 9% y depósitos a la vista y ahorro por \$11,231 millones o 5%; así como menores títulos de crédito emitidos por \$3,194 millones o 10% debido al vencimiento de certificados bursátiles.

Scotiabank
Composición de Inversiones en Valores
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Títulos para negociar	60,579	-	20	-	60,599
Sin restricción:	-	-	20	-	20
Restringidos:	60,579	-	-	-	60,579
<i>En operaciones de reporto</i>	53,098	-	-	-	53,098
<i>Préstamos de valores</i>	1,969	-	-	-	1,969
<i>Otros</i>	5,512	-	-	-	5,512
Títulos disponibles para la venta	46,910	15,522	-	1,446	63,878
Sin restricción:	46,838	15,522	-	1,446	63,806
Restringidos:	72	-	-	-	72
<i>En operaciones de reporto</i>	-	-	-	-	-
<i>Otros</i>	72	-	-	-	72
Títulos conservados a vencimiento	5,107	-	-	-	5,107
Sin restricción	5,107	-	-	-	5,107
Total	112,596	15,522	20	1,446	129,584

Scotiabank
Inversiones en Valores no Gubernamentales (Superiores al 5% del capital neto)
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I-BANSAN-21395	11,930,543,381	4.40%	21	11,929

Scotiabank
Derivados y operaciones de cobertura
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021; valor razonable)

	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total activo	Total Pasivo
	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva	Posición Activa	Posición Pasiva		
Con fines de Negociación	1,142	1,171	-	-	511	249	276	374	13,867	14,261	-	-	15,796	16,055
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	4,685	4,547	-	-	4,685	4,547

Scotiabank
Montos nacionales en operaciones derivadas
(Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 30 de septiembre de 2021)

	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	2,427	2,395	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	4	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	4	4	209	209	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	2	2	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	71	71	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	483	254	446	111	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	-	2,575	2,575	-	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	24,888	24,618	337,957	328,903	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	188	187	1,203	1,535	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	23	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	177,500	-	-	-
Con fines de cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	48,430	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	423	5	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	4	-	-	-

Scotiabank Cartera de Crédito Vigente (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	141,182	35,297	176,479
Créditos a entidades financieras	22,113	6	22,119
Créditos a entidades gubernamentales	12,038	-	12,038
Créditos al consumo	34,865	-	34,865
Créditos a la vivienda	156,159	26	156,185
Total	366,357	35,329	401,686

Scotiabank Cartera de Crédito Vencida (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)	Pesos	Dólares	Total
Actividad empresarial o comercial	6,307	1,564	7,871
Créditos a entidades financieras	47	-	47
Créditos al consumo	1,577	-	1,577
Créditos a la vivienda	7,100	60	7,160
Total	15,031	1,624	16,655

Scotiabank
Variaciones de Cartera Vencida
(millones de pesos)

Saldo al 30 de junio de 2021	15,533
Traspaso de Cartera Vigente a Vencida	2,760
Recuperaciones	(296)
Quitas y Castigos	(1,345)
Fluctuación Tipo de Cambio	3
Saldo al 30 de septiembre de 2021	16,655

Scotiabank
Estimaciones preventivas para riesgos crediticios
(millones de pesos)

Saldo al 30 de junio de 2021	16,741
Más: Creación de reservas	1,293
Menos: Liberaciones	-
Cancelaciones	175
Adjudicaciones y otros	23
Castigos y quitas	1,148
Comercial	145
Hipotecario	101
Consumo	902
Desliz cambiario	(37)
Saldo al 30 de septiembre de 2021	16,725

Scotiabank Información Financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Cartera de Crédito	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021
Cartera Vigente			
Metropolitano	61.7%	58.4%	60.2%
Noroeste – Centro	10.2%	12.0%	11.0%
Norte	15.0%	15.3%	14.6%
Bajío	7.8%	8.5%	8.1%
Sur	5.2%	5.8%	6.1%
Cartera Vencida			
Metropolitano	41.2%	41.7%	41.4%
Noroeste – Centro	15.4%	20.9%	17.1%
Norte	11.4%	9.5%	8.3%
Bajío	12.6%	9.1%	16.9%
Sur	19.4%	18.8%	16.3%

Scotiabank
Financiamientos otorgados que rebasan el 10% del Capital Básico
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

No. Acreditados / Grupos	Monto	% Capital Básico
1	10,331	18.49%
2	9,566	17.12%
3	6,855	12.27%
4	5,719	10.23%
Financiamiento a los 3 principales deudores / grupos		26,752

Scotiabank
Calificación de la Cartera Crediticia
Al 30 de septiembre de 2021
(millones de pesos)

	Importe Cartera Crediticia	Cartera Comercial	Reservas Preventivas Necesarias			Total Reservas Preventivas
			No Revolventes	Consumo Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes	Cartera de Vivienda	
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	323,652	924	114	403	259	1,700
Riesgo A2	56,687	575	28	175	13	791
Riesgo B1	19,171	255	42	61	12	370
Riesgo B2	12,308	129	47	40	61	277
Riesgo B3	8,814	142	32	42	59	275
Riesgo C1	5,109	161	37	81	45	324
Riesgo C2	3,088	3	27	157	205	392
Riesgo D	8,170	1,570	54	341	927	2,892
Riesgo E	8,353	3,541	1,013	775	1,178	6,507
Total	445,352	7,300	1,394	2,075	2,759	13,528
Exceso						3,197
Reservas Constituidas						16,725

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 2021.
- La cartera crediticia se califica conforme a la metodología establecida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores en el Capítulo V del Título Segundo de las Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, pudiendo calificarse por metodologías internas autorizadas por la Comisión.

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda vencida	\$ -
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	46
-Reservas por intereses devengados sobre créditos vencidos	364
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	<u>2,786</u>
Total	\$ 3,196

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 2021 mantiene el Banco en el rubro de “Inversiones en valores - Títulos conservados al vencimiento” son:

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

	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 220707	3,961,831	526	07-jul-22
B4 220804	21,792	3	04-ago-22
B4 270701	11,209,686	1,489	01-jul-27
BC 220804	3,115	-	04-ago-22
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	15,196,430	2,018	

Scotiabank Tasas Pagadas en Captación Tradicional (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

	Tasa Promedio		Udis
	Pesos	Dólares	
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	2.11%	0.03%	-
Depósitos a plazo	4.09%	0.00%	-

Scotiabank Préstamos Interbancarios y de Otros Organismos (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Vencimiento	Préstamos		Financiamiento			Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	100	7,662	6,123	2,930	16,815
Largo	-	1,131	21,000	6,809	-	28,940
Total	-	1,231	28,662	12,932	2,930	45,755
Tasa Promedio	0.00%	4.71%	6.10%	4.91%	5.12%	
Otros						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	2,057	-	46	6	4	2,113
Largo	-	-	-	331	2,056	2,387
Total	2,057	-	46	337	2,060	4,500
Tasa Promedio	0.16%	0.00%	1.71%	0.99%	0.83%	
Total Préstamos Interbancarios	2,057	1,231	28,708	13,269	4,990	50,255

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 2021.

Scotiabank Información financiera por Línea de Negocio y Zona Geográfica de la Captación Tradicional	30 sep 2020	30 jun 2021	30 sep 2021
Depósitos a la Vista	50.2%	55.5%	56.5%
Metropolitano	21.4%	25.1%	25.4%
Noroeste – Centro	11.9%	11.2%	10.6%
Norte	7.7%	8.3%	8.8%
Bajío	3.6%	5.3%	5.8%
Sur	5.7%	5.6%	5.9%
Depósitos Ventanilla	41.6%	43.3%	43.0%
Metropolitano	21.8%	20.2%	19.0%
Noroeste - Centro	4.8%	5.6%	5.1%
Norte	7.3%	8.5%	8.4%
Bajío	2.4%	4.3%	5.0%
Sur	5.4%	4.7%	5.5%
Total de Captación del Público	91.9%	98.8%	99.5%
Fondeo Profesional	8.1%	1.2%	0.5%

Scotiabank Impuestos Diferidos (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)		
Pérdida de arrastre fiscal		(3)
Provisión por perdidas de crédito		4,994
Compensación diferida		(1,043)
Ingresos diferidos		541
Instalaciones y equipos / depreciación		689
Beneficios a los empleados		488
Provisiones		318
Otros		2,437
Efecto Neto en Diferido		8,421

Al 30 de septiembre de 2021, Scotiabank no cuenta con adeudos fiscales.

Scotiabank Resultados por Intermediación (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)		
	Resultados del periodo por Valuación	Resultados del periodo por Compra - Venta
Inversiones en valores	(81)	229
Operaciones con instrumentos financieros derivados de negociación y cobertura	(998)	684
Divisas y otros	(208)	1,350
Total	(1,287)	2,263

Emisión de Certificados Bursátiles

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

	Quinta*	Cuarta**	Septima**	Septima**	Primera***	Segunda***	Primera***	Segunda***
Clave de Pizarra	SCOTIAB 13-2	SCOTIAB 17-2	SCOTIAB 18	SCOTIAB 18 (reapertura)	SCOTIAB 19	SCOTIAB 19D	SCOTIAB 19 (reapertura) ¹	SCOTIAB 19D (reapertura) ¹
Monto de la Emisión	\$1,150 millones	\$2,875 millones	\$3,450 millones	\$2,875 millones	\$3,653 millones	\$123 millones dólares	\$2,352 millones	\$112 millones dólares
Fecha de Emisión y Colocación	28 junio 2013	4 abril 2017	16 marzo 2018	22 marzo 2018	27 mayo 2019	28 mayo 2019	29 julio 2019	29 julio 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	3,640 días, 20 periodos 182 días, aprox. 10 años	1,820 días, aprox. 5 años	1,459 días aprox. 4 años	1,459 días aprox. 4 años	1,263 días, aprox. 3.5 años	1,260 días, aprox. 3.5 años	1,200 días, aprox. 3.3 años	1,198 días, aprox. 3.3 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	7.30% Fijo	TIIE 28 + 0.50%	TIIE 28 + 0.24%	TIIE 28 + 0.24%	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%	TIIE 28 + 0.18%	LIBOR 3 MESES + 0.57%
Pago de Intereses	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días	Cada 28 días para los primeros 51 periodos el último periodo tendrá una vigencia de 31 días	Cada 28 días para los primeros 51 periodos el último periodo tendrá una vigencia de 31 días	Cada 28 días	Cada 90 días	Cada 28 días	Cada 90 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento en dólares

	Tercera***
Clave de Pizarra	SCOTIAB 19-2
Monto de la Emisión	\$6,000 millones
Fecha de Emisión y Colocación	6 diciembre 2019
Plazo de Vigencia de la Emisión	1,207 días, aprox. 3.3 años
Garantía	Quirografaria
Tasa de interés	TIIE 28 + 0.15%
Pago de Intereses	Cada 28 días
Calificaciones otorgadas Fitch/S&P	AAA(mex) /"mxAAA"
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento

* Programa autorizado por la CNBV en octubre de 2010

** Programa autorizado por la CNBV en septiembre de 2015

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

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

Emisión de Obligaciones Subordinadas

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto
BONO SCOTIAB 12-19	494,100	22-nov-19	22-nov-21	731	MSFDVTHY INDEX	49,410,000
BONO SCOTIAB 13-19	658,200	22-nov-19	22-nov-22	1,096	MSFDVTHY INDEX	65,820,000
BONO SCOTIAB 05-20	1,930,500	19-feb-20	17-feb-23	1,094	MSFDVTIG IDEX	193,050,000
BONO SCOTIAB 06-20	6,497,910	27-mar-20	27-mar-23	1,095	MSFDVTIG IDEX	649,791,000
BONO SCOTIAB 07-20	7,898,100	14-may-20	12-may-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	789,810,000
BONO SCOTIAB 08-20	415,850	11-jun-20	09-jun-23	1,093	SPXSRT5E INDEX	41,585,000
BONO SCOTIAB 09-20	633,800	28-dic-20	27-dic-21	364	USDMXN	63,380,000
BONO SCOTIAB 01-21	238,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	23,884,500
BONO SCOTIAB 02-21	212,845	02-mar-21	24-ago-22	540	SPDR Fund (XLF)	21,284,500
BONO SCOTIAB 03-21	1,845,220	08-mar-21	30-ago-22	540	SPDR Fund (XLE)	184,522,000
BONO SCOTIAB 04-21	102,000	24-mar-21	08-mar-24	1,080	Large-Cap ETF (FXI)	10,200,000
BONO SCOTIAB 05-21	4,946,500	29-abr-21	26-abr-24	1,093	Index (IDBTVER)	494,650,000
BONO SCOTIAB 06-21	572,300	03-jun-21	31-may-24	1,093	Index (IDBTVER)	57,230,000
BONO SCOTIAB 07-21	1,526,000	11-ago-21	04-ago-22	358	MSFDVTHY Index	152,600,000
BONO SCOTIAB 08-21	809,300	12-ago-21	10-ago-23	728	Index (IDBTVER)	80,930,000
Total Bonos Bancarios al 30 de septiembre de 2021						2,878,147,000

Capitalización

Scotiabank Integración del Capital Revelación de la integración del Capital sin considerar transitoriedad en la aplicación de los ajustes regulatorios. (millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)		
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	11,575
2	Resultado de ejercicios anteriores	39,156
3	Otros elementos de la utilidad integral (y otras reservas)	13,323
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	64,054
7	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	
7	Ajustes por valuación prudencial	No aplica
8	Crédito mercantil (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
9	Otros intangibles diferentes a los derechos por servicios hipotecarios (neto de sus correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	-
10 conservador	Impuestos a la utilidad diferidos a favor que dependen de ganancias futuras excluyendo aquellos que se derivan de diferencias temporales (neto de impuestos a la utilidad diferidos a cargo)	2,136
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)	1,000
22	Monto que excede el umbral del 15%	No aplica
23	del cual: Inversiones significativas donde la institución posee más del 10% en acciones comunes de instituciones financieras	No aplica
24	del cual: Derechos de servicios hipotecarios	No aplica
25	del cual: Impuestos a la utilidad diferidos a favor derivados de diferencias temporales	No aplica
26	Ajustes regulatorios nacionales	8,037
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	5
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	del cual: Operaciones que contravengan las disposiciones	-

J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	7,485
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	547
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	11,173
29	Capital común de nivel 1 (CET1)	52,881
	Capital adicional de nivel 1: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima	3,481
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	3,481
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 renglón 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	3,481
	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)	3,481
45	Capital de nivel 1 (T1 = CET1 + AT1)	56,362
	Capital de nivel 2: instrumentos y reservas	
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital de nivel 2, más su prima	4,759
47	Instrumentos de capital emitidos directamente sujetos a eliminación gradual del capital de nivel 2	-
48	Instrumentos de capital de nivel 2 e instrumentos de capital común de nivel 1 y capital adicional de nivel 1 que no se hayan incluido en los renglones 5 o 34, de los cuales hayan sido emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital complementario de nivel 2)	No aplica
49	de los cuales: Instrumentos emitidos por subsidiarias sujetos a eliminación gradual	No aplica
50 conservador	Reservas	2,020
51	Capital de nivel 2 antes de ajustes regulatorios	6,779
	Capital de nivel 2: ajustes regulatorios	
52 conservador	Inversiones en instrumentos propios de capital de nivel 2	No aplica
53 conservador	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital de nivel 2	No aplica
54 conservador	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55 conservador	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital de nivel 2	-

58	Capital de nivel 2 (T2)	6,779
59	Capital total (TC = T1 + T2)	63,141
60	Activos ponderados por riesgo totales	425,068
Razones de capital y suplementos		
61	Capital Común de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	12.44%
62	Capital de Nivel 1 (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	13.26%
63	Capital Total (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	14.85%
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)	15.54%
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)	5.44%
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)	2,020
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital de nivel 2 bajo la metodología estandarizada	2,020
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)	-

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

	<p>inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.</p>
18 conservador	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
19 conservador	<p>Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 31 de la Ley para Regular las Agrupaciones Financieras conforme a lo establecido a la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones realizadas a través de los fondos de inversión a las que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital común de nivel 1, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.</p>
20 conservador	<p>Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.</p> <p>Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios” publicado en junio de 2011 debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.</p>
21	<p>El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.</p>
22	<p>No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.</p>
23	<p>No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.</p>
24	<p>No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.</p>
25	<p>No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.</p>
26	<p>Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.</p>
A	<p>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.</p>
B	<p>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.</p>
C	<p>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.</p>
D	<p>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.</p>

E	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en fondos de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
F	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
G	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de fondos de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable del citado fondo de inversión, conforme a la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
H	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del Grupo Financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
I	I. Operaciones que contravengan las disposiciones, conforme a lo establecido en la fracción I inciso m) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
J	J. Cargos diferidos y pagos anticipados, netos de sus impuestos a la utilidad diferidos a cargo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso n) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
K	K. Posiciones relacionadas con el Esquema de Primeras Pérdidas en los que se conserva el riesgo o se proporciona protección crediticia hasta cierto límite de una posición conforme a la fracción I inciso o) del Artículo 2 Bis 6.
L	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
M	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso s) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
N	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
O	O. Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C1 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
P	P. Las inversiones o aportaciones, directa o indirectamente, en el capital de empresas o en el patrimonio de fideicomisos u otro tipo de figuras similares que tengan por finalidad compensar y liquidar Operaciones celebradas en bolsa, salvo la participación de dichas empresas o fideicomisos en esta última de conformidad con el inciso f) fracción I del Artículo 2 Bis 6.
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital adicional de nivel 1 ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
28	Suma de los renglones 7 a 22, más los renglones 26 y 27.
29	Renglón 6 menos el renglón 28.
30	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen las condiciones establecidas en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en la fracción II del Artículo 2 Bis 6 de estas disposiciones.
31	Monto del renglón 30 clasificado como capital bajo los estándares contables aplicables.
32	No aplica. Los instrumentos emitidos directamente que califican como capital adicional de nivel 1, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Obligaciones subordinadas computables como capital básico No Fundamental, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio de la Resolución 50a que modifica las disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito, (Resolución 50a).
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
36	Suma de los renglones 30, 33 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
41	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C2 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital común de nivel 1.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.
45	Renglón 29, más el renglón 44.

46	El monto correspondiente de los títulos representativos del capital social (incluyendo su prima en venta de acciones) que no hayan sido considerados en el capital Fundamental ni en el capital básico No Fundamental y los Instrumentos de Capital, que satisfacen el Anexo 1-S de las presentes disposiciones conforme a lo establecido en el Artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
47	Obligaciones subordinadas computables como capital complementario, de conformidad con lo dispuesto en el Artículo Tercero Transitorio, de la Resolución 50a.
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
50	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito hasta por la suma del 1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito; y la diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales, hasta por un monto que no exceda del 0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito, conforme a la fracción III del Artículo 2 Bis 7.
51	Suma de los renglones 46 a 48, más el renglón 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital común de nivel 1.
56	Ajustes nacionales considerados: Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al importe registrado en la celda C4 del formato incluido en el apartado II de este anexo.
57	Suma de los renglones 52 a 56.
58	Renglón 51, menos renglón 57.
59	Renglón 45, más renglón 58.
60	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales.
61	Renglón 29 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
62	Renglón 45 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
63	Renglón 59 dividido por el renglón 60 (expresado como porcentaje).
64	Reportar la suma de los porcentajes expresados en los renglones 61,65, 66 y 67.
65	Reportar 2.5%
66	Porcentaje correspondiente al Suplemento de Capital Contracíclico al que se refiere el inciso c), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
67	La cantidad SCCS de la fila 64 (expresado como un porcentaje de los activos ponderados por riesgo) que se relaciona con el suplemento de capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5.
68	Renglón 61 menos 7%.
69	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento "Basilea III: Marco regulador global para reforzar los bancos y sistemas bancarios" publicado en junio de 2011.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.
73	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
74	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
75	El monto, que no exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y suma de las referencias 7 a 20, de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes.
76	Estimaciones preventivas para riesgo de crédito correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
77	1.25% de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el Método Estándar para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
78	Diferencia positiva de las Reservas Admisibles Totales menos las Pérdidas Esperadas Totales correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.
79	0.6 por ciento de los activos ponderados por riesgo de crédito, correspondientes a las Operaciones en las que se utilice el método basado en calificaciones internas para calcular el requerimiento de capital por riesgo de crédito.

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

Scotiabank
Relación del Capital neto con el Balance General
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Disponibilidades	28,863
BG2	Cuentas de Margen	2,520
BG3	Inversiones en valores	129,584
BG4	Deudores por reporto	17,525
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Derivados	20,481
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	29
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	401,616
BG9	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG10	Otras cuentas por cobrar (neto)	29,592
BG11	Bienes adjudicados (neto)	114
BG12	Inmuebles, mobiliario y equipo (neto)	2,138
BG13	Inversiones permanentes	3,373
BG14	Activos de larga duración disponibles para la venta	18
BG15	Impuestos y PTU diferidos (neto)	8,524
BG16	Otros activos	7,422
	Pasivo	
BG17	Captación tradicional	407,874
BG18	Préstamos interbancarios y de otros organismos	50,255
	Valores asignados por liquidar	14,832
BG19	Acreedores por reporto	53,574
BG20	Préstamo de valores	-
BG21	Colaterales vendidos o dados en garantía	1,870
BG22	Derivados	20,602
BG23	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	9
BG24	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG25	Otras cuentas por pagar	28,105
BG26	Obligaciones subordinadas en circulación	9,096
BG27	Impuestos y PTU diferidos (neto)	-
BG28	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,528
	Capital contable	
BG29	Capital contribuido	11,575
BG30	Capital ganado	52,479
	Cuentas de orden	
BG31	Avales otorgados	-
BG32	Activos y pasivos contingentes	-
BG33	Compromisos crediticios	278,155
BG34	Bienes en fideicomisos o mandato	417,613
BG35	Agente financiero del gobierno federal	-
BG36	Bienes en custodia o en administración	51,500

BG37	Colaterales recibidos por la entidad	28,147
BG38	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,870
BG39	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	126,335
BG40	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	873
BG41	Otras cuentas de registro	1,449,509

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 2021)

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	2,136	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$2,136
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	1,000	BG 15 Impuestos y PTU Diferidos (Neto) \$1,000
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	2,020	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) \$2,020
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	5	
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	7,485	BG 16 Activos Intangibles \$4,309 más Gastos de Instalación \$3,176

21	Participación de los trabajadores en la utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	547	BG 13 Inversiones Permanentes \$ 547
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	3,481	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$3,481
30	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como Capital No Fundamental	33	-	
31	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-S	46	4,759	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación \$4,759
32	Obligaciones subordinadas sujetas a transitoriedad que computan como capital complementario	47	-	
33	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
CAPITAL CONTABLE				
34	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	11,575	BG 29 Capital Social \$10,457 más Prima en Venta de Acciones \$473
35	Resultado de ejercicios anteriores	2	39,156	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores \$39,156
36	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas registradas a valor razonable	3	178	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo \$178
37	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	13,144	BG 30 Reservas de Capital \$7,060 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta (\$71) más Remedición por beneficios definidos a los empleados (\$931) más Resultado Neto \$7,087
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
39	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
40	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
41	Efecto acumulado por conversión	3, 26-A	-	
42	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3, 26-A	-	
CUENTAS DE ORDEN				
43	Posiciones en Esquemas de Primeras Pérdidas	26 - K	-	

	CONCEPTOS REGULATORIOS NO CONSIDERADOS EN EL BALANCE GENERAL	Identificador	
44	Reservas pendientes de constituir	12	-
45	Utilidad o incremento el valor de los activos por adquisición de posiciones de bursatilizaciones (Instituciones Originadoras)	26-C	- Estado de Resultados
46	Operaciones que contravengan las disposiciones	26-I	-
47	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-
48	Derogado		

Scotiabank

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

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

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

Activos ponderados sujetos a Riesgos Totales
(millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	49,069	3,925
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	1,735	139
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's	1,014	81
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's o con rendimiento referido al INPC	28	2
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	1,130	90
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	1,152	92
Posiciones en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	44	4
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	8	1
Activos ponderados sujetos de crédito por grupo de riesgo	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	6	-
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%)	470	38
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	4,544	363
Grupo III (ponderados al 23%)	-	-
Grupo III (ponderados al 25%)	1	-
Grupo III (ponderados al 50%)	211	17
Grupo III (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	-	-
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	-	-
Grupo III (ponderados al 138%)	-	-
Grupo III (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 0%)	-	-
Grupo IV (ponderados al 20%)	2,476	198
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	-	-
Grupo V (ponderados al 50%)	410	33
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	-	-
Grupo VI (ponderados al 20%)	202	16
Grupo VI (ponderados al 25%)	148	12

Grupo VI (ponderados al 30%)	576	46
Grupo VI (ponderados al 40%)	436	35
Grupo VI (ponderados al 50%)	38,104	3,048
Grupo VI (ponderados al 70%)	55	4
Grupo VI (ponderados al 75%)	16,889	1,351
Grupo VI (ponderados al 85%)	2,200	176
Grupo VI (ponderados al 100%)	86,972	6,958
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%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	10,494	840
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	382	31
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	7,298	584
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	10	1
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	144,020	11,522
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	650	52
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	627	50
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	1,541	123
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%)	242	19
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%)	6,035	483
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,509	281
Grupo IX (ponderados al 100%)	16,144	1,292
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 20%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5, 6 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	-	-
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	2,206	176

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional

Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Estándar Alternativo	24,032	1,923

Promedio de los ingresos netos anuales positivos de los últimos 36 meses

29,956

Categoría Capitalización

Al 30 de septiembre del 2021, el Banco mantiene un índice de capitalización superior al 11.10% (temporalmente este se ubica en 9.85%, por lo que también se cumple con ese criterio), por lo que se encuentra clasificado en la categoría I de conformidad con el artículo 220 de las Disposiciones.

Scotiabank		
Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio		
Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A. , Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
Tratamiento regulatorio		
4	Nivel de capital con transitoriedad	N.A.
5	Nivel de capital sin transitoriedad	Fundamental
6	Nivel del instrumento	Institución de crédito sin consolidar subsidiarias
7	Tipo de Instrumento	Acción series "F" y "B"
8	Monto reconocido en el capital regulatorio	11,575,052,037
9	Valor nominal del instrumento	Un Peso 00/100 MN, conforme estatutos sociales
9A	Moneda del instrumento	Pesos mexicanos
10	Clasificación contable	Capital
11	Fecha de emisión	13-ene-01
12	Plazo del instrumento	Perpetuidad
13	Fecha de vencimiento	Sin vencimiento
14	Cláusula de pago anticipado	No
15	Primera fecha de pago anticipado	N.A.
15A	Eventos regulatorios o fiscales	No
15B	Precio de liquidación de la cláusula de pago anticipado	N.A.
16	Fechas subsecuentes de pago anticipado	N.A.
Rendimientos / dividendos		
17	Tipo de rendimiento / dividendo	Fijo o Variable
18	Tasa de Interés /Dividendo	La política para el decreto y pago de dividendos indica que al final de cada trimestre se propondrá a la Asamblea de Accionistas el decreto y pago de dividendos entre un rango del 0-30% de las utilidades generadas por la Institución al trimestre.
19	Cláusula de cancelación anticipada	Sujeto a los supuestos establecidos en los estatutos sociales, relativo a la distribución de las utilidades.
20	Discrecionalidad en el pago	Parcialmente discrecional.
21	Cláusula de aumento de intereses	No
22	Rendimientos / dividendos	No Acumulable
23	Convertibilidad del instrumento	N.A.
24	Condiciones de convertibilidad	N.A.
25	Grado de convertibilidad	N.A.
26	Tasa de conversión	N.A.
27	Tipo de convertibilidad del instrumento	N.A.

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

Scotiabank

Características de los títulos que forman parte del Capital Regulatorio

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

20	Discrecionalidad del emisor para el pago de los intereses o dividendos del título. Si la Institución en cualquier momento puede cancelar el pago de los rendimientos o dividendos deberá seleccionarse (Completamente discrecional); si solo puede cancelarlo en algunas situaciones (Parcialmente discrecional) o si la institución de crédito no puede cancelar el pago (Obligatorio).
21	Especificar si en el título existen cláusulas que generen incentivos a que el emisor pague anticipadamente, como cláusulas de aumento de intereses conocidas como "Step-Up".
22	Especificar si los rendimientos o dividendos del título son acumulables o no.
23	Especificar si el título es convertible o no en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
24	Condiciones bajo las cuales el título es convertible en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero.
25	Especificar si el título se convierte en su totalidad o solo una parte cuando se satisfacen las condiciones contractuales para convertir.
26	Monto por acción considerado para convertir el título en acciones ordinarias de la institución de banca múltiple o del Grupo Financiero en la moneda en la que se emitió dicho instrumento.
27	Especificar si la conversión es obligatoria u opcional.
28	Tipo de acciones en las que se convierte el título.
29	Emisor del instrumento en el que se convierte el título.
30	Especificar si el título tiene una característica de cancelación de principal.
31	Condiciones bajo las cuales el título disminuye su valor.
32	Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el título baja de valor en su totalidad o solo una parcialmente.
33	Especificar si una vez que se actualizan los supuestos de la cláusula de baja de valor, el instrumento baja de valor permanente o de forma temporal.
34	Explicar el mecanismo de disminución de valor temporal.
35	Posición más subordinada a la que está subordinado el instrumento de capital que corresponde al tipo de instrumento en liquidación.
36	Especificar si existen o no características del título que no cumplan con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.
37	Especificar las características del título que no cumplen con las condiciones establecidas en los anexos 1-Q, 1-R y 1-S de las presentes disposiciones.

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

Suplemento de capital contracíclico de la Institución

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo de mercado

La administración del riesgo de mercado consiste en identificar, medir, monitorear y controlar los riesgos derivados de fluctuaciones en las tasas de interés, tipos de cambio, precios del mercado accionario, índices y otros factores de riesgo en los mercados de dinero, cambios, capitales y productos derivados a los que están expuestas las posiciones de negociación del Banco. Las posiciones de riesgo del Banco incluyen instrumentos de mercado de dinero de tasa fija y flotante, acciones, posiciones cambiarias y derivados tales como futuros de tasas de interés, contratos adelantados, opciones de divisas, swaps de tasas de interés, opciones de tasas de interés y swaps de moneda extranjera. Se tienen límites establecidos y aprobados para cada uno de los portafolios.

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre del 30 de septiembre de 2021 fue de 12.34 y su promedio durante el tercer trimestre de 2021 fue de \$11.55 millones mismo que corresponde a un 0.018% del capital neto (\$63,141 millones a septiembre 2021). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del tercer trimestre de 2021 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2021	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	829,004	794,055
Mercado de Dinero	43,863	47,335
Tipo de cambio		
Cash	115	119
Derivados	128,002	128,635
Capitales		
Derivados	14,251	14,084
VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Septiembre 2021	(Promedio)
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	12.66	11.61
Tipo de cambio	0.18	1.12
Capitales	0.00	0.00
VaR Global	12.34	11.55

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 2021 muestra una pérdida máxima de \$212.98 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 2021, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

Para la administración del riesgo de liquidez y de tasas de interés se han establecido límites, los cuales son revisados al menos de manera anual y monitoreados de manera periódica¹ a fin de que los mitigantes del riesgo estén actualizados y sean precisos. Entre los límites aplicables se encuentran aquellos relacionados a activos líquidos, brechas de liquidez, sensibilidad del margen y sensibilidad del valor económico, mismos que se encuentran alineados con el apetito de riesgo de la institución. La estructura de límites de riesgo de liquidez y tasas de interés contempla montos nominales, así como de plazo y concentración; de manera periódica se informa al Comité de Activos y Pasivos, Comité de Riesgos y al Consejo de Administración sobre el desempeño de dichos límites, así como de los indicadores en materia de riesgo de liquidez y tasas de interés.

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de septiembre 2021 así como el promedio del tercer trimestre de 2021 se muestran a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)²	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	40,489	55,543
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,659	108,983

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 de frente a la contingencia sanitaria por COVID-19, con un CCL promedio durante el tercer trimestre de 2021 de 153.27%, manteniéndose por arriba del 100%; así como una amplia reserva de activos líquidos.

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

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

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

² Cifras previas al cierre de septiembre 2021.

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de septiembre 2021 y en promedio para el tercer trimestre de 2021 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Valor Económico (+100 pbs)	(311)	(605)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(468)	(515)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición Cierre	Posición Promedio
Títulos Disponibles para la venta	63,878	63,222
Derivados de Cobertura	57,219	55,575

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 2021 y el promedio del tercer trimestre del 2021 fueron \$2,320 millones y \$2,387 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.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101,102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del segundo y trimestre corresponde a \$403 y \$305 respectivamente; 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.

Criterios contables especiales por programa de apoyo por virus SARS-CoV2 (COVID-19)

Con el objetivo de mitigar los efectos negativos económicos derivados de la contingencia por el virus SARS-CoV2 (COVID-19), con base al oficio P285/2020 de la CNBV, notificado expresamente a Scotiabank Inverlat mediante oficio número 141-5/2046/2020, el Banco emitió un esquema de apoyo para acreditados cuya fuente de pago fue afectada por esta contingencia. El apoyo consistía en que la cartera crediticia de los clientes afectados por esta pandemia, fuera considerada contablemente como vigente dando cumplimiento con los criterios especiales establecidos por la Comisión Bancaria. Con base al oficio P325/2020 de la CNBV emitido el 23 de junio de 2020, notificó la ampliación por un mes adicional al esquema, es decir, los trámites de la reestructuración o renovación de cada uno de los créditos a adherirse al programa, debían concluirse a más tardar el 31 de Julio de 2020.

Plan de apoyo para créditos de la cartera comercial. El programa de apoyo permitió otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 6 meses. El Banco determinó las condiciones generales del programa en apoyo a sus clientes, lo informó a la CNBV y reportó mes a mes los créditos beneficiados con el mismo. El programa terminó el 31 de Julio de 2020, siendo el máximo diferimiento el 31 de diciembre de 2020, por lo cual al cierre de diciembre 2020 concluyó la aplicación del programa para cartera comercial.

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

Condiciones del diferimiento.

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

Elegibilidad de clientes.

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

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

Considerando la emergencia sanitaria por COVID-19 que se está presentando no solo en México sino a nivel mundial y que afecta el entorno económico y financiero, durante el 2020, el Banco constituyó reservas adicionales por \$3,750 para cubrir riesgos incrementales que no se encuentran actualmente previstos en las diferentes metodologías de calificación de la cartera crediticia.

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

Por lo tanto, las reservas adicionales fueron constituidas sin asignación directa inicial para algún portafolio, por lo que se trata de reservas genéricas que se aplican acorde con las necesidades particulares de cada portafolio. El consumo y la liberación de dichas reservas comenzó durante el primer trimestre y continuó durante el segundo trimestre de 2021; por lo tanto, el monto total de reservas adicionales al cierre de septiembre 2021 asciende a \$2,773 millones

El proceso desarrollado por el Banco para el cálculo de las reservas adicionales incluye el análisis y el efecto de variables significativas como son: sectores de la economía proyecciones macroeconómicas y características propias de las carteras.

Información metodológica

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

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

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

Métricas Riesgo de Crédito ¹ (Cifras al 30 de septiembre 2021)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.3%	3.4%
Consumo	4.5%	11.3%
Cartera Comercial	0.9%	4.9%
Total	1.0%	4.9%

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

Parámetros de Riesgo ¹ (Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre 2021)	EI ²	PI	SP
Hipotecas	156,185	1.71%	18.83%
Consumo	50,969	5.77%	72.32%
Cartera Comercial	252,139	2.62%	43.40%

1/ EI (Exposición al Incumplimiento) calculada bajo metodología regulatoria. PI y SP ponderados por EI. Excluye cartera en incumplimiento.

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

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

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de septiembre de 2021.

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 2021 y en promedio durante el tercer trimestre de 2021, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.023% y 0.018% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.046% y 0.052% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

Metodología general

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

Políticas para la gestión de riesgo operacional

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

Evaluación de riesgo operacional

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

Manual para la recolección y clasificación de datos de riesgo operacional

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

Niveles de tolerancia de riesgo Operacional

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

Indicadores clave de riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

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

Cálculo del requerimiento de capital por riesgo operacional

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

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de julio - septiembre 2021, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por \$70.2, asimismo los riesgos operacionales al cierre del mes de septiembre 2021 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman \$281.8, donde \$26.7 corresponden a riesgo operacional y \$255.1 a riesgo legal, donde las contingencias cuentan con provisiones.

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL) Periodo Reportado: junio 2021 - septiembre 2021

Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez³

(Cifras en millones de pesos)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
ACTIVOS LÍQUIDOS COMPUTABLES		
1 Total de Activos Líquidos Computables	No aplica	108,983.06
SALIDAS DE EFECTIVO		
2 Financiamiento minorista no garantizado	148,343.19	11,338.36
3 Financiamiento estable	69,919.22	3,495.96
4 Financiamiento menos estable	78,423.97	7,842.40
5 Financiamiento mayorista no garantizado	199,070.79	69,797.91
6 Depósitos operacionales	87,732.58	20,786.18
7 Depósitos no operacionales	109,286.31	46,959.83
8 Deuda no garantizada	2,051.90	2,051.90
9 Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	513.10
10 Requerimientos adicionales:	288,531.22	24,257.98
11 Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	7,669.02	4,932.84
12 Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-
13 Líneas de crédito y liquidez	280,862.20	19,325.14
14 Otras obligaciones de financiamiento contractuales	33.93	33.93
15 Otras obligaciones de financiamiento contingentes	-	-
16 TOTAL DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	105,941.27
ENTRADAS DE EFECTIVO		
17 Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	26,166.31	292.42
18 Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	33,129.10	21,620.29
19 Otras entradas de efectivo	13,197.41	13,197.41
20 TOTAL DE ENTRADAS DE EFECTIVO	72,492.82	35,110.12
		Importe ajustado
21 TOTAL DE ACTIVOS LIQUIDOS COMPUTABLES	No aplica	108,983.06
22 TOTAL NETO DE SALIDAS DE EFECTIVO	No aplica	70,831.16
23 COEFICIENTE DE COBERTURA DE LIQUIDEZ	No aplica	153.27⁴

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

⁴ Cifras previas sujetas a confrontas de Banco de México.

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

- Durante septiembre 2021, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):⁵

- o Principales Salidas de Efectivo:
Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por \$38,432 millones y depósitos a plazo tradicionales por \$37,783 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 \$751 millones y \$2,320 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por \$19,592 millones.
- o Principales Entradas de Efectivo:
Entradas por flujo de carteras de \$12,430 millones y por operaciones de call money de \$11,3127 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por \$12,181 millones.
- o Activos Líquidos:
Activos Líquidos totales de \$89,659 millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; \$70,316 millones en títulos de deuda de nivel 1, \$10,602 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 \$7,131 millones y \$1,610 millones en títulos de nivel 2A.

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

Cierre de septiembre 2021: 141% – cierre de junio 2021: 181% (decremento: 40 puntos porcentuales) El coeficiente de cobertura de liquidez disminuyó 40 puntos porcentuales respecto de junio 2021, esto debido principalmente a:

- o El fondeo tradicional del banco decreció en \$23,969 millones, además, fondeo profesional, interbancario y externo decrecieron en \$12,044 millones, debido a vencimientos en las emisiones de papel de la tesorería.
- o En las entradas de efectivo, las carteras crecieron \$6,560 millones.
- o Finalmente, los activos líquidos tuvieron una disminución de \$38,893 millones.

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

Evolución de Activos Líquidos T3-2021			
	Julio	Agosto	Septiembre
Efectivo	7%	7%	7%
Reservas en el Banco Central	23%	18%	11%
Nivel 1	69%	72%	71%
Nivel 2 ^a	2%	2%	2%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

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

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

(e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Julio	Agosto	Septiembre
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	46%	47%	46%
Depósitos a plazo			
Del público en general	34%	34%	35%
Mercado de dinero	1%	1%	0%
Títulos de crédito emitidos	7%	7%	7%
Cuenta global de captación sin movimientos	0%	0%	0%
PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS			
De exigibilidad inmediata	0%	0%	0%
De corto plazo	5%	4%	4%
De largo plazo	7%	7%	7%
Total	100%	100%	100%

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

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

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

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

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

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

(Cifras en millones de pesos)	
Exposición Potencial Futura (Septiembre 2021)	
Con contrato de compensación	2,123
Sin contrato de compensación	5,581
Posibles llamadas de margen (Septiembre 2021)	
Colateral en Tránsito	97
Downgrade (Septiembre 2021)	
Baja calificación 3 niveles	2,320

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de septiembre 2021 es la siguiente:

Scotiabank Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	829,003.68
Tipo de cambio	128,001.65
Capitales	14,251.14
Total	971,256.47

(g) *El descalce en divisas;*

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

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

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

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

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

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

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

Concentración de Depósitos ⁷	
Concepto	Límite MM
Concentración de Depósitos (MXN)	7,000 MXN
Concentración de Depósitos (USD)	100 USD

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

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

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

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

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

Para tener un control sobre el descalce generado por la naturaleza del balance entre activos y pasivos, Scotiabank establece límites para sus brechas de liquidez en diferentes plazos. Asimismo, el banco monitorea las brechas diarias durante los próximos 360 días, con la finalidad de tener un panorama más amplio de las obligaciones que la institución tiene a más de 30 días; las brechas incorporan posiciones activas y pasivas del balance, así como posiciones fuera del mismo. Los resultados al cierre de septiembre 2021 y el promedio del tercer trimestre de 2021 son:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ⁸	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	40,489	55,543
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,659	108,983

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

II. Información cualitativa

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

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

⁷ Sujeto a excepciones para algunos nombres.

⁸ Cifras previas al cierre de septiembre 2021.

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:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

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

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

Considerando los niveles de Coeficiente Cobertura de Liquidez registrados durante el tercer trimestre de 2021, 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 2021, 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 10).

Posiciones en Acciones

Al cierre de septiembre de 2021 la posición accionaria de títulos para negociar asciende \$20.38 millones de pesos, con una minusvalía de \$0.73 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1GMEXICOB	52,834	4.36	4.37	(0.01)
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	5,000	0.17	0.17	-
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	10,927	2.66	2.84	(0.18)
Scotiabank	Pública	1GFINBURO	283,857	5.49	5.35	0.14
Scotiabank	Pública	1EFRES*	8,635	1.89	2.01	(0.12)
Scotiabank	Pública	1ISHV*	600	1.36	1.32	0.04
Scotiabank	Pública	1IOIH*	10	0.04	0.03	0.01
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	840,000	4.41	5.02	(0.61)
Total			1,201,863	20.38	21.11	(0.73)

Al cierre del tercer trimestre del año 2021, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por \$5.35 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1ABPN	14,085	0.14	(0.19)	(0.05)
Scotiabank	Pública	1GMEXICOB	258,189	0.43	(0.11)	0.32
Scotiabank	Pública	1ICHB	5,477	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1APBRN	43,274	0.27	(0.05)	0.22
Scotiabank	Pública	1BACHOCOB	135,317	0.23	(0.17)	0.06
Scotiabank	Pública	1PE&OLES*	93,007	0.54	(0.26)	0.28
Scotiabank	Pública	1GFINBURO	1,211,944	0.76	(0.13)	0.63
Scotiabank	Pública	1SORIANAB	18,107	-	-	-
Scotiabank	Pública	1EFRES*	3,174	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1ISHV*	15,005	0.30	(0.05)	0.25
Scotiabank	Pública	1CHDRAUIB	867,374	0.81	(0.11)	0.70
Scotiabank	Pública	1IOIH*	2,570	0.24	(0.01)	0.23
Scotiabank	Pública	1LALAB	172,516	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1NEMAKA	2,478,319	0.53	(0.26)	0.27
Scotiabank	Pública	1ELEMENT*	31,224	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1SITESB1	284,061	0.21	(0.23)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1KWEB*	711	-	(0.01)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1FEMSAUBD	65,698	0.16	-	0.16
Scotiabank	Pública	1KOFUBL	304,072	0.42	(0.06)	0.36
Scotiabank	Pública	1ALFAA	895,847	0.19	(0.08)	0.11
Scotiabank	Pública	1BIMBOA	170,110	0.06	(0.08)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1AMXL	1,752,270	0.50	(0.08)	0.42
Scotiabank	Pública	1CEMEXCPO	80,476	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1AC*	126,751	0.19	(0.01)	0.18
Scotiabank	Pública	1KIMBERA	196,298	0.25	(0.01)	0.24
Scotiabank	Pública	1BNAFTRACISHRS	114,775	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1IEWZ*	13,800	0.27	(0.01)	0.26
Scotiabank	Pública	1IIB01N	6,762	-	-	-
Scotiabank	Pública	1GCARSOA1	72,128	0.07	(0.04)	0.03
Scotiabank	Pública	1ITWM*	5,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1IPSQ*	13,876	0.03	(0.01)	0.02
Scotiabank	Pública	1IBRZU*	3,300	0.43	(0.01)	0.42
Scotiabank	Pública	41BSMXB	214,261	0.05	(0.05)	-
Scotiabank	Pública	1WALMEX*	32,000	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1NMKA	655,810	0.01	(0.03)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1ABABAN	100	-	-	-
Scotiabank	Pública	41BBAJIOO	115,000	0.12	(0.04)	0.08
Scotiabank	Pública	1AVALEN	3,500	0.10	-	0.10
Total			10,476,188	7.47	(2.12)	5.35

La posición accionaria de títulos Disponibles para la Venta asciende \$0 millones de pesos, con una plusvalía de \$0 millones de pesos.

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

Al 30 de septiembre de 2021, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria genero un requerimiento de capital de \$3.53 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de \$1.89 millones de pesos y el requerimiento por riesgo específico asciende a la cantidad de \$1.63 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización					
Por Riesgo General de Mercado	POSICIONES			Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición		
	14.47	5.95	8.52	22.23%	1.90
Por riesgo específico					
Canasta de acciones,	14.47	5.95	20.42	8.00%	1.63
Índices accionarios	-	-	-	4.00%	-
Requerimiento por riesgos	-	-	-	4.00%	-
				Total Requerimiento de capital	3.53

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-21	Sep-21
	Exposiciones dentro del balance		
1	Partidas dentro del balance (excluidos instrumentos financieros derivados y operaciones de reporto y préstamo de valores -SFT por sus siglas en inglés- pero incluidos los colaterales recibidos en garantía y registrados en el balance)	637,034	613,793
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(7,353)	(11,173)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	629,681	602,620
	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)	3,094	2,830
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	2,894	2,931
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)	(4,916)	(4,282)
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)	1,072	1,479
	Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores		
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	29,430	17,525
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(29,430)	(17,525)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	-	-
15	Exposiciones por SFT actuando por cuenta de terceros	-	-
16	Exposiciones totales por operaciones de financiamiento con valores (suma de las líneas 12 a 15)	-	-
	Otras exposiciones fuera de balance		
17	Exposición fuera de balance (importe notional bruto)	277,164	278,155
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(198,560)	(200,744)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	78,604	77,411
	Capital y exposiciones totales		
20	Capital de Nivel 1	55,881	56,362
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	709,357	681,510
	Coeficiente de apalancamiento		
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	7.88%	8.27%

Cifras en millones de pesos

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Jun-21	Sep-21
1	Activos totales	686,183	651,799
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	(390)	(553)
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	(18,648)	(19,003)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(29,430)	(17,524)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	78,604	77,411
7	Otros ajustes	(6,962)	(10,620)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	709,357	681,510

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

REFERENCIA	DESCRIPCION	Jun-21	Sep-21
1	Activos totales	686,183	651,799
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(19,719)	(20,481)
3	Operaciones en reporto y prestamos de valores	(29,430)	(17,525)
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	637,034	613,793

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

CONCEPTO/PERIODO	Jun-21	Sep-21	Variación
Capital Básico ^{1/}	55,881	56,362	0.86%
Activos Ajustados ^{2/}	709,357	681,510	-3.93%
Razón de Apalancamiento ^{3/}	7.88%	8.27%	0.39%

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 2021 a septiembre de 2021.

El indicador se ubicó en 8.27%, 39pb superior respecto al trimestre anterior, debido principalmente a la disminución de las exposiciones totales por \$27,847 millones (+32 pb) y por la mejora en el capital de nivel 1 por \$482 millones (+7 pb).

La variación de +32pbs en las exposiciones totales, se debe principalmente a la disminución en las exposiciones dentro del balance (netas) por \$27,062 millones (+31pb).

El Capital de Nivel 1 mostró un incremento trimestral de \$482 millones (+7pb), derivado del resultado neto del periodo y a los resultados por valuación \$4,302 millones (+61 pb); el capital nivel 1 se vio disminuido por las deducciones \$3,820 millones (-54 pbs).

TABLA I.2

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

REFERENCIA	EXPLICACIÓN
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	<p>Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) <i>recibidas</i>, siempre que se cumpla con las condiciones siguientes:</p> <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. 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. <p>En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.</p>
5	<p>Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones.</p> <p>En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.</p>
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.
7	Monto de márgenes de variación en efectivo <i>entregados</i> en operaciones con instrumentos financieros derivados que cumplan con las condiciones señaladas en la línea 4 para restar los márgenes de variación en efectivo recibidos. El monto se debe registrar con signo negativo.
8	No aplica.
9	No aplica. La exposición que se considera para efectos del marco de solvencia en operaciones con instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provee protección crediticia corresponde al 100 por ciento del importe efectivamente garantizado en las operaciones de que se trate. Esta exposición está considerada en la línea 5.

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

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

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

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

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

Agencias Calificadoras

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

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

Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 30 de septiembre del 2021, 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\$72,600 millones de pesos.
- Disponibilidades en bancos y reservas con el Banco Central por MXN\$24,670 millones de pesos.

Adicionalmente:

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

Inversiones relevantes en capital

Al 30 de septiembre de 2021, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.



I. Información Cualitativa

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

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

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

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

Para el caso específico de los instrumentos financieros derivados de cobertura y dada la naturaleza de las operaciones activas y pasivas que se realizan, Scotiabank Inverlat puede encontrarse expuesto, entre otros, al Riesgo de tasas de interés y al Riesgo de tipo de cambio. Con la finalidad de cubrir y limitar la exposición ante posibles cambios de flujos de efectivo y valor razonable de las posiciones primarias derivadas de movimientos en las tasas de interés y el tipo de cambio, se realizan operaciones con derivados previamente autorizados por los órganos colegiados facultados y los monitorea periódicamente para reflejar cualquier cambio o riesgo como parte de las afectaciones a resultados. Durante el tercer trimestre de 2021, no se identificaron riesgos adicionales a los ya monitoreados que pudieran afectar en futuros reportes.

SBI realiza operaciones derivadas con contrapartes financieras, corporativas y empresariales. El uso de instrumentos derivados se controla mediante límites y políticas autorizadas; particularmente, tratándose de derivados de cobertura, se apega a los Criterios Contables B-5 “derivados y operaciones de cobertura” emitido por la CNBV y aplicables a las Instituciones de Crédito, en el cual se establecen los lineamientos para el reconocimiento, valuación, monitoreo, presentación y revelación de información de los instrumentos financieros derivados y de operaciones de cobertura.

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

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

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

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

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

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

*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 SCSSwaps, 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 definida al inicio de la contratación o negociación del derivado, los modelos desarrollados en la matriz BNS tanto valuaciones como para la medición de riesgo contraparte contemplan estas características y no requieren de ninguna modificación.

(MR) Mercados reconocidos

(ME) Mercados extrabursátiles

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

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

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

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

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

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

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

Objetivos de la gestión de Riesgos de Liquidez:

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

Para cumplir estos objetivos se tiene principal énfasis en:

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

Para medir el riesgo de liquidez, las brechas de liquidez acumuladas al cierre de septiembre 2021 y en promedio para el tercer trimestre de 2021 es de:

Scotiabank	Posición	Posición
<i>(millones de pesos)</i>	(Cierre) ⁹	(Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	40,489	55,543

⁹ Cifras previas al cierre de septiembre 2021.

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos a Valor Razonable			
Clase de activo	Derivado	Tipo	Breve descripción
Tasas de interés	Opciones	Europea	<p>Caps, Floors:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Caps: es una cartera de n-opciones call sobre tasas de interés, las n-opciones call que subyacen al cap se conocen como caplets. $\text{Cap} = \sum_{i=1}^n \text{Caplet}_i$ <ul style="list-style-type: none"> • Floor: De manera análoga, un floor de tasas de interés es un portafolio de opciones de venta sobre tasas de interés. Cada una de las opciones individuales que comprenden al floor se conoce como floorlet. $\text{Floor} = \sum_{i=1}^n \text{Floorlet}_i$
		Binaria	<p>La opción binaria es una opción de compra exótica con pagos discontinuos. La opción paga una cantidad fija y predeterminada si el precio del activo subyacente supera el precio de ejercicio en su fecha de vencimiento. Pueden ser de tipo:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Binary Cap: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir de un monto notional en la misma moneda y un pago predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (cap) es un valor positivo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es mayor o igual a la tasa de interés límite (cap). • Binary Floor: Transacción mediante la cual el vendedor de la opción paga montos fijos en una moneda específica calculada a partir del monto notional predefinido si la diferencia entre la tasa de interés variable y la tasa de interés límite (floor) es un valor negativo o cero, es decir, la tasa de interés variable para el período de interés dado es inferior o igual a la tasa de interés límite (floor).
	IRS		El intercambio de flujos de dinero provenientes de la comparación entre la tasa de interés nominal fija a 28 días a la que se celebran las operaciones en el mercado (Tasa Fija) y las tasas de interés nominales variables a 28 días (TIIE28), calculadas por el Banco de México (Tasa Variable).
	CCIRS		Intercambio de intereses en moneda nacional por intereses en moneda extranjera con liquidaciones periódicas.
Tipo de cambio	Opciones	Europea	En este tipo de contratos se utiliza la fórmula Garman and Kohlhagen (1983) la cual es una extensión de la fórmula de Black–Scholes–Merton.
		Americana	El enfoque seguido corresponde al modelo Cox, Ross y Rubinstein (1976)
	Binaria	Se recibe un pago fijo como beneficio en caso que el subyacente esté por encima o por debajo del nivel de ejercicio en el momento de vencimiento de la opción. A diferencia de opciones plain vanilla, la rentabilidad de la opción está basada solamente en la fluctuación del subyacente, por lo que se las conoce también como opciones cash-or-nothing.	
Forward	Barrera	Una opción donde el pago (payoff) depende del valor del subyacente no solo al vencimiento S_T , sino que también incluye el valor del subyacente para momentos previos al vencimiento $S_{t < T}$, son conocidas como opciones dependientes de la trayectoria. Para las opciones Barrera el payoff es contingente sobre que el precio del subyacente S_T alcance un umbral preestablecido H llamado barrera de la opción.	
	Forward	Forward OTC	Compra o venta de una divisa a un tipo de cambio determinado el día de la contratación que se liquida en una fecha predeterminada en el futuro a través de contratos privados OTC.

Instrumentos a Valor Razonable

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

Instrumentos valuados a costo

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

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

i. Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

- Sujetos de Crédito

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

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

- Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

- Idoneidad del Cliente

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

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

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

ii. Políticas de VaR

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

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

b. Descripción de Políticas y técnicas de Valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad De la Cobertura:

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

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

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

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

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

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

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

Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con los requerimientos del B5 para concluir cobertura efectiva. Al cierre de septiembre 2021 y como resultado del proceso mensual de revisión y monitoreo de operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son cobertura eficiente.

Durante el tercer trimestre de 2021 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por ineffectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

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 2021 y promedio del tercer trimestre 2021 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre) ¹⁰	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	89,659	108,983

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

¹⁰ Cifras previas al cierre de septiembre 2021.

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario de Estrés
Gap 30d Gap Acum	40,489	38,169	38,169	38,169
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(2,320)	(2,320)	(2,320)

Análisis de Sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

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

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a Septiembre 30 2021:

	0-3 Months	3 - 12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	2,642.00	(154,608.00)	(149,414.00)	559,198.00	(238,616.00)	(31,864.00)	(12,662.00)
CCS	22.00	192.00	292.00	953.00	176.00	(10.00)	1,625.00
Caps&Floors	(43.00)	283.00	496.00	109.00	(4.00)	0.00	841.00
Binary Caps&Floors	-	-	-	-	-	-	-
TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Mbonds Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total Derivatives	2,621.00	(154,133.00)	(148,626.00)	560,260.00	(238,444.00)	(31,874.00)	(10,196.00)

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

- Bajo el escenario probable una pérdida de (7.19) Millones de pesos.
- Con escenario de stress 1, poco probable un P&L de (14.38) Millones de pesos.
- Y finalmente con el escenario muy poco probable (35.45) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock(+/-)	P&L	Stress 1 Shock(+/-)	P&L	Stress 2 Shock(+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	(0.01)	(213.85)	50.00	(0.51)	100.00	(1.02)	200.00	(2.04)
Volatilidad al 1%	Caps & Floors	(0.01)	(0.07)	0.10	-	0.40	-	1.00	(0.01)
a FX %	Forwards	(3.25)	(66.80)	0.10	(6.68)	0.20	(13.36)	0.50	(33.40)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					(7.19)		(14.38)		(35.45)

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 2021 (la sensibilidad de las opciones es Back to Back, es decir el riesgo esta cerrado).

	Delta	Vega	Gamma
Options BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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 BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

	Escenarios a la Alza		
	0.05	0.15	0.2
Options BABA.USM	-	-	-
Options IDBTVR.INDX	-	-	-
Options MEXFXI.USM	-	-	-
Options MEXIXM.INDX	-	-	-
Options MEXMSF.INDX	-	-	-
Options MEXMSI.INDX	-	-	-
Options MEXSR5.INDX	-	-	-
Options MEXXLE.USM	-	-	-
Options TSM.USM	-	-	-
TOTAL	-	-	-

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

Pérdida Potencial reflejada en Estado de Resultados:

Del Escenario	Monto
Probable	-
Poco Probable	-
Muy poco Probable	-

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

TransID	Trans ProductID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
P17368	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					2,578,665
P17369	Cap	01/09/2021	Buy	A	MXN					2,578,665
P17371	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					2,578,665
P17403	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					5,060,913
P17404	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					5,060,913
P17405	Cap	01/09/2021	Buy	A	MXN					5,060,913
P17438	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					5,000,000
P17439	Cap	01/09/2021	Buy	A	MXN					5,000,000
P17440	Cap	01/09/2021	Sell	A	MXN					5,000,000
SED558	SC Swap	07/10/2021	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SED589	SC Swap	08/10/2021	Buy	A	MXN	2,000,000,000	MXN	2,000,000,000	MXN	
SED633	SC Swap	28/10/2021	Buy	A	MXN	3,000,000	MXN	3,000,000	MXN	
SED741	SC Swap	28/10/2021	Buy	A	MXN	3,000,000	MXN	3,000,000	MXN	
SEE337	SC Swap	19/08/2021	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEE351	SC Swap	17/09/2021	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEE401	SC Swap	19/08/2021	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEE402	SC Swap	17/09/2021	Buy	A	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEE795	SC Swap	15/10/2021	Buy	A	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SEG672	SC Swap	29/10/2021	Buy	A	MXN	1,720,000,000	MXN	1,720,000,000	MXN	

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2081975	FX	50,000	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081979	FX	50,000	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081983	FX	50,000	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081987	FX	50,000	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081991	FX	50,000	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081995	FX	50,000	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081999	FX	50,000	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082003	FX	50,000	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082007	FX	50,000	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082027	FX	50,000	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082031	FX	50,000	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082035	FX	50,000	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082039	FX	50,000	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082043	FX	50,000	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082047	FX	50,000	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082051	FX	50,000	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082055	FX	50,000	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082059	FX	50,000	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082095	FX	30,000	19-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082096	FX	30,000	26-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082097	FX	30,000	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082099	FX	30,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082100	FX	30,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082108	FX	30,000	19-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082109	FX	30,000	26-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082110	FX	30,000	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082112	FX	30,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082113	FX	30,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082139	FX	100,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082143	FX	100,000	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082147	FX	100,000	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082199	FX	100,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082203	FX	100,000	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082207	FX	100,000	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082296	FX	5,400	02-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082299	FX	9,000	15-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082301	FX	9,000	30-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082311	FX	5,400	02-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082314	FX	9,000	15-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082316	FX	9,000	30-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082337	FX	600,000	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082349	FX	600,000	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082361	FX	100,000	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082365	FX	100,000	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082385	FX	100,000	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082389	FX	100,000	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082561	FX	100,000	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082585	FX	100,000	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082613	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082637	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082661	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2082685	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083230	FX	4,497,647	31-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083232	FX	4,497,082	02-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083234	FX	8,991,122	03-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083236	FX	4,494,368	06-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083238	FX	4,493,554	07-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083240	FX	4,493,269	08-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083242	FX	4,491,136	09-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083244	FX	4,490,539	10-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083246	FX	4,490,421	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083248	FX	4,489,199	14-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083250	FX	4,486,418	15-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083252	FX	4,485,111	17-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083254	FX	4,482,737	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083256	FX	4,482,853	21-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083258	FX	4,480,687	22-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083260	FX	4,478,019	23-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083262	FX	4,477,391	24-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083264	FX	4,476,960	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083265	FX	4,476,429	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083267	FX	4,475,557	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083338	FX	60,000	10-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2083359	FX	60,000	10-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXERCISED
2081976	FX	50,000	04-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081977	FX	50,000	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081978	FX	2,101	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081980	FX	50,000	11-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081981	FX	50,000	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081982	FX	2,101	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081984	FX	50,000	18-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081985	FX	50,000	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081986	FX	2,101	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081988	FX	50,000	25-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081989	FX	50,000	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081990	FX	2,101	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081992	FX	50,000	01-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081993	FX	50,000	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081994	FX	2,101	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081996	FX	50,000	08-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081997	FX	50,000	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2081998	FX	2,101	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082000	FX	50,000	14-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082001	FX	50,000	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082002	FX	2,101	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082004	FX	50,000	22-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082005	FX	50,000	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082006	FX	2,101	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082008	FX	50,000	29-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082009	FX	50,000	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082010	FX	2,101	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082028	FX	50,000	04-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082029	FX	50,000	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082030	FX	2,101	04-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082032	FX	50,000	11-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082033	FX	50,000	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082034	FX	2,101	11-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082036	FX	50,000	18-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082037	FX	50,000	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082038	FX	2,101	18-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082040	FX	50,000	25-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082041	FX	50,000	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082042	FX	2,101	25-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082044	FX	50,000	01-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082045	FX	50,000	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082046	FX	2,101	01-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082048	FX	50,000	08-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082049	FX	50,000	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082050	FX	2,101	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082052	FX	50,000	14-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082053	FX	50,000	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082054	FX	2,101	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082056	FX	50,000	22-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082057	FX	50,000	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082058	FX	2,101	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082060	FX	50,000	29-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082061	FX	50,000	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082062	FX	2,101	29-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082092	FX	30,000	29-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082093	FX	30,000	05-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082094	FX	30,000	12-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082098	FX	30,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082105	FX	30,000	29-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082106	FX	30,000	05-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082107	FX	30,000	12-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082111	FX	30,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082118	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082119	FX	500,000	22-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082120	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082121	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082122	FX	500,000	22-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082123	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082124	FX	500,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082125	FX	500,000	23-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082126	FX	500,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082127	FX	500,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082128	FX	500,000	23-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082129	FX	500,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082130	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082131	FX	500,000	22-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082132	FX	500,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082133	FX	200,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082134	FX	200,000	22-jul-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082135	FX	200,000	22-jul-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082136	FX	200,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082137	FX	200,000	23-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082138	FX	200,000	23-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082140	FX	100,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082141	FX	100,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082142	FX	5,076	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082144	FX	100,000	20-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082145	FX	100,000	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082146	FX	5,076	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082148	FX	100,000	27-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082149	FX	100,000	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082150	FX	5,076	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082200	FX	100,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082201	FX	100,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082202	FX	5,076	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082204	FX	100,000	20-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082205	FX	100,000	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082206	FX	5,076	20-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082208	FX	100,000	27-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082209	FX	100,000	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082210	FX	5,076	27-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082295	FX	5,400	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082297	FX	5,400	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082298	FX	9,000	15-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082300	FX	9,000	15-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082302	FX	9,000	30-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082303	FX	9,000	30-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082310	FX	5,400	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082312	FX	5,400	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082313	FX	9,000	15-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082315	FX	9,000	15-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082317	FX	9,000	30-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082318	FX	9,000	30-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082325	FX	500,000	20-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082326	FX	500,000	20-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082327	FX	500,000	20-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082328	FX	500,000	20-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082329	FX	500,000	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082330	FX	500,000	02-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082331	FX	500,000	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082332	FX	500,000	02-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082338	FX	600,000	28-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082339	FX	600,000	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082340	FX	24,757	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082350	FX	600,000	28-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082351	FX	600,000	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2082352	FX	24,757	28-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082362	FX	100,000	24-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082363	FX	100,000	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082364	FX	4,358	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082366	FX	100,000	21-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082367	FX	100,000	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082368	FX	4,358	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082386	FX	100,000	24-ago-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082387	FX	100,000	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082388	FX	4,358	24-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082390	FX	100,000	21-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082391	FX	100,000	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082392	FX	4,358	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082425	FX	300,000	02-sep-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082426	FX	300,000	02-sep-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082427	FX	300,000	02-sep-21	EUR	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082428	FX	300,000	02-sep-21	EUR	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082562	FX	100,000	07-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082563	FX	100,000	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082564	FX	2,871	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082586	FX	100,000	07-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082587	FX	100,000	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082588	FX	2,871	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082614	FX	50,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082615	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082616	FX	1,474	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082638	FX	50,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082639	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082640	FX	1,474	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082662	FX	50,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082663	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082664	FX	1,238	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082686	FX	50,000	13-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082687	FX	50,000	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2082688	FX	1,238	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083229	FX	4,497,647	31-ago-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083231	FX	4,497,082	02-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083233	FX	8,991,122	03-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083235	FX	4,494,368	06-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083237	FX	4,493,554	07-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083239	FX	4,493,269	08-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083241	FX	4,491,136	09-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083243	FX	4,490,539	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083245	FX	4,490,421	13-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083247	FX	4,489,199	14-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083249	FX	4,486,418	15-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083251	FX	4,485,111	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083253	FX	4,482,737	20-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083255	FX	4,482,853	21-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083257	FX	4,480,687	22-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

Deal No	OTC type	Prin. Amt.	Expiration Date	CCY	P/C	CTR	Style	Portfolio	Status
2083259	FX	4,478,019	23-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083261	FX	4,477,391	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083263	FX	4,476,960	27-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083266	FX	4,476,429	28-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083268	FX	4,475,557	29-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083269	FX	750,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083270	FX	750,000	17-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083271	FX	750,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083272	FX	750,000	17-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083273	FX	750,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083274	FX	750,000	24-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083275	FX	750,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083276	FX	750,000	24-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083337	FX	60,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083339	FX	60,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083340	FX	60,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083341	FX	60,000	17-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083342	FX	60,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083343	FX	60,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083344	FX	60,000	24-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083345	FX	60,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083358	FX	60,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083360	FX	60,000	10-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083361	FX	60,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083362	FX	60,000	17-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083363	FX	60,000	17-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083364	FX	60,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083365	FX	60,000	24-sep-21	USD	PUT	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED
2083366	FX	60,000	24-sep-21	USD	CALL	MXN	EURO	NEGO	EXPIRED

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021080403278	SO	USDCAD	08/26/2021	(212,200,745)	1.25353	266,000,000
2021080403440	SO	CADMXN	08/26/2021	(1,239,673)	15.95261	19,776,017
2021071603582	BO	CHFUSD	07/19/2021	20,000	1.08739	(21,748)
2021070603563	S	EURMXN	07/08/2021	(107,151)	23.6647	2,535,696
2021070603564	B	EURMXN	07/14/2021	107,151	23.68576	(2,537,953)
2021061503467	BO	EURMXN	07/29/2021	80,300	24.51154	(1,968,277)
2020073103255	BO	EURUSD	07/30/2021	300,000	1.18894	(356,682)
2020081703380	SO	EURUSD	07/30/2021	(300,000)	1.19512	358,537
2021070203509	BO	EURMXN	08/03/2021	2,300,000	23.55116	(54,167,659)
2021080203290	S	EURMXN	08/03/2021	(2,300,000)	23.61562	54,315,928
2021080203291	B	EURMXN	08/24/2021	2,300,000	23.69197	(54,491,520)
2021082003547	S	EURMXN	08/24/2021	(2,300,000)	23.8533	54,862,590
2021090803226	S	EURMXN	09/10/2021	(1,900,000)	23.555	44,754,500
2021082003548	B	EURMXN	09/21/2021	2,300,000	23.95645	(55,099,841)
2021091703567	S	EURMXN	09/21/2021	(1,900,000)	23.4802	44,612,380
2021082403469	BO	EURMXN	09/30/2021	147,333	23.88893	(3,519,631)
2021082703183	BO	GBPUSD	08/31/2021	9,400,000	1.37521	(12,926,940)
2020082503343	BO	USDMXN	07/01/2021	34,000	22.70434	(771,948)
2020082503363	SO	USDMXN	07/01/2021	(34,000)	22.7717	774,238
2020102303716	BO	USDMXN	07/01/2021	125,000	21.47739	(2,684,674)
2021040603271	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	20.4244	(612,732)
2021040803219	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	20.27925	(608,378)
2021041503288	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	20.16367	(604,910)
2021041603283	B	USDMXN	07/01/2021	30,000	20.0556	(601,668)
2021041903634	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	19.99163	(599,749)
2021051003511	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	19.99655	(599,896)
2021051103165	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	19.96154	(598,846)
2021051803322	BO	USDMXN	07/01/2021	300,000	19.85235	(5,955,704)
2021051803346	BO	USDMXN	07/01/2021	60,000	19.87848	(1,192,709)
2021051803374	BO	USDMXN	07/01/2021	500,000	19.85034	(9,925,172)
2021052603541	SO	USDMXN	07/01/2021	(87,000)	19.95998	1,736,518
2021052603565	SO	USDMXN	07/01/2021	(745)	19.95755	14,861
2021060103399	BO	USDMXN	07/01/2021	823	20.03379	(16,492)
2021060103290	SO	USDMXN	07/01/2021	(60,000)	19.99094	1,199,457
2021060203241	B	USDMXN	07/01/2021	471,150	19.97911	(9,413,159)
2021060303235	BO	USDMXN	07/01/2021	441,000	20.11472	(8,870,590)
2021060303236	BO	USDMXN	07/01/2021	30,150	20.12661	(606,817)
2021060303265	SO	USDMXN	07/01/2021	(77,000)	20.1576	1,552,135
2021060303483	SO	USDMXN	07/01/2021	(113)	20.20362	2,288
2021060403244	B	USDMXN	07/01/2021	442,300	19.97761	(8,836,096)
2021060703162	BO	USDMXN	07/01/2021	500,000	19.88571	(9,942,856)
2021060703327	BO	USDMXN	07/01/2021	30,000	19.84963	(595,489)
2021060703490	BO	USDMXN	07/01/2021	470,000	19.83154	(9,320,822)
2021060703491	BO	USDMXN	07/01/2021	470,000	19.84858	(9,328,830)
2021060703492	BO	USDMXN	07/01/2021	2,300	19.84879	(45,651)
2021060803269	BO	USDMXN	07/01/2021	470,000	19.81694	(9,313,964)
2021060803474	BO	USDMXN	07/01/2021	1,150	19.75936	(22,723)
2021060903527	B	USDMXN	07/01/2021	442,300	19.77534	(8,746,631)
2021061003361	B	USDMXN	07/01/2021	471,150	19.74927	(9,304,870)
2021061103423	BO	USDMXN	07/01/2021	471,150	19.97354	(9,410,533)
2021061403172	BO	USDMXN	07/01/2021	471,000	19.93605	(9,389,880)
2021061403221	BO	USDMXN	07/01/2021	150	19.95115	(2,992)
2021061403226	B	USDMXN	07/01/2021	2,000,000	19.94505	(39,890,104)
2021061403302	BO	USDMXN	07/01/2021	471,150	19.94705	(9,398,051)
2021061503430	BO	USDMXN	07/01/2021	471,150	20.20568	(9,519,907)
2021061503431	BO	USDMXN	07/01/2021	471,150	20.16662	(9,501,503)
2021061503640	SO	USDMXN	07/01/2021	(50,000)	20.09318	1,004,659
2021061603463	SO	USDMXN	07/01/2021	(176,000)	20.26614	3,566,840
2021062403175	BO	USDMXN	07/01/2021	1,500,000	20.06273	(30,094,101)
2021070103021	S	USDMXN	07/01/2021	(15,000,000)	19.96	299,400,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021070103042	SO	USDMXN	07/01/2021	(9,000,000)	19.9618	179,656,209
2021070103093	SO	USDMXN	07/01/2021	(1,000,000)	20.0368	20,036,800
2021010603404	BO	USDMXN	07/02/2021	50,000	20.01036	(1,000,519)
2021010603391	SO	USDMXN	07/02/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021011203439	BO	USDMXN	07/02/2021	25,000	20.21064	(505,266)
2021011203397	SO	USDMXN	07/02/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011803215	BO	USDMXN	07/02/2021	25,000	20.09941	(502,486)
2021011803116	SO	USDMXN	07/02/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021031603491	BO	USDMXN	07/02/2021	60,126	20.79991	(1,250,613)
2021040803280	BO	USDMXN	07/02/2021	250,000	20.34503	(5,086,257)
2021042003396	BO	USDMXN	07/02/2021	65,000	20.06078	(1,303,951)
2021051203478	BO	USDMXN	07/02/2021	50,000	20.23819	(1,011,910)
2021060903064	BO	USDMXN	07/02/2021	500,000	19.66165	(9,830,825)
2021062203246	SO	USDMXN	07/02/2021	(109,000)	20.49701	2,234,174
2021062203488	SO	USDMXN	07/02/2021	(158)	20.38494	3,217
2021062503273	BO	USDMXN	07/02/2021	500,000	19.74718	(9,873,590)
2021062503066	SO	USDMXN	07/02/2021	(113,000)	19.75727	2,232,572
2021062503336	SO	USDMXN	07/02/2021	(4,045)	19.78433	80,029
2021063003229	B	USDMXN	07/02/2021	2,000,000	19.9439	(39,887,800)
2021063003347	B	USDMXN	07/02/2021	2,000,000	19.939	(39,878,000)
2020082803176	S	MXNUSD	07/06/2021	(88,150,351)	22.66418	3,889,413
2020082803180	S	MXNUSD	07/06/2021	(94,246,085)	22.66228	4,158,721
2020082803454	SO	USDMXN	07/06/2021	(61,742)	22.66417	1,399,323
2020092903453	B	USDMXN	07/06/2021	86,561	23.14012	(2,003,030)
2020092903372	SO	USDMXN	07/06/2021	(8,072,954)	22.59352	182,396,436
2021040503450	BO	USDMXN	07/06/2021	1,000,000	20.57255	(20,572,546)
2021040503451	BO	USDMXN	07/06/2021	1,000,000	20.57299	(20,572,993)
2021040603603	BO	USDMXN	07/06/2021	337,500	20.39157	(6,882,157)
2021050603337	BO	USDMXN	07/06/2021	750,000	20.31016	(15,232,619)
2021051003536	BO	USDMXN	07/06/2021	23,559	20.0239	(471,749)
2021051703509	BO	USDMXN	07/06/2021	100,000	19.88648	(1,988,648)
2021060403326	SO	USDMXN	07/06/2021	(64,000)	19.99362	1,279,592
2021060403401	SO	USDMXN	07/06/2021	(55,000)	19.99593	1,099,776
2021060403451	SO	USDMXN	07/06/2021	(2,092)	20.01959	41,878
2021060803070	SO	USDMXN	07/06/2021	(37,000)	19.82341	733,466
2021060803243	SO	USDMXN	07/06/2021	(200)	19.81832	3,964
2021060903066	BO	USDMXN	07/06/2021	500,000	19.67	(9,835,002)
2021061703683	SO	USDMXN	07/06/2021	(423,000)	20.47674	8,661,660
2021070103022	B	USDMXN	07/06/2021	15,000,000	19.97275	(299,591,250)
2021070603212	BO	USDMXN	07/06/2021	10,000,000	19.9809	(199,809,010)
2021070603072	S	USDMXN	07/06/2021	(20,000,000)	19.93	398,600,000
2020091503417	SO	USDMXN	07/07/2021	(829,247)	21.81848	18,092,905
2020091503420	SO	USDMXN	07/07/2021	(305)	21.79701	6,653
2020100503493	BO	USDMXN	07/07/2021	600,000	22.01647	(13,209,881)
2020100503229	SO	USDMXN	07/07/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020101303366	B	USDMXN	07/07/2021	1,000,000	22.04398	(22,043,983)
2020110503563	BO	USDMXN	07/07/2021	900,000	21.35413	(19,218,720)
2020110503413	SO	USDMXN	07/07/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021011403555	SO	USDMXN	07/07/2021	(94,956)	20.09456	1,908,101
2021021703063	BO	USDMXN	07/07/2021	110,000	20.56773	(2,262,451)
2021021703253	BO	USDMXN	07/07/2021	392	20.49473	(8,039)
2021022503762	BO	USDMXN	07/07/2021	1,000,000	21.17825	(21,178,252)
2021022503448	SO	USDMXN	07/07/2021	(90,511)	21.11765	1,911,379
2021030403320	SO	USDMXN	07/07/2021	(90,636)	21.05423	1,908,263
2021030403594	SO	USDMXN	07/07/2021	(100,000)	21.40267	2,140,267
2021041403161	BO	USDMXN	07/07/2021	300,000	20.26224	(6,078,673)
2021041403408	B	USDMXN	07/07/2021	100,000	20.24136	(2,024,136)
2021042103693	BO	USDMXN	07/07/2021	315,000	20.06541	(6,320,603)
2021042103752	BO	USDMXN	07/07/2021	17,000	20.06549	(341,113)
2021042703353	SO	USDMXN	07/07/2021	(254,456)	20.14443	5,125,873

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021051703330	BO	USDMXN	07/07/2021	750,000	19.90914	(14,931,853)
2021060203285	S	USDMXN	07/07/2021	(1,000,000)	19.98684	19,986,835
2021060303551	BO	USDMXN	07/07/2021	22,850	20.2165	(461,947)
2021060403601	S	USDMXN	07/07/2021	(136,663)	20.01528	2,735,349
2021060403621	SO	USDMXN	07/07/2021	(2,417)	20.01538	48,368
2021061003142	SO	USDMXN	07/07/2021	(50,000)	19.74823	987,411
2021061003143	SO	USDMXN	07/07/2021	(4,300)	19.74983	84,924
2021061003281	SO	USDMXN	07/07/2021	(43)	19.72256	841
2021070203022	S	USDMXN	07/07/2021	(4,000,000)	19.8419	79,367,600
2021070503249	S	USDMXN	07/07/2021	(50,000)	19.84729	992,365
2020090103551	BO	USDMXN	07/08/2021	34,000	22.485	(764,490)
2020090103562	SO	USDMXN	07/08/2021	(34,000)	22.5969	768,295
2020092903054	B	USDMXN	07/08/2021	1,967,561	22.9801	(45,214,745)
2021012703400	SO	USDMXN	07/08/2021	(55,477)	20.58589	1,142,051
2021020303232	SO	USDMXN	07/08/2021	(55,596)	20.54712	1,142,341
2021021003393	SO	USDMXN	07/08/2021	(56,021)	20.3386	1,139,395
2021021703460	SO	USDMXN	07/08/2021	(55,778)	20.49469	1,143,152
2021022403161	SO	USDMXN	07/08/2021	(80,574)	20.79639	1,675,646
2021031003480	SO	USDMXN	07/08/2021	(78,965)	21.24345	1,677,499
2021032403233	SO	USDMXN	07/08/2021	(79,765)	21.01872	1,676,566
2021040603272	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.44028	(613,208)
2021040803220	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.29535	(608,861)
2021041503287	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.17951	(605,385)
2021041603285	B	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.06919	(602,076)
2021041903635	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.00733	(600,220)
2021042003683	BO	USDMXN	07/08/2021	100,000	20.13794	(2,013,794)
2021051003512	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	20.01225	(600,368)
2021051103166	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	19.97731	(599,319)
2021051803323	BO	USDMXN	07/08/2021	400,000	19.86834	(7,947,335)
2021051803347	BO	USDMXN	07/08/2021	60,000	19.89449	(1,193,670)
2021051803375	BO	USDMXN	07/08/2021	500,000	19.86634	(9,933,169)
2021060703164	BO	USDMXN	07/08/2021	500,000	19.91586	(9,957,928)
2021060703328	BO	USDMXN	07/08/2021	30,000	19.86469	(595,941)
2021060703336	SO	USDMXN	07/08/2021	(141,000)	19.84707	2,798,438
2021060703436	SO	USDMXN	07/08/2021	(309)	19.85807	6,142
2021061503641	SO	USDMXN	07/08/2021	(50,000)	20.10825	1,005,413
2021061803375	SO	USDMXN	07/08/2021	(3,250,000)	20.75451	67,452,161
2021062503295	BO	USDMXN	07/08/2021	400,000	19.7973	(7,918,920)
2021062503118	SO	USDMXN	07/08/2021	(151,000)	19.81142	2,991,524
2021062503338	SO	USDMXN	07/08/2021	(477)	19.79855	9,442
2021062803504	B	USDMXN	07/08/2021	50,000	19.84727	(992,363)
2021062903307	B	USDMXN	07/08/2021	3,250,000	19.84363	(64,491,794)
2021070603073	B	USDMXN	07/08/2021	20,000,000	19.935	(398,700,000)
2020112403120	BO	USDMXN	07/09/2021	136,200	20.56585	(2,801,068)
2020112403023	SO	USDMXN	07/09/2021	(136,200)	20.5661	2,801,103
2021010603528	B	USDMXN	07/09/2021	50,000	20.08149	(1,004,075)
2021010603393	SO	USDMXN	07/09/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021011203440	BO	USDMXN	07/09/2021	25,000	20.22633	(505,658)
2021011203398	SO	USDMXN	07/09/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011803216	BO	USDMXN	07/09/2021	25,000	20.11523	(502,881)
2021011803117	SO	USDMXN	07/09/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021012103105	BO	USDMXN	07/09/2021	995,000	20.0786	(19,978,208)
2021012103108	SO	USDMXN	07/09/2021	(995,000)	20.0961	19,995,620
2021040803281	BO	USDMXN	07/09/2021	250,000	20.36117	(5,090,293)
2021042003680	BO	USDMXN	07/09/2021	50,000	20.14022	(1,007,011)
2021051203479	BO	USDMXN	07/09/2021	50,000	20.25447	(1,012,724)
2021062503122	SO	USDMXN	07/09/2021	(73,000)	19.82038	1,446,888
2021062503340	SO	USDMXN	07/09/2021	(895)	19.79912	17,726
2021062503475	SO	USDMXN	07/09/2021	(58,000)	19.88678	1,153,433
2021062503550	SO	USDMXN	07/09/2021	(144)	19.87823	2,854

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021062803236	SO	USDMXN	07/09/2021	(121,000)	19.84166	2,400,841
2021062803402	SO	USDMXN	07/09/2021	(627)	19.83967	12,448
2021070703380	S	USDMXN	07/09/2021	(50,000)	19.9465	997,325
2021070703478	S	USDMXN	07/09/2021	(50,000)	19.9583	997,915
2021070903069	B	USDMXN	07/09/2021	10,000,000	19.88302	(198,830,159)
2021070903073	S	USDMXN	07/09/2021	(20,000,000)	19.87955	397,591,062
2020112303045	BO	USDMXN	07/12/2021	250,000	20.57793	(5,144,483)
2020112303034	SO	USDMXN	07/12/2021	(250,000)	20.5815	5,145,375
2020112703397	BO	USDMXN	07/12/2021	250,000	20.59935	(5,149,836)
2020112703422	SO	USDMXN	07/12/2021	(250,000)	20.601	5,150,250
2020121603226	BO	USDMXN	07/12/2021	250,000	20.41012	(5,102,531)
2020121603080	SO	USDMXN	07/12/2021	(250,000)	20.411	5,102,750
2020122403089	BO	USDMXN	07/12/2021	300,000	20.34533	(6,103,600)
2020122403083	SO	USDMXN	07/12/2021	(300,000)	20.3613	6,108,390
2021021103286	BO	USDMXN	07/12/2021	306,000	20.29315	(6,209,705)
2021040803637	BO	USDMXN	07/12/2021	337,500	20.3088	(6,854,221)
2021041503034	BO	USDMXN	07/12/2021	300,000	20.16439	(6,049,317)
2021050703228	BO	USDMXN	07/12/2021	400,000	20.16957	(8,067,827)
2021051703506	BO	USDMXN	07/12/2021	100,000	19.90011	(1,990,011)
2021060903108	BO	USDMXN	07/12/2021	300,000	19.70617	(5,911,850)
2021061003173	SO	USDMXN	07/12/2021	(115,000)	19.75074	2,271,335
2021061003280	SO	USDMXN	07/12/2021	(798)	19.73387	15,756
2021061703498	S	USDMXN	07/12/2021	(400,000)	20.47707	8,190,829
2021062103236	SO	USDMXN	07/12/2021	(40,000)	20.63509	825,403
2021062103265	SO	USDMXN	07/12/2021	(1,512)	20.56427	31,087
2021062803193	BO	USDMXN	07/12/2021	40,000	19.81298	(792,520)
2021062803404	SO	USDMXN	07/12/2021	(120,000)	19.84434	2,381,321
2021062803454	SO	USDMXN	07/12/2021	(825)	19.84273	16,376
2021070803362	B	USDMXN	07/12/2021	500,000	19.9742	(9,987,100)
2021070803490	S	USDMXN	07/12/2021	(184,332)	19.99104	3,684,996
2021070803492	S	USDMXN	07/12/2021	(172,802)	19.99188	3,454,646
2021070803494	S	USDMXN	07/12/2021	(132,338)	19.99131	2,645,607
2021070903074	B	USDMXN	07/12/2021	20,000,000	19.88742	(397,748,330)
2021070903003	SO	USDMXN	07/12/2021	(20,000,000)	20.01611	400,322,140
2021070903070	S	USDMXN	07/12/2021	(10,000,000)	19.8904	198,903,965
2021021103287	BO	USDMXN	07/13/2021	94,000	20.29545	(1,907,772)
2021040503472	BO	USDMXN	07/13/2021	540,000	20.57904	(11,112,680)
2021040503489	BO	USDMXN	07/13/2021	477	20.57394	(9,816)
2021042203663	BO	USDMXN	07/13/2021	103,000	20.12867	(2,073,253)
2021042203671	BO	USDMXN	07/13/2021	289	20.13409	(5,816)
2021042603422	BO	USDMXN	07/13/2021	654,000	20.03223	(13,101,079)
2021042603479	BO	USDMXN	07/13/2021	336	20.02594	(6,738)
2021060703599	BO	USDMXN	07/13/2021	9,154	19.86539	(181,842)
2021061703576	BO	USDMXN	07/13/2021	272,000	20.50177	(5,576,482)
2021061703717	BO	USDMXN	07/13/2021	178	20.51751	(3,642)
2021062103304	BO	USDMXN	07/13/2021	9,446	20.56408	(194,249)
2021062403298	BO	USDMXN	07/13/2021	288,000	20.00853	(5,762,456)
2021062403354	BO	USDMXN	07/13/2021	392	20.01933	(7,855)
2021070903194	S	USDMXN	07/13/2021	(100,000)	19.8836	1,988,360
2021070903196	S	USDMXN	07/13/2021	(100,000)	19.8859	1,988,590
2021070903198	S	USDMXN	07/13/2021	(100,000)	19.8851	1,988,510
2021070903212	S	USDMXN	07/13/2021	(100,000)	19.8872	1,988,720
2021070903216	S	USDMXN	07/13/2021	(100,000)	19.8835	1,988,350
2021071303357	S	USDMXN	07/13/2021	(12,000,000)	20.06	240,720,000
2020100503494	BO	USDMXN	07/14/2021	600,000	22.03483	(13,220,898)
2020100503230	SO	USDMXN	07/14/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503565	BO	USDMXN	07/14/2021	900,000	21.37211	(19,234,901)
2020110503433	SO	USDMXN	07/14/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
202011203512	BO	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.22635	(5,056,588)
202011203520	SO	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.228	5,057,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021011403364	BO	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.10817	(5,027,042)
2021011403367	BO	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.10408	(5,026,021)
2021011403365	SO	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.10319	5,025,797
2021011403539	S	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.12266	5,030,665
2021011503211	BO	USDMXN	07/14/2021	1,227,749	20.2704	(24,886,957)
2021011503100	SO	USDMXN	07/14/2021	(1,227,749)	20.251	24,863,145
2021012003109	BO	USDMXN	07/14/2021	250,000	20.01564	(5,003,910)
2021012003323	BO	USDMXN	07/14/2021	954,074	19.98177	(19,064,084)
2021012003628	BO	USDMXN	07/14/2021	333,347	19.95049	(6,650,437)
2021012003015	SO	USDMXN	07/14/2021	(250,000)	20.01	5,002,500
2021012003227	SO	USDMXN	07/14/2021	(954,074)	19.9662	19,049,232
2021012003571	SO	USDMXN	07/14/2021	(333,347)	19.9372	6,646,006
2021012103210	BO	USDMXN	07/14/2021	754,976	20.07823	(15,158,580)
2021012103159	SO	USDMXN	07/14/2021	(754,976)	20.0648	15,148,442
2021012603497	BO	USDMXN	07/14/2021	92,945	20.36971	(1,893,262)
2021012703791	BO	USDMXN	07/14/2021	86,637	20.65147	(1,789,181)
2021020403615	B	USDMXN	07/14/2021	2,637,610	20.73757	(54,697,633)
2021021203539	BO	USDMXN	07/14/2021	111,607	20.27469	(2,262,797)
2021021703066	BO	USDMXN	07/14/2021	70,000	20.59203	(1,441,442)
2021021703254	BO	USDMXN	07/14/2021	743	20.50609	(15,239)
2021030303434	BO	USDMXN	07/14/2021	20,127	21.19592	(426,610)
2021030403596	SO	USDMXN	07/14/2021	(100,000)	21.41856	2,141,856
2021032403102	BO	USDMXN	07/14/2021	87,195	21.03381	(1,834,043)
2021040603618	BO	USDMXN	07/14/2021	3,844,746	20.40658	(78,458,125)
2021041303220	BO	USDMXN	07/14/2021	4,162,000	20.25913	(84,318,512)
2021041303302	BO	USDMXN	07/14/2021	584	20.25976	(11,823)
2021041403412	B	USDMXN	07/14/2021	100,000	20.25733	(2,025,733)
2021042103274	BO	USDMXN	07/14/2021	300,000	20.08129	(6,024,388)
2021042103694	BO	USDMXN	07/14/2021	315,000	20.0814	(6,325,641)
2021042103753	BO	USDMXN	07/14/2021	17,000	20.0815	(341,385)
2021042203375	BO	USDMXN	07/14/2021	959,724	20.07719	(19,268,561)
2021042203403	SO	USDMXN	07/14/2021	(450)	20.10144	9,046
2021042303378	BO	USDMXN	07/14/2021	200,371	20.01682	(4,010,790)
2021042303579	BO	USDMXN	07/14/2021	141,442	20.01502	(2,830,965)
2021042703601	BO	USDMXN	07/14/2021	286,154	20.22696	(5,788,024)
2021043003600	BO	USDMXN	07/14/2021	255,720	20.39086	(5,214,351)
2021050403433	BO	USDMXN	07/14/2021	200,000	20.40046	(4,080,092)
2021050403456	BO	USDMXN	07/14/2021	1,169	20.39045	(23,836)
2021050603554	BO	USDMXN	07/14/2021	63,938	20.23043	(1,293,493)
2021051103302	BO	USDMXN	07/14/2021	2,251,600	20.05433	(45,154,330)
2021051103303	BO	USDMXN	07/14/2021	21	20.05173	(420)
2021052103492	BO	USDMXN	07/14/2021	97,681	20.08838	(1,962,253)
2021052803628	BO	USDMXN	07/14/2021	10,853	20.01038	(217,173)
2021060103427	BO	USDMXN	07/14/2021	4,332,142	20.05884	(86,897,734)
2021060903557	BO	USDMXN	07/14/2021	63,200	19.80705	(1,251,806)
2021061403325	BO	USDMXN	07/14/2021	20,340	20.0127	(407,058)
2021061403465	BO	USDMXN	07/14/2021	10	20.01779	(200)
2021061503504	BO	USDMXN	07/14/2021	43,350	20.14252	(873,178)
2021061503473	SO	USDMXN	07/14/2021	(5,000,000)	20.16094	100,804,705
2021061503483	SO	USDMXN	07/14/2021	(8,089,000)	20.1624	163,093,686
2021061503688	SO	USDMXN	07/14/2021	(335)	20.07827	6,733
2021062103169	SO	USDMXN	07/14/2021	(227,000)	20.67711	4,693,705
2021062103209	SO	USDMXN	07/14/2021	(62)	20.67148	1,273
2021062103267	SO	USDMXN	07/14/2021	(3,934)	20.57602	80,947
2021071203465	B	USDMXN	07/14/2021	1,550	19.88006	(30,814)
2021071203247	S	USDMXN	07/14/2021	(495,000)	19.8301	9,815,900
2021071203330	S	USDMXN	07/14/2021	(495,000)	19.8453	9,823,424
2021071203333	S	USDMXN	07/14/2021	(500,000)	19.8444	9,922,200
2021071203335	S	USDMXN	07/14/2021	(500,000)	19.8444	9,922,200
2021071203339	S	USDMXN	07/14/2021	(500,000)	19.8469	9,923,450

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021071303358	B	USDMXN	07/14/2021	12,000,000	20.0624	(240,748,800)
2021071403272	S	USDMXN	07/14/2021	(35,198,874)	19.887	700,000,000
2021071403419	S	USDMXN	07/14/2021	(10,000,000)	19.875	198,750,000
2021071503199	B	USDMXN	07/14/2021	1,000,000	19.91	(19,910,000)
2020091503037	BO	USDMXN	07/15/2021	500,000	21.76782	(10,883,910)
2020091503032	SO	USDMXN	07/15/2021	(500,000)	21.82	10,910,000
2020111903585	BO	USDMXN	07/15/2021	484,000	20.7299	(10,033,270)
2021012103639	B	USDMXN	07/15/2021	1,300,000	20.098	(26,127,400)
2021012103627	SO	USDMXN	07/15/2021	(1,300,000)	20.1244	26,161,720
2021040603273	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.45684	(613,705)
2021040803221	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.31157	(609,347)
2021041503289	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.19535	(605,860)
2021041603287	B	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.08554	(602,566)
2021041903636	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.02304	(600,691)
2021042003684	BO	USDMXN	07/15/2021	100,000	20.15389	(2,015,389)
2021051003513	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	20.02812	(600,844)
2021051103167	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	19.99318	(599,795)
2021051803348	BO	USDMXN	07/15/2021	60,000	19.91051	(1,194,631)
2021052403308	BO	USDMXN	07/15/2021	1,000,000	19.97619	(19,976,194)
2021060403569	B	USDMXN	07/15/2021	1,000,000	20.02897	(20,028,974)
2021060403757	BO	USDMXN	07/15/2021	20,900	20.03892	(418,813)
2021060703165	BO	USDMXN	07/15/2021	1,000,000	19.96634	(19,966,340)
2021060703345	BO	USDMXN	07/15/2021	30,000	19.87999	(596,400)
2021061503642	SO	USDMXN	07/15/2021	(50,000)	20.12359	1,006,179
2021061603542	SO	USDMXN	07/15/2021	(175,000)	20.29782	3,552,119
2021061703113	SO	USDMXN	07/15/2021	(175,000)	20.60238	3,605,416
2021062403344	BO	USDMXN	07/15/2021	300,000	20.03364	(6,010,093)
2021062903683	BO	USDMXN	07/15/2021	100,000	19.8552	(1,985,520)
2021062903682	SO	USDMXN	07/15/2021	(50,000)	19.85732	992,866
2021070103179	SO	USDMXN	07/15/2021	(1,000,000)	20.02	20,020,003
2021070203590	BO	USDMXN	07/15/2021	50,000	19.78588	(989,294)
2021071303242	B	USDMXN	07/15/2021	500,000	19.99909	(9,999,545)
2021071303240	S	USDMXN	07/15/2021	(494,225)	19.99527	9,882,162
2021071403273	B	USDMXN	07/15/2021	35,194,626	19.8894	(700,000,000)
2021071403420	B	USDMXN	07/15/2021	10,000,000	19.8774	(198,774,000)
2021071403129	S	USDMXN	07/15/2021	(2,500,000)	19.9	49,750,000
2021071503112	B	USDMXN	07/15/2021	191,208	19.91903	(3,808,684)
2021071503200	S	USDMXN	07/15/2021	(1,000,000)	19.9125	19,912,500
2021071503382	S	USDMXN	07/15/2021	(40,000,000)	19.987	799,480,000
2021020303432	B	USDMXN	07/16/2021	837,400	20.39956	(17,082,588)
2021020303280	SO	USDMXN	07/16/2021	(837,400)	20.4021	17,084,719
2021010603405	BO	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.04164	(1,002,082)
2021010603398	SO	USDMXN	07/16/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021011203442	BO	USDMXN	07/16/2021	25,000	20.24206	(506,051)
2021011203399	SO	USDMXN	07/16/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011803217	BO	USDMXN	07/16/2021	25,000	20.13105	(503,276)
2021011803118	SO	USDMXN	07/16/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021021103288	BO	USDMXN	07/16/2021	95,000	20.30235	(1,928,723)
2021040603501	BO	USDMXN	07/16/2021	80,435	20.37469	(1,638,834)
2021040803282	BO	USDMXN	07/16/2021	250,000	20.37753	(5,094,382)
2021041903254	BO	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.02057	(1,001,029)
2021042003681	BO	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.15616	(1,007,808)
2021042303314	BO	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.02148	(1,001,074)
2021051203480	BO	USDMXN	07/16/2021	50,000	20.27076	(1,013,538)
2021062803453	SO	USDMXN	07/16/2021	(306,000)	19.84773	6,073,405
2021071403132	B	USDMXN	07/16/2021	2,500,000	19.9031	(49,757,750)
2021071403348	S	USDMXN	07/16/2021	(494,225)	19.87	9,820,251
2021071503383	B	USDMXN	07/16/2021	40,000,000	19.98945	(799,578,000)
2021071603031	S	USDMXN	07/16/2021	(35,000,000)	19.864	695,240,000
2021071603578	S	USDMXN	07/16/2021	(13,000,000)	19.91	258,830,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012003207	BO	USDMXN	07/19/2021	1,000,000	19.97073	(19,970,731)
2021012003239	SO	USDMXN	07/19/2021	(1,000,000)	19.976	19,976,000
2021012103162	BO	USDMXN	07/19/2021	250,000	20.07114	(5,017,786)
2021012103035	SO	USDMXN	07/19/2021	(250,000)	20.097	5,024,250
2021012203036	BO	USDMXN	07/19/2021	5,000,000	20.1705	(100,852,500)
2021012203037	BO	USDMXN	07/19/2021	3,000,000	20.2655	(60,796,500)
2021012203038	SO	USDMXN	07/19/2021	(5,000,000)	20.19431	100,971,550
2021012203039	SO	USDMXN	07/19/2021	(3,000,000)	20.29317	60,879,522
2021021503153	BO	USDMXN	07/19/2021	200,000	20.22432	(4,044,865)
2021051703505	BO	USDMXN	07/19/2021	100,000	19.91602	(1,991,602)
2021061603149	SO	USDMXN	07/19/2021	(200,000)	20.1428	4,028,561
2021061603362	SO	USDMXN	07/19/2021	(929)	20.09497	18,676
2021062403543	BO	USDMXN	07/19/2021	65,000	19.90307	(1,293,700)
2021062503151	BO	USDMXN	07/19/2021	300,000	19.78196	(5,934,587)
2021062803192	BO	USDMXN	07/19/2021	40,000	19.83065	(793,226)
2021062803452	SO	USDMXN	07/19/2021	(183,000)	19.85514	3,633,491
2021070203331	BO	USDMXN	07/19/2021	122,000	19.84021	(2,420,505)
2021070203372	BO	USDMXN	07/19/2021	522	19.82924	(10,355)
2021070803485	SO	USDMXN	07/19/2021	(130,000)	20.00517	2,600,672
2021071503372	B	USDMXN	07/19/2021	500,000	19.99625	(9,998,125)
2021071503392	S	USDMXN	07/19/2021	(494,225)	19.9861	9,877,630
2021071503407	S	USDMXN	07/19/2021	(250,000)	19.98195	4,995,488
2021071503410	S	USDMXN	07/19/2021	(250,000)	19.9826	4,995,650
2021071603032	B	USDMXN	07/19/2021	35,000,000	19.8713	(695,495,500)
2021071603579	B	USDMXN	07/19/2021	13,000,000	19.9176	(258,928,800)
2021071903443	S	USDMXN	07/19/2021	(50,000,000)	20.05	1,002,500,000
2021071903473	S	USDMXN	07/19/2021	(7,000,000)	20.04	140,280,000
2021060403453	B	USDMXN	07/20/2021	68,134	20.05537	(1,366,458)
2021061103172	BO	USDMXN	07/20/2021	115,000	19.99454	(2,299,372)
2021061103425	BO	USDMXN	07/20/2021	152	20.01813	(3,038)
2021061503253	BO	USDMXN	07/20/2021	50,000	20.19001	(1,009,500)
2021062103335	BO	USDMXN	07/20/2021	800,000	20.55817	(16,446,534)
2021062103374	SO	USDMXN	07/20/2021	(800,000)	20.55867	16,446,935
2021070803486	SO	USDMXN	07/20/2021	(274,000)	20.00762	5,482,089
2021071603155	S	USDMXN	07/20/2021	(494,225)	19.8464	9,808,587
2021071603296	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000)	19.8339	1,983,390
2021071603303	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000)	19.8342	1,983,420
2021071603308	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000)	19.84257	1,984,257
2021071603311	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000)	19.84523	1,984,523
2021071603313	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000)	19.84511	1,984,511
2021071603551	S	USDMXN	07/20/2021	(494,225)	19.8817	9,826,033
2021071603556	S	USDMXN	07/20/2021	(500,000)	19.884	9,942,000
2021071903444	B	USDMXN	07/20/2021	50,000,000	20.0525	(1,002,625,000)
2021071903474	B	USDMXN	07/20/2021	7,000,000	20.0431	(140,301,700)
2021071903239	S	USDMXN	07/20/2021	(3,000,000)	20.00215	60,006,447
2021072003032	S	USDMXN	07/20/2021	(20,000,000)	20.18	403,600,000
2020100503495	BO	USDMXN	07/21/2021	600,000	22.05319	(13,231,913)
2020100503231	SO	USDMXN	07/21/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503564	BO	USDMXN	07/21/2021	900,000	21.39035	(19,251,314)
2020110503436	SO	USDMXN	07/21/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021012103418	SO	USDMXN	07/21/2021	(33,356)	20.16955	672,778
2021012103504	SO	USDMXN	07/21/2021	(61,411)	20.16928	1,238,623
2021021903003	SO	USDMXN	07/21/2021	(90,000)	20.76157	1,868,542
2021021903443	SO	USDMXN	07/21/2021	(1,924)	20.81198	40,032
2021030403321	SO	USDMXN	07/21/2021	(90,537)	21.08564	1,909,025
2021030403595	SO	USDMXN	07/21/2021	(100,000)	21.43448	2,143,448
2021041403416	B	USDMXN	07/21/2021	100,000	20.27367	(2,027,367)
2021042103695	BO	USDMXN	07/21/2021	315,000	20.09739	(6,330,678)
2021042103754	BO	USDMXN	07/21/2021	17,000	20.0975	(341,657)
2021042703354	SO	USDMXN	07/21/2021	(254,040)	20.17677	5,125,703

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021042803493	BO	USDMXN	07/21/2021	1,000,000	20.06124	(20,061,242)
2021050403086	SO	USDMXN	07/21/2021	(250,000)	20.42511	5,106,278
2021050403218	SO	USDMXN	07/21/2021	(943)	20.42385	19,250
2021050703223	BO	USDMXN	07/21/2021	300,000	20.10445	(6,031,336)
2021050703674	BO	USDMXN	07/21/2021	300,000	20.08908	(6,026,723)
2021061703477	BO	USDMXN	07/21/2021	56,200	20.47922	(1,150,932)
2021061703562	BO	USDMXN	07/21/2021	20,600	20.53201	(422,959)
2021062503152	BO	USDMXN	07/21/2021	400,000	19.78699	(7,914,795)
2021062903664	SO	USDMXN	07/21/2021	(297,000)	19.8724	5,902,101
2021062903677	SO	USDMXN	07/21/2021	(823)	19.87149	16,354
2021070203452	BO	USDMXN	07/21/2021	250,000	19.80175	(4,950,439)
2021071403441	BO	USDMXN	07/21/2021	400,000	19.90252	(7,961,007)
2021071403471	SO	USDMXN	07/21/2021	(400,000)	19.89366	7,957,463
2021071903240	B	USDMXN	07/21/2021	3,000,000	20.0049	(60,014,700)
2021071903544	B	USDMXN	07/21/2021	50,000	20.07438	(1,003,719)
2021071903546	B	USDMXN	07/21/2021	50,000	20.074	(1,003,700)
2021071903548	B	USDMXN	07/21/2021	50,000	20.07262	(1,003,631)
2021071903551	B	USDMXN	07/21/2021	50,000	20.07374	(1,003,687)
2021071903553	B	USDMXN	07/21/2021	50,000	20.07262	(1,003,631)
2021071903226	S	USDMXN	07/21/2021	(3,000,000)	19.9972	59,991,600
2021071903428	S	USDMXN	07/21/2021	(494,225)	20.0502	9,909,310
2021071903430	S	USDMXN	07/21/2021	(39,227)	20.04908	786,474
2021071903432	S	USDMXN	07/21/2021	(19,524)	20.04859	391,430
2021072003033	B	USDMXN	07/21/2021	20,000,000	20.18275	(403,655,000)
2020090903474	BO	USDMXN	07/22/2021	34,000	22.28718	(757,764)
2020090903495	SO	USDMXN	07/22/2021	(34,000)	22.363	760,342
2021012703397	SO	USDMXN	07/22/2021	(55,445)	20.61792	1,143,162
2021021003394	SO	USDMXN	07/22/2021	(55,940)	20.37056	1,139,538
2021021703461	SO	USDMXN	07/22/2021	(55,688)	20.52473	1,142,986
2021030303311	SO	USDMXN	07/22/2021	(79,021)	21.2275	1,677,423
2021031003483	SO	USDMXN	07/22/2021	(78,847)	21.2763	1,677,565
2021032403158	SO	USDMXN	07/22/2021	(79,621)	21.06742	1,677,419
2021040603274	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.4734	(614,202)
2021040803222	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.32795	(609,839)
2021041503290	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.21157	(606,347)
2021041603290	B	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.10281	(603,084)
2021041903637	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.03882	(601,165)
2021042003652	BO	USDMXN	07/22/2021	50,000	20.17299	(1,008,649)
2021042003685	BO	USDMXN	07/22/2021	50,000	20.16984	(1,008,492)
2021042103611	BO	USDMXN	07/22/2021	200,000	20.09652	(4,019,305)
2021042303271	BO	USDMXN	07/22/2021	500,000	20.05502	(10,027,508)
2021050603548	BO	USDMXN	07/22/2021	500,000	20.25328	(10,126,641)
2021051003514	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.04421	(601,326)
2021051103168	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	20.00926	(600,278)
2021051803321	BO	USDMXN	07/22/2021	400,000	19.90042	(7,960,167)
2021051803349	BO	USDMXN	07/22/2021	60,000	19.92662	(1,195,597)
2021060703166	BO	USDMXN	07/22/2021	1,000,000	19.92653	(19,926,527)
2021060703346	BO	USDMXN	07/22/2021	30,000	19.89536	(596,861)
2021061503643	SO	USDMXN	07/22/2021	(50,000)	20.13921	1,006,960
2021062403343	BO	USDMXN	07/22/2021	300,000	20.05037	(6,015,112)
2021062503294	BO	USDMXN	07/22/2021	400,000	19.83247	(7,932,988)
2021063003275	BO	USDMXN	07/22/2021	139	19.98875	(2,787)
2021070503250	B	USDMXN	07/22/2021	50,000	19.88594	(994,297)
2021070803487	SO	USDMXN	07/22/2021	(163,000)	20.01253	3,262,042
2021072003143	B	USDMXN	07/22/2021	30,000,000	20.1439	(604,317,000)
2021072003404	B	USDMXN	07/22/2021	16,000,000	20.128	(322,048,000)
2021072003136	S	USDMXN	07/22/2021	(494,225)	20.1527	9,959,968
2021072003149	S	USDMXN	07/22/2021	(30,000,000)	20.14	604,200,000
2021072003391	S	USDMXN	07/22/2021	(494,225)	20.13	9,948,749
2021072003480	S	USDMXN	07/22/2021	(10,560,368)	20.1144	212,415,466

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021020303436	B	USDMXN	07/23/2021	837,400	20.4163	(17,096,606)
2021020303285	SO	USDMXN	07/23/2021	(837,400)	20.4192	17,099,038
2021010603406	BO	USDMXN	07/23/2021	50,000	20.05713	(1,002,857)
2021010603399	SO	USDMXN	07/23/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021011203441	BO	USDMXN	07/23/2021	25,000	20.25788	(506,447)
2021011203400	SO	USDMXN	07/23/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011803218	BO	USDMXN	07/23/2021	25,000	20.1468	(503,670)
2021011803119	SO	USDMXN	07/23/2021	(25,000)	20.1592	503,980
2021021103289	BO	USDMXN	07/23/2021	233,000	20.31823	(4,734,148)
2021040603502	BO	USDMXN	07/23/2021	666,668	20.39125	(13,594,192)
2021040803284	BO	USDMXN	07/23/2021	250,000	20.39404	(5,098,510)
2021042003254	BO	USDMXN	07/23/2021	210,000	20.12061	(4,225,329)
2021042003682	BO	USDMXN	07/23/2021	50,000	20.17219	(1,008,609)
2021042303313	BO	USDMXN	07/23/2021	100,000	20.03739	(2,003,740)
2021051203481	BO	USDMXN	07/23/2021	50,000	20.28706	(1,014,353)
2021061803393	SO	USDMXN	07/23/2021	(7,000)	20.77336	145,414
2021061803695	SO	USDMXN	07/23/2021	(224)	20.66963	4,639
2021062503153	BO	USDMXN	07/23/2021	250,000	19.79222	(4,948,055)
2021062503166	SO	USDMXN	07/23/2021	(227,000)	19.84905	4,505,735
2021062503345	SO	USDMXN	07/23/2021	(944)	19.83206	18,726
2021070803488	SO	USDMXN	07/23/2021	(124,000)	20.01498	2,481,858
2021072103253	B	USDMXN	07/23/2021	400,000	20.1651	(8,066,040)
2021072103171	S	USDMXN	07/23/2021	(494,225)	20.1563	9,961,747
2021072103399	S	USDMXN	07/23/2021	(494,225)	20.1862	9,976,525
2020060403107	B	USDMXN	07/26/2021	3,690,000	22.8868	(84,452,292)
2020060403102	SO	USDMXN	07/26/2021	(3,690,000)	22.925	84,593,250
2021051703502	BO	USDMXN	07/26/2021	100,000	19.93228	(1,993,228)
2021061103177	BO	USDMXN	07/26/2021	115,000	20.01875	(2,302,157)
2021061103428	BO	USDMXN	07/26/2021	39	20.03079	(780)
2021062803194	BO	USDMXN	07/26/2021	40,000	19.84849	(793,939)
2021063003276	SO	USDMXN	07/26/2021	(565)	19.99439	11,289
2021070803489	SO	USDMXN	07/26/2021	(290,000)	20.02233	5,806,476
2021071403130	B	USDMXN	07/26/2021	2,500,000	19.927	(49,817,500)
2021071403133	S	USDMXN	07/26/2021	(2,500,000)	19.92786	49,819,648
2021072203358	B	USDMXN	07/26/2021	350,000	20.1211	(7,042,385)
2021072203486	B	USDMXN	07/26/2021	500,000	20.1074	(10,053,700)
2021072203165	S	USDMXN	07/26/2021	(494,225)	20.197	9,981,862
2021072203308	S	USDMXN	07/26/2021	(494,225)	20.1314	9,949,441
2021072603022	S	USDMXN	07/26/2021	(11,000,000)	20.08	220,880,000
2021061103180	BO	USDMXN	07/27/2021	115,000	20.01295	(2,301,489)
2021061103429	BO	USDMXN	07/27/2021	20	20.03282	(391)
2021063003280	SO	USDMXN	07/27/2021	(557)	19.99686	11,139
2021071903227	B	USDMXN	07/27/2021	3,000,000	20.01277	(60,038,319)
2021072003485	SO	USDMXN	07/27/2021	(126,000)	20.13091	2,536,495
2021072303452	B	USDMXN	07/27/2021	289,274	20.0687	(5,805,362)
2021072303454	B	USDMXN	07/27/2021	418,438	20.069	(8,397,636)
2021072303380	S	USDMXN	07/27/2021	(494,225)	20.0617	9,914,994
2021072303458	S	USDMXN	07/27/2021	(3,000,000)	20.0704	60,211,200
2021072603023	B	USDMXN	07/27/2021	11,000,000	20.0825	(220,907,500)
2021072603384	SO	USDMXN	07/27/2021	(15,000,000)	20.00659	300,098,865
2021072603414	SO	USDMXN	07/27/2021	(7,200,000)	20.0259	144,186,487
2021072703120	B	USDMXN	07/27/2021	156,000	19.95088	(3,112,337)
2021072703166	S	USDMXN	07/27/2021	(15,000,000)	19.98	299,700,000
2020100503496	BO	USDMXN	07/28/2021	600,000	22.07155	(13,242,929)
2020100503232	SO	USDMXN	07/28/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503351	BO	USDMXN	07/28/2021	45,000	21.4473	(965,128)
2020110503566	BO	USDMXN	07/28/2021	900,000	21.40859	(19,267,729)
2020110503437	SO	USDMXN	07/28/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020110503733	SO	USDMXN	07/28/2021	(45,000)	21.5532	969,894
2021022203067	SO	USDMXN	07/28/2021	(50,000)	21.12593	1,056,296

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021031203216	SO	USDMXN	07/28/2021	(500,000)	21.13351	10,566,753
2021031803625	BO	USDMXN	07/28/2021	500,000	20.71755	(10,358,777)
2021032403094	SO	USDMXN	07/28/2021	(500,000)	21.12025	10,560,125
2021033103385	BO	USDMXN	07/28/2021	500,000	20.78847	(10,394,236)
2021042003651	BO	USDMXN	07/28/2021	50,000	20.18712	(1,009,356)
2021042103696	BO	USDMXN	07/28/2021	315,000	20.11389	(6,335,875)
2021042103755	BO	USDMXN	07/28/2021	17,000	20.114	(341,938)
2021062403284	BO	USDMXN	07/28/2021	20,900	20.0542	(419,133)
2021062403424	BO	USDMXN	07/28/2021	300,000	19.8881	(5,966,430)
2021062503239	BO	USDMXN	07/28/2021	350,000	19.86473	(6,952,654)
2021070103322	BO	USDMXN	07/28/2021	5	20.0675	(100)
2021072003486	SO	USDMXN	07/28/2021	(106,000)	20.13359	2,134,161
2021072603326	S	USDMXN	07/28/2021	(494,225)	20.0064	9,887,663
2021072703167	B	USDMXN	07/28/2021	15,000,000	19.9827	(299,740,500)
2021072803508	S	USDMXN	07/28/2021	(2,500,000)	19.905	49,762,500
2020091003214	BO	USDMXN	07/29/2021	34,000	22.09015	(751,065)
2020091003333	SO	USDMXN	07/29/2021	(34,000)	22.1614	753,487
2021040603275	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.48997	(614,699)
2021040803224	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.34433	(610,330)
2021040803639	BO	USDMXN	07/29/2021	310,500	20.3487	(6,318,272)
2021041503292	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.2283	(606,849)
2021041603292	B	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.11923	(603,577)
2021041903638	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.05509	(601,653)
2021042003510	B	USDMXN	07/29/2021	1,117,284	20.16312	(22,527,926)
2021042003503	S	USDMXN	07/29/2021	(558,642)	20.16544	11,265,263
2021051003515	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.0603	(601,809)
2021051103169	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	20.02535	(600,760)
2021051703504	BO	USDMXN	07/29/2021	100,000	19.93924	(1,993,924)
2021051803324	BO	USDMXN	07/29/2021	400,000	19.91675	(7,966,699)
2021051803350	BO	USDMXN	07/29/2021	60,000	19.94297	(1,196,578)
2021060203416	BO	USDMXN	07/29/2021	250,000	20.02713	(5,006,783)
2021060703344	BO	USDMXN	07/29/2021	30,000	19.9108	(597,324)
2021060803485	BO	USDMXN	07/29/2021	1,000,000	19.85867	(19,858,665)
2021061503644	SO	USDMXN	07/29/2021	(50,000)	20.1552	1,007,761
2021062503296	BO	USDMXN	07/29/2021	400,000	19.85044	(7,940,176)
2021070703381	B	USDMXN	07/29/2021	50,000	20.00122	(1,000,061)
2021072003481	B	USDMXN	07/29/2021	10,560,368	20.13608	(212,644,430)
2021072003487	SO	USDMXN	07/29/2021	(163,000)	20.13627	3,282,212
2021072703477	B	USDMXN	07/29/2021	11,000,000	19.9776	(219,753,600)
2021072703125	S	USDMXN	07/29/2021	(494,225)	19.9502	9,859,888
2021072703263	S	USDMXN	07/29/2021	(494,225)	19.9872	9,878,174
2021072703525	S	USDMXN	07/29/2021	(50,000)	19.97617	998,809
2021072803509	B	USDMXN	07/29/2021	2,500,000	19.9072	(49,768,000)
2021072903456	S	USDMXN	07/29/2021	(15,000,000)	19.848	297,720,000
2021072903748	S	USDMXN	07/29/2021	(2,500,000)	19.86	49,650,000
2020072803319	B	USDMXN	07/30/2021	6,937,500	22.88	(158,730,000)
2020072803317	SO	USDMXN	07/30/2021	(6,937,500)	22.898	158,854,875
2020082003135	SO	USDMXN	07/30/2021	(1,855)	23.03712	42,732
2020082703574	BO	USDMXN	07/30/2021	424,328	22.84323	(9,693,020)
2020082703583	SO	USDMXN	07/30/2021	(424,328)	22.8711	9,704,847
2020121703685	BO	USDMXN	07/30/2021	106,000	20.31368	(2,153,250)
2020121703641	SO	USDMXN	07/30/2021	(106,000)	20.3208	2,154,005
2021010603407	BO	USDMXN	07/30/2021	50,000	20.07263	(1,003,632)
2021010603400	SO	USDMXN	07/30/2021	(50,000)	20.055	1,002,750
2021011203443	BO	USDMXN	07/30/2021	25,000	20.2737	(506,842)
2021011203402	SO	USDMXN	07/30/2021	(25,000)	20.273	506,825
2021011503493	BO	USDMXN	07/30/2021	119,000	20.20197	(2,404,034)
2021011503467	SO	USDMXN	07/30/2021	(119,000)	20.2108	2,405,085
2021011803219	BO	USDMXN	07/30/2021	25,000	20.16245	(504,061)
2021011803121	SO	USDMXN	07/30/2021	(25,000)	20.1592	503,980

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012703665	BO	USDMXN	07/30/2021	5,000	20.68567	(103,428)
2021012703799	SO	USDMXN	07/30/2021	(5,000)	20.71479	103,574
2021040803283	BO	USDMXN	07/30/2021	250,000	20.41055	(5,102,638)
2021040903306	BO	USDMXN	07/30/2021	311,000	20.40211	(6,345,056)
2021042003476	BO	USDMXN	07/30/2021	390,000	20.1332	(7,851,949)
2021042003612	SO	USDMXN	07/30/2021	(1,000)	20.18609	20,187
2021042203665	BO	USDMXN	07/30/2021	715,000	20.16669	(14,419,183)
2021042203672	BO	USDMXN	07/30/2021	828	20.17099	(16,698)
2021042303418	BO	USDMXN	07/30/2021	75,000	20.06639	(1,504,979)
2021043003632	BO	USDMXN	07/30/2021	34,800	20.45316	(711,770)
2021050503347	BO	USDMXN	07/30/2021	93,750	20.465	(1,918,593)
2021050603394	BO	USDMXN	07/30/2021	184,400	20.30595	(3,744,417)
2021050703338	BO	USDMXN	07/30/2021	93,750	20.14063	(1,888,184)
2021051003227	BO	USDMXN	07/30/2021	250,000	20.0625	(5,015,626)
2021051103488	BO	USDMXN	07/30/2021	6	20.16451	(117)
2021051203482	BO	USDMXN	07/30/2021	50,000	20.30336	(1,015,168)
2021052103237	SO	USDMXN	07/30/2021	(5,000,000)	20.12522	100,626,085
2021052403457	BO	USDMXN	07/30/2021	249,200	20.04003	(4,993,975)
2021052703173	BO	USDMXN	07/30/2021	175,000	20.02651	(3,504,639)
2021052703499	BO	USDMXN	07/30/2021	600,000	20.1001	(12,060,061)
2021052703392	SO	USDMXN	07/30/2021	(600,000)	20.12402	12,074,411
2021060203300	B	USDMXN	07/30/2021	299,400	20.04645	(6,001,907)
2021060403566	SO	USDMXN	07/30/2021	(2,688,350)	20.05641	53,918,663
2021060803468	BO	USDMXN	07/30/2021	175,000	19.8597	(3,475,447)
2021061003282	SO	USDMXN	07/30/2021	(3)	19.76841	58
2021061603240	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.17917	(9,507,414)
2021061603358	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.14299	(9,490,368)
2021061603394	SO	USDMXN	07/30/2021	(36,000)	20.32939	731,858
2021061603543	SO	USDMXN	07/30/2021	(125,000)	20.33226	2,541,533
2021061703501	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.56865	(9,690,922)
2021061703114	SO	USDMXN	07/30/2021	(125,000)	20.63723	2,579,654
2021061803680	BO	USDMXN	07/30/2021	471,152	20.77038	(9,786,007)
2021062103268	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.71217	(9,758,541)
2021062203142	B	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.66542	(9,736,514)
2021062303200	BO	USDMXN	07/30/2021	442,300	20.35072	(9,001,123)
2021062403345	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.11824	(9,478,710)
2021062503325	B	USDMXN	07/30/2021	442,300	19.85793	(8,783,164)
2021063003271	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	19.90199	(9,376,822)
2021063003544	BO	USDMXN	07/30/2021	471,150	20.01689	(9,430,956)
2021070103323	BO	USDMXN	07/30/2021	2	20.06866	(44)
2021070103326	SO	USDMXN	07/30/2021	(4)	20.05954	87
2021070803491	B	USDMXN	07/30/2021	184,332	20.04062	(3,694,136)
2021071503113	S	USDMXN	07/30/2021	(191,208)	19.95326	3,815,229
2021072003488	SO	USDMXN	07/30/2021	(103,000)	20.13891	2,074,308
2021072203162	SO	USDMXN	07/30/2021	(350,000)	20.20798	7,072,793
2021072803455	S	USDMXN	07/30/2021	(494,225)	19.9204	9,845,160
2021072903457	B	USDMXN	07/30/2021	15,000,000	19.85065	(297,759,750)
2021072903749	B	USDMXN	07/30/2021	2,500,000	19.8622	(49,655,500)
2021072903458	S	USDMXN	07/30/2021	(15,000,000)	19.84	297,600,000
2021073003020	S	USDMXN	07/30/2021	(2,500,000)	19.81	49,525,000
2020111903517	BO	USDMXN	08/02/2021	200,000	20.74209	(4,148,419)
2020111903518	SO	USDMXN	08/02/2021	(200,000)	20.742	4,148,400
2021052103308	BO	USDMXN	08/02/2021	250,000	20.08926	(5,022,315)
2021061803376	SO	USDMXN	08/02/2021	(212,500)	20.81616	4,423,433
2021062803195	BO	USDMXN	08/02/2021	40,000	19.86657	(794,663)
2021063003281	SO	USDMXN	08/02/2021	(488)	20.01144	9,775
2021070203350	BO	USDMXN	08/02/2021	520,000	19.90639	(10,351,323)
2021070203371	BO	USDMXN	08/02/2021	240	19.86198	(4,766)
2021070603277	BO	USDMXN	08/02/2021	494,000	20.0464	(9,902,921)
2021070603472	BO	USDMXN	08/02/2021	490,000	20.06318	(9,830,957)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021070603474	BO	USDMXN	08/02/2021	4,450	20.06698	(89,297)
2021070703164	BO	USDMXN	08/02/2021	500,000	20.09813	(10,049,063)
2021070703261	BO	USDMXN	08/02/2021	488,450	20.03607	(9,786,620)
2021070903533	BO	USDMXN	08/02/2021	494,225	19.93944	(9,854,572)
2021071203248	B	USDMXN	08/02/2021	495,000	19.87737	(9,839,300)
2021071203331	B	USDMXN	08/02/2021	495,000	19.89255	(9,846,814)
2021071203466	S	USDMXN	08/02/2021	(1,550)	19.92529	30,884
2021071303241	B	USDMXN	08/02/2021	494,225	20.04163	(9,905,076)
2021071403345	BO	USDMXN	08/02/2021	33,000	19.95862	(658,635)
2021071403349	B	USDMXN	08/02/2021	494,225	19.91223	(9,841,119)
2021071503393	B	USDMXN	08/02/2021	494,225	20.02146	(9,895,107)
2021071603159	SO	USDMXN	08/02/2021	(56,000)	19.86102	1,112,217
2021071603339	SO	USDMXN	08/02/2021	(292)	19.87601	5,795
2021071903394	SO	USDMXN	08/02/2021	(56,000)	20.06917	1,123,873
2021071903434	SO	USDMXN	08/02/2021	(242)	20.07837	4,858
2021072003489	SO	USDMXN	08/02/2021	(458,000)	20.14684	9,227,252
2021072903459	B	USDMXN	08/02/2021	15,000,000	19.84795	(297,719,250)
2021072903130	S	USDMXN	08/02/2021	(250,000)	19.8487	4,962,175
2021072903132	S	USDMXN	08/02/2021	(250,000)	19.841	4,960,250
2021072903172	S	USDMXN	08/02/2021	(200,000)	19.8657	3,973,140
2021072903185	S	USDMXN	08/02/2021	(250,000)	19.8538	4,963,450
2021072903193	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8599	5,957,970
2021072903198	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8533	5,955,990
2021072903203	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8464	5,953,920
2021072903207	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8516	5,955,480
2021072903255	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8513	5,955,390
2021072903257	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.84421	5,953,263
2021072903262	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.84649	5,953,947
2021072903268	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8512	5,955,360
2021072903270	S	USDMXN	08/02/2021	(494,225)	19.8551	9,812,887
2021072903386	S	USDMXN	08/02/2021	(1,430,224)	19.8568	28,399,672
2021072903425	S	USDMXN	08/02/2021	(2,358,136)	19.8498	46,808,519
2021072903498	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8507	5,955,210
2021072903500	S	USDMXN	08/02/2021	(300,000)	19.8508	5,955,240
2021072903535	S	USDMXN	08/02/2021	(349,923)	19.8574	6,948,571
2021080203104	S	USDMXN	08/02/2021	(20,000,000)	19.83	396,600,000
2021031203180	BO	USDMXN	08/03/2021	6,000,000	21.09503	(126,570,150)
2021031203241	BO	USDMXN	08/03/2021	500,000	21.0273	(10,513,650)
2021031603563	B	USDMXN	08/03/2021	156,000	20.93296	(3,265,541)
2021040603757	BO	USDMXN	08/03/2021	2,000,000	20.46782	(40,935,636)
2021051003534	BO	USDMXN	08/03/2021	46,042	20.08795	(924,889)
2021060403379	BO	USDMXN	08/03/2021	167,241	20.06338	(3,355,421)
2021060403454	S	USDMXN	08/03/2021	(68,134)	20.08511	1,368,484
2021060403455	S	USDMXN	08/03/2021	(28,983)	20.08548	582,145
2021061503254	BO	USDMXN	08/03/2021	50,000	20.22198	(1,011,099)
2021063003535	BO	USDMXN	08/03/2021	2,000,000	20.01252	(40,025,046)
2021063003538	BO	USDMXN	08/03/2021	100,000	20.00979	(2,000,979)
2021063003283	SO	USDMXN	08/03/2021	(176)	20.01273	3,532
2021063003577	SO	USDMXN	08/03/2021	(2,100,000)	20.01158	42,024,312
2021071503020	SO	USDMXN	08/03/2021	(240,000)	19.97496	4,793,991
2021071503115	SO	USDMXN	08/03/2021	(370)	19.95868	7,384
2021072003490	SO	USDMXN	08/03/2021	(136,000)	20.14948	2,740,330
2021072703121	S	USDMXN	08/03/2021	(156,000)	19.9677	3,114,961
2021073003169	S	USDMXN	08/03/2021	(500,000)	19.8504	9,925,200
2021073003177	S	USDMXN	08/03/2021	(300,000)	19.8433	5,952,990
2021073003179	S	USDMXN	08/03/2021	(494,225)	19.844	9,807,401
2021073003223	S	USDMXN	08/03/2021	(1,400,000)	19.8466	27,785,240
2021073003227	S	USDMXN	08/03/2021	(1,600,000)	19.8468	31,754,880
2021073003293	S	USDMXN	08/03/2021	(494,225)	19.8503	9,810,515
2021073003572	S	USDMXN	08/03/2021	(1,973,852)	19.9196	39,318,344

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021080203105	B	USDMXN	08/03/2021	20,000,000	19.8323	(396,646,000)
2021080303022	S	USDMXN	08/03/2021	(25,000,000)	19.83	495,750,000
2020082803156	S	MXNUSD	08/04/2021	(57,338,830)	22.75282	2,520,076
2020082803161	S	MXNUSD	08/04/2021	(103,328,790)	22.7548	4,540,967
2020082803167	S	MXNUSD	08/04/2021	(15,178,439)	22.75365	667,077
2020082803452	SO	USDMXN	08/04/2021	(28,541)	22.74033	649,039
2020083103054	BO	USDMXN	08/04/2021	10,000	22.7688	(227,688)
2020090803345	SO	USDMXN	08/04/2021	(10,000)	22.54852	225,485
2020092903449	B	USDMXN	08/04/2021	83,452	23.21712	(1,937,521)
2020092903363	SO	USDMXN	08/04/2021	(7,783,031)	22.59352	175,846,060
2020100503497	BO	USDMXN	08/04/2021	600,000	22.08991	(13,253,944)
2020100503233	SO	USDMXN	08/04/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020102903049	BO	USDMXN	08/04/2021	500,000	22.0449	(11,022,448)
2020102903051	SO	USDMXN	08/04/2021	(500,000)	22.085	11,042,500
2020110503567	BO	USDMXN	08/04/2021	900,000	21.42683	(19,284,143)
2020110503439	SO	USDMXN	08/04/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020112303046	BO	USDMXN	08/04/2021	250,000	20.63408	(5,158,521)
2020112303036	SO	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	20.637	5,159,250
2020112703400	BO	USDMXN	08/04/2021	250,000	20.65447	(5,163,617)
2020112703424	SO	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	20.658	5,164,500
2020121503474	BO	USDMXN	08/04/2021	250,000	20.45876	(5,114,689)
2020121503444	SO	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	20.458	5,114,500
2020121603227	BO	USDMXN	08/04/2021	250,000	20.46112	(5,115,281)
2020121603082	SO	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	20.461	5,115,250
2020121703145	BO	USDMXN	08/04/2021	250,000	20.32016	(5,080,041)
2020121703086	SO	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	20.317	5,079,250
2020122403090	BO	USDMXN	08/04/2021	300,000	20.39799	(6,119,397)
2020122403084	SO	USDMXN	08/04/2021	(300,000)	20.414	6,124,200
2021010703263	S	USDMXN	08/04/2021	(46,609)	20.4249	951,978
2021011403556	SO	USDMXN	08/04/2021	(47,130)	20.15612	949,958
2021022503450	SO	USDMXN	08/04/2021	(44,875)	21.18236	950,554
2021030403194	SO	USDMXN	08/04/2021	(45,002)	21.11248	950,112
2021031203008	SO	USDMXN	08/04/2021	(45,260)	20.98571	949,806
2021031803551	SO	USDMXN	08/04/2021	(45,854)	20.70603	949,451
2021042103697	BO	USDMXN	08/04/2021	315,000	20.13059	(6,341,135)
2021042103756	BO	USDMXN	08/04/2021	17,000	20.13071	(342,222)
2021052503504	SO	USDMXN	08/04/2021	(95,597)	20.04059	1,915,812
2021052503520	SO	USDMXN	08/04/2021	(4,239)	20.04125	84,948
2021062903338	BO	USDMXN	08/04/2021	25,750	19.9082	(512,636)
2021062903434	BO	USDMXN	08/04/2021	23,350	19.90512	(464,785)
2021070103238	BO	USDMXN	08/04/2021	43,550	20.06875	(873,994)
2021070803406	SO	USDMXN	08/04/2021	(350,000)	20.06672	7,023,353
2021070803496	SO	USDMXN	08/04/2021	(3,345)	20.04428	67,048
2021072003491	SO	USDMXN	08/04/2021	(106,000)	20.15212	2,136,125
2021073003021	B	USDMXN	08/04/2021	2,500,000	19.8222	(49,555,500)
2021080203039	S	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	19.8212	4,955,300
2021080203041	S	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	19.8218	4,955,450
2021080203043	S	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	19.8217	4,955,425
2021080203045	S	USDMXN	08/04/2021	(250,000)	19.8175	4,954,375
2021080203240	S	USDMXN	08/04/2021	(516,000)	19.8678	10,251,785
2021080203412	S	USDMXN	08/04/2021	(516,000)	19.9102	10,273,663
2021080303023	B	USDMXN	08/04/2021	25,000,000	19.83233	(495,808,125)
2021080403421	S	USDMXN	08/04/2021	(2,500,000)	19.97	49,925,000
2020082503344	BO	USDMXN	08/05/2021	34,000	22.79965	(775,189)
2020082503364	SO	USDMXN	08/05/2021	(34,000)	22.8661	777,447
2021040603277	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.50657	(615,197)
2021040803223	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.36071	(610,821)
2021041503291	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.24503	(607,351)
2021041603301	B	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.13786	(604,136)
2021041903639	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.07136	(602,141)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021051003516	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.07639	(602,292)
2021051103170	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	20.04143	(601,243)
2021051803351	BO	USDMXN	08/05/2021	60,000	19.95932	(1,197,559)
2021060203418	BO	USDMXN	08/05/2021	250,000	20.0429	(5,010,724)
2021060703347	BO	USDMXN	08/05/2021	30,000	19.92625	(597,787)
2021060803480	BO	USDMXN	08/05/2021	1,000,000	19.85376	(19,853,756)
2021061703718	SO	USDMXN	08/05/2021	(50,000)	20.55683	1,027,842
2021062403527	BO	USDMXN	08/05/2021	400,000	19.96918	(7,987,671)
2021062503312	B	USDMXN	08/05/2021	500,000	19.87308	(9,936,540)
2021070203476	BO	USDMXN	08/05/2021	600,000	19.84346	(11,906,076)
2021070703479	B	USDMXN	08/05/2021	50,000	20.02883	(1,001,441)
2021071203334	B	USDMXN	08/05/2021	500,000	19.8991	(9,949,548)
2021072003150	B	USDMXN	08/05/2021	30,000,000	20.1778	(605,334,000)
2021072003144	S	USDMXN	08/05/2021	(30,000,000)	20.18313	605,493,810
2021072003492	SO	USDMXN	08/05/2021	(163,000)	20.15477	3,285,227
2021080303365	B	USDMXN	08/05/2021	9,248,728	19.9026	(184,073,734)
2021080303284	S	USDMXN	08/05/2021	(516,000)	19.8922	10,264,375
2021080303374	S	USDMXN	08/05/2021	(14,000,000)	19.8952	278,532,800
2021080303414	S	USDMXN	08/05/2021	(516,000)	19.8964	10,266,542
2021080503138	S	USDMXN	08/05/2021	(20,000,000)	19.933	398,660,000
2020092903056	B	USDMXN	08/06/2021	1,850,665	23.06277	(42,681,464)
2020112403121	BO	USDMXN	08/06/2021	134,150	20.63413	(2,768,068)
2020112403024	SO	USDMXN	08/06/2021	(134,150)	20.6345	2,768,118
2021030903271	BO	USDMXN	08/06/2021	25,000	21.5769	(539,423)
2021040603384	BO	USDMXN	08/06/2021	1,760,000	20.43224	(35,960,746)
2021041503752	BO	USDMXN	08/06/2021	250,000	20.17216	(5,043,039)
2021042103338	BO	USDMXN	08/06/2021	50,000	20.13499	(1,006,749)
2021042303419	BO	USDMXN	08/06/2021	75,000	20.08305	(1,506,229)
2021042603459	BO	USDMXN	08/06/2021	130,000	20.09082	(2,611,808)
2021051203483	BO	USDMXN	08/06/2021	50,000	20.31966	(1,015,983)
2021051703507	BO	USDMXN	08/06/2021	100,000	19.95782	(1,995,782)
2021052403405	BO	USDMXN	08/06/2021	800,000	20.06343	(16,050,740)
2021052703169	BO	USDMXN	08/06/2021	350,000	19.98758	(6,995,652)
2021060203096	BO	USDMXN	08/06/2021	350,000	20.05643	(7,019,749)
2021063003343	SO	USDMXN	08/06/2021	(112,000)	20.02092	2,242,344
2021070103321	SO	USDMXN	08/06/2021	(1,004)	20.08562	20,165
2021070203349	BO	USDMXN	08/06/2021	250,000	19.92689	(4,981,722)
2021070203370	BO	USDMXN	08/06/2021	400,000	20.0466	(8,018,642)
2021071403066	SO	USDMXN	08/06/2021	(264,000)	19.96641	5,271,131
2021071403350	SO	USDMXN	08/06/2021	(901)	19.9216	17,943
2021072103254	S	USDMXN	08/06/2021	(400,000)	20.20706	8,082,823
2021080403422	B	USDMXN	08/06/2021	2,500,000	19.9744	(49,936,000)
2021080403041	S	USDMXN	08/06/2021	(250,000)	19.8335	4,958,375
2021080403043	S	USDMXN	08/06/2021	(250,000)	19.8319	4,957,975
2021080403426	S	USDMXN	08/06/2021	(3,000,000)	19.97	59,910,000
2021080403456	S	USDMXN	08/06/2021	(516,000)	19.9701	10,304,572
2021080503139	B	USDMXN	08/06/2021	20,000,000	19.93538	(398,707,500)
2021080603013	S	USDMXN	08/06/2021	(20,000,000)	19.967	399,340,000
2021010403420	B	USDMXN	08/09/2021	300,000	20.47551	(6,142,654)
2021010403048	SO	USDMXN	08/09/2021	(300,000)	20.258	6,077,400
2021011303114	BO	USDMXN	08/09/2021	250,000	20.26354	(5,065,885)
2021011303037	SO	USDMXN	08/09/2021	(250,000)	20.277	5,069,250
2021011403540	B	USDMXN	08/09/2021	250,000	20.1872	(5,046,801)
2021011403435	SO	USDMXN	08/09/2021	(250,000)	20.166	5,041,500
2021041603316	B	USDMXN	08/09/2021	30,000	20.14681	(604,404)
2021041603318	S	USDMXN	08/09/2021	(30,000)	20.14502	604,351
2021052103309	BO	USDMXN	08/09/2021	200,000	20.10537	(4,021,073)
2021062803196	BO	USDMXN	08/09/2021	40,000	19.88477	(795,391)
2021070203453	BO	USDMXN	08/09/2021	250,000	19.84756	(4,961,891)
2021071403346	BO	USDMXN	08/09/2021	90,000	19.97613	(1,797,852)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021071603284	SO	USDMXN	08/09/2021	(224,000)	19.89161	4,455,720
2021071603340	SO	USDMXN	08/09/2021	(937)	19.89141	18,630
2021072003058	SO	USDMXN	08/09/2021	(151,000)	20.18736	3,048,292
2021072003494	SO	USDMXN	08/09/2021	(285)	20.17435	5,756
2021080403427	B	USDMXN	08/09/2021	3,000,000	19.9766	(59,929,800)
2021080503378	B	USDMXN	08/09/2021	4,643,116	19.927	(92,523,373)
2021080503112	S	USDMXN	08/09/2021	(516,000)	19.92477	10,281,181
2021080503394	S	USDMXN	08/09/2021	(185,000)	19.9265	3,686,403
2021080503403	S	USDMXN	08/09/2021	(111,000)	19.9251	2,211,686
2021080603014	B	USDMXN	08/09/2021	20,000,000	19.974	(399,480,000)
2021080903036	S	USDMXN	08/09/2021	(20,000,000)	20.05	401,000,000
2021042103339	BO	USDMXN	08/10/2021	50,000	20.14454	(1,007,227)
2021060403456	B	USDMXN	08/10/2021	28,983	20.10317	(582,657)
2021062103305	BO	USDMXN	08/10/2021	8,473	20.63305	(174,826)
2021062903650	BO	USDMXN	08/10/2021	73,529	19.91867	(1,464,601)
2021070603049	BO	USDMXN	08/10/2021	240,000	19.93867	(4,785,280)
2021070603476	BO	USDMXN	08/10/2021	2,020	20.08684	(40,582)
2021072103028	SO	USDMXN	08/10/2021	(135,000)	20.2608	2,735,209
2021072103427	SO	USDMXN	08/10/2021	(447)	20.24921	9,047
2021072603349	SO	USDMXN	08/10/2021	(60,000)	20.03974	1,202,384
2021072603385	SO	USDMXN	08/10/2021	(151)	20.04409	3,025
2021080603240	B	USDMXN	08/10/2021	125,000	20.02203	(2,502,754)
2021080603436	S	USDMXN	08/10/2021	(283,620)	20.07237	5,692,926
2021080603438	S	USDMXN	08/10/2021	(491,225)	20.07389	9,860,797
2021080903037	B	USDMXN	08/10/2021	20,000,000	20.05245	(401,049,000)
2021080903080	S	USDMXN	08/10/2021	(2,500,000)	20.07312	50,182,811
2021081003012	S	USDMXN	08/10/2021	(3,500,000)	20.15	70,525,000
2021081003027	S	USDMXN	08/10/2021	(4,800,000)	20.1354	96,649,920
2021081003102	S	USDMXN	08/10/2021	(10,000,000)	20.151	201,510,000
2020100503498	BO	USDMXN	08/11/2021	600,000	22.10824	(13,264,946)
2020100503234	SO	USDMXN	08/11/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503568	BO	USDMXN	08/11/2021	900,000	21.44463	(19,300,168)
2020110503442	SO	USDMXN	08/11/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021012003110	BO	USDMXN	08/11/2021	250,000	20.07831	(5,019,577)
2021012003257	BO	USDMXN	08/11/2021	1,000,000	20.02322	(20,023,217)
2021012003019	SO	USDMXN	08/11/2021	(250,000)	20.071	5,017,750
2021012003241	SO	USDMXN	08/11/2021	(1,000,000)	20.027	20,027,000
2021012103163	BO	USDMXN	08/11/2021	250,000	20.12189	(5,030,472)
2021012103043	SO	USDMXN	08/11/2021	(250,000)	20.1315	5,032,875
2021021503154	BO	USDMXN	08/11/2021	150,000	20.27558	(3,041,337)
2021031703306	BO	USDMXN	08/11/2021	140,000	20.81262	(2,913,767)
2021031703448	BO	USDMXN	08/11/2021	111	20.70645	(2,299)
2021031803113	BO	USDMXN	08/11/2021	150,000	20.78244	(3,117,365)
2021042103698	BO	USDMXN	08/11/2021	315,000	20.14728	(6,346,394)
2021042103757	BO	USDMXN	08/11/2021	17,000	20.14742	(342,506)
2021050703229	BO	USDMXN	08/11/2021	400,000	20.25811	(8,103,243)
2021061803330	S	USDMXN	08/11/2021	(400,000)	20.81485	8,325,940
2021070603426	BO	USDMXN	08/11/2021	33,500	20.07297	(672,444)
2021070703292	BO	USDMXN	08/11/2021	20,150	20.06794	(404,369)
2021070703480	BO	USDMXN	08/11/2021	750	20.04223	(15,031)
2021070703508	BO	USDMXN	08/11/2021	19,950	20.03643	(399,727)
2021070903466	BO	USDMXN	08/11/2021	39,700	19.94516	(791,823)
2021070903590	BO	USDMXN	08/11/2021	19,850	19.92706	(395,552)
2021080903117	S	USDMXN	08/11/2021	(516,000)	20.0981	10,370,620
2021081003103	B	USDMXN	08/11/2021	10,000,000	20.1534	(201,534,000)
2020090103552	BO	USDMXN	08/12/2021	34,000	22.58009	(767,724)
2020090103563	SO	USDMXN	08/12/2021	(34,000)	22.691	771,494
2021010703331	B	USDMXN	08/12/2021	59,877	20.42793	(1,223,163)
2021010703265	S	USDMXN	08/12/2021	(59,877)	20.44235	1,224,026
2021010703288	S	USDMXN	08/12/2021	(59,877)	20.4493	1,224,443

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012003482	SO	USDMXN	08/12/2021	(60,544)	20.03349	1,212,906
2021020303233	SO	USDMXN	08/12/2021	(58,791)	20.62614	1,212,626
2021031003484	SO	USDMXN	08/12/2021	(80,273)	21.3261	1,711,910
2021040603278	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.52312	(615,694)
2021040803225	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.37708	(611,312)
2021041503293	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.26176	(607,853)
2021041603303	B	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.1529	(604,587)
2021041903640	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.08764	(602,629)
2021042103340	BO	USDMXN	08/12/2021	100,000	20.14931	(2,014,931)
2021050603416	BO	USDMXN	08/12/2021	1,000,000	20.33298	(20,332,976)
2021050603450	BO	USDMXN	08/12/2021	6,940	20.33536	(141,119)
2021051003518	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.09248	(602,774)
2021051103171	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	20.05752	(601,726)
2021051803352	BO	USDMXN	08/12/2021	60,000	19.97568	(1,198,541)
2021052103310	BO	USDMXN	08/12/2021	200,000	20.11227	(4,022,454)
2021060203417	BO	USDMXN	08/12/2021	250,000	20.05855	(5,014,638)
2021060703357	BO	USDMXN	08/12/2021	30,000	19.94194	(598,258)
2021060803528	BO	USDMXN	08/12/2021	1,000,000	19.85903	(19,859,034)
2021061003375	B	USDMXN	08/12/2021	1,819,696	19.8429	(36,108,046)
2021061003377	S	USDMXN	08/12/2021	(3,639,392)	19.84448	72,221,830
2021061703719	SO	USDMXN	08/12/2021	(50,000)	20.57339	1,028,670
2021062403348	SO	USDMXN	08/12/2021	(753,500)	20.07575	15,127,078
2021062503317	B	USDMXN	08/12/2021	500,000	19.89102	(9,945,511)
2021070103324	BO	USDMXN	08/12/2021	3	20.09613	(54)
2021070103327	SO	USDMXN	08/12/2021	(5)	20.09144	108
2021071203034	BO	USDMXN	08/12/2021	50,000	19.96778	(998,389)
2021072303453	S	USDMXN	08/12/2021	(289,274)	20.11288	5,818,143
2021072903536	B	USDMXN	08/12/2021	349,923	19.88418	(6,957,942)
2021081003013	B	USDMXN	08/12/2021	3,500,000	20.1545	(70,540,750)
2021081003028	B	USDMXN	08/12/2021	4,800,000	20.14	(96,672,000)
2021081003016	S	USDMXN	08/12/2021	(4,000,000)	20.15	80,600,000
2021081003408	S	USDMXN	08/12/2021	(250,000)	20.0931	5,023,275
2021081003421	S	USDMXN	08/12/2021	(250,000)	20.0934	5,023,350
2021081003426	S	USDMXN	08/12/2021	(250,000)	20.0922	5,023,050
2021081003429	S	USDMXN	08/12/2021	(250,000)	20.09062	5,022,655
2021081003454	S	USDMXN	08/12/2021	(144,000)	20.08555	2,892,319
2021012103641	B	USDMXN	08/13/2021	150,000	20.16292	(3,024,439)
2021012103629	SO	USDMXN	08/13/2021	(150,000)	20.182	3,027,300
2021030903272	BO	USDMXN	08/13/2021	25,000	21.59353	(539,838)
2021031603565	B	USDMXN	08/13/2021	146,000	20.95658	(3,059,661)
2021041503753	BO	USDMXN	08/13/2021	250,000	20.18884	(5,047,209)
2021042303420	BO	USDMXN	08/13/2021	125,000	20.09971	(2,512,463)
2021042603458	BO	USDMXN	08/13/2021	65,000	20.10738	(1,306,979)
2021050403436	BO	USDMXN	08/13/2021	108,000	20.46973	(2,210,731)
2021050403457	BO	USDMXN	08/13/2021	764	20.46579	(15,627)
2021051203484	BO	USDMXN	08/13/2021	50,000	20.33595	(1,016,798)
2021051703503	BO	USDMXN	08/13/2021	100,000	19.97408	(1,997,408)
2021061603544	SO	USDMXN	08/13/2021	(175,000)	20.3637	3,563,648
2021061703116	SO	USDMXN	08/13/2021	(175,000)	20.66968	3,617,194
2021070203591	BO	USDMXN	08/13/2021	50,000	19.85657	(992,829)
2021072003405	S	USDMXN	08/13/2021	(16,000,000)	20.19001	323,040,112
2021072003503	SO	USDMXN	08/13/2021	(511,218)	20.19353	10,323,294
2021080303375	B	USDMXN	08/13/2021	14,000,000	19.91498	(278,809,748)
2021080603241	S	USDMXN	08/13/2021	(125,000)	20.02841	2,503,552
2021080603321	SO	USDMXN	08/13/2021	(268,000)	20.03045	5,368,160
2021081003017	B	USDMXN	08/13/2021	4,000,000	20.15225	(80,609,000)
2021081103061	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.9713	4,992,825
2021081103063	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.9705	4,992,625
2021081103065	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.9657	4,991,425
2021081103067	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.9695	4,992,375

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021081103069	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.971	4,992,750
2021081103071	S	USDMXN	08/13/2021	(250,000)	19.9706	4,992,650
2021081303032	S	USDMXN	08/13/2021	(4,000,000)	19.86	79,440,000
2020111903584	BO	USDMXN	08/16/2021	465,000	20.81057	(9,676,913)
2021010603410	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.10243	(6,030,730)
2021020503119	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.58618	(6,175,853)
2021020503004	SO	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	20.84496	6,253,488
2021021103342	B	USDMXN	08/16/2021	4,000,000	20.3729	(81,491,584)
2021021803361	SO	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	20.80692	6,242,076
2021030403454	BO	USDMXN	08/16/2021	200,000	21.40528	(4,281,056)
2021030403536	BO	USDMXN	08/16/2021	2,798	21.43313	(59,970)
2021040803634	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.38483	(6,115,450)
2021041403162	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.35683	(6,107,050)
2021041503045	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.24514	(6,073,542)
2021042103350	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.16292	(6,048,876)
2021050703636	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	20.16032	(6,048,095)
2021051403046	BO	USDMXN	08/16/2021	300,000	19.99896	(5,999,689)
2021052103311	BO	USDMXN	08/16/2021	150,000	20.12147	(3,018,221)
2021052403309	BO	USDMXN	08/16/2021	1,000,000	20.04704	(20,047,043)
2021060403571	B	USDMXN	08/16/2021	1,000,000	20.10325	(20,103,250)
2021062803197	BO	USDMXN	08/16/2021	40,000	19.90213	(796,085)
2021070903195	B	USDMXN	08/16/2021	100,000	19.96986	(1,996,986)
2021071603297	B	USDMXN	08/16/2021	100,000	19.90185	(1,990,185)
2021071603557	B	USDMXN	08/16/2021	500,000	19.95215	(9,976,075)
2021072003194	SO	USDMXN	08/16/2021	(1,000,000)	20.21638	20,216,376
2021080603323	SO	USDMXN	08/16/2021	(375,000)	20.03671	7,513,768
2021081203359	B	USDMXN	08/16/2021	150,000	19.87825	(2,981,738)
2021081203046	S	USDMXN	08/16/2021	(250,000)	19.902	4,975,500
2021081203048	S	USDMXN	08/16/2021	(500,000)	19.9039	9,951,950
2021081203111	S	USDMXN	08/16/2021	(150,000)	19.8962	2,984,430
2021081203115	S	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	19.8952	5,968,560
2021081203121	S	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	19.8874	5,966,220
2021081203124	S	USDMXN	08/16/2021	(300,000)	19.88755	5,966,265
2021081203177	S	USDMXN	08/16/2021	(1,032,000)	19.89621	20,532,889
2021081303033	B	USDMXN	08/16/2021	4,000,000	19.8672	(79,468,800)
2021081303035	S	USDMXN	08/16/2021	(3,500,000)	19.86	69,510,000
2021081603043	SO	USDMXN	08/16/2021	(5,000,000)	19.85736	99,286,780
2021081603091	SO	USDMXN	08/16/2021	(5,000,000)	19.87372	99,368,580
2021031603567	B	USDMXN	08/17/2021	460,000	20.96603	(9,644,375)
2021042103341	BO	USDMXN	08/17/2021	50,000	20.16126	(1,008,063)
2021070703515	BO	USDMXN	08/17/2021	2,000,000	20.03679	(40,073,574)
2021071303305	BO	USDMXN	08/17/2021	89,500	20.07155	(1,796,404)
2021072303459	B	USDMXN	08/17/2021	3,000,000	20.12981	(60,389,430)
2021080603322	SO	USDMXN	08/17/2021	(321,000)	20.0388	6,432,456
2021080903081	B	USDMXN	08/17/2021	2,500,000	20.09023	(50,225,575)
2021081203487	S	USDMXN	08/17/2021	(2,500,000)	19.93695	49,842,371
2021081203494	S	USDMXN	08/17/2021	(2,765,000)	19.94882	55,158,487
2021081203511	S	USDMXN	08/17/2021	(2,000,000)	19.94935	39,898,700
2021081303188	S	USDMXN	08/17/2021	(516,000)	19.8472	10,241,155
2021081303204	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.84166	992,083
2021081303206	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.84071	992,036
2021081303208	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.8407	992,035
2021081303210	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.84046	992,023
2021081303215	S	USDMXN	08/17/2021	(516,000)	19.8391	10,236,976
2021081303282	S	USDMXN	08/17/2021	(200,000)	19.8574	3,971,480
2021081303288	S	USDMXN	08/17/2021	(300,000)	19.8569	5,957,070
2021081303292	S	USDMXN	08/17/2021	(300,000)	19.86	5,958,000
2021081303294	S	USDMXN	08/17/2021	(400,000)	19.8596	7,943,840
2021081303391	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.8608	993,040
2021081303396	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000)	19.8608	993,040

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021081303403	S	USDMXN	08/17/2021	(35,000)	19.8633	695,216
2021081303552	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.899	9,949,500
2021081303555	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.901	9,950,500
2021081303557	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.9012	9,950,600
2021081303559	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.8991	9,949,550
2021081303561	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.9013	9,950,650
2021081303565	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.8995	9,949,750
2021081303567	S	USDMXN	08/17/2021	(500,000)	19.8972	9,948,600
2021081703043	SO	USDMXN	08/17/2021	(5,000,000)	19.97201	99,860,065
2021081703044	SO	USDMXN	08/17/2021	(3,000,000)	19.97601	59,928,039
2021081703063	SO	USDMXN	08/17/2021	(3,000,000)	19.98001	59,940,036
2021081703362	S	USDMXN	08/17/2021	(25,638,463)	20.009	513,000,000
2020100503499	BO	USDMXN	08/18/2021	600,000	22.12653	(13,275,916)
2020100503235	SO	USDMXN	08/18/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503569	BO	USDMXN	08/18/2021	900,000	21.46136	(19,315,227)
2020110503443	SO	USDMXN	08/18/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021010703267	S	USDMXN	08/18/2021	(46,512)	20.45608	951,446
2021011403557	SO	USDMXN	08/18/2021	(47,048)	20.18696	949,763
2021011503212	BO	USDMXN	08/18/2021	1,230,274	20.35008	(25,036,169)
2021011503102	SO	USDMXN	08/18/2021	(1,230,274)	20.251	24,914,279
2021012003324	BO	USDMXN	08/18/2021	956,036	20.05944	(19,177,551)
2021012003629	BO	USDMXN	08/18/2021	345,815	20.02739	(6,925,772)
2021012003228	SO	USDMXN	08/18/2021	(956,036)	19.9662	19,088,406
2021012003572	SO	USDMXN	08/18/2021	(345,815)	19.9372	6,894,583
2021012103211	BO	USDMXN	08/18/2021	756,529	20.15607	(15,248,652)
2021012103160	SO	USDMXN	08/18/2021	(756,529)	20.0648	15,179,603
2021012103506	SO	USDMXN	08/18/2021	(46,986)	20.23398	950,704
2021012603498	BO	USDMXN	08/18/2021	94,082	20.44906	(1,923,888)
2021012703792	BO	USDMXN	08/18/2021	88,444	20.73223	(1,833,641)
2021020403617	B	USDMXN	08/18/2021	2,041,768	20.81781	(42,505,128)
2021021203540	BO	USDMXN	08/18/2021	112,974	20.35245	(2,299,298)
2021021803510	SO	USDMXN	08/18/2021	(45,728)	20.76148	949,382
2021030303435	BO	USDMXN	08/18/2021	20,377	21.27631	(433,547)
2021031203009	SO	USDMXN	08/18/2021	(45,169)	21.01803	949,369
2021031703312	BO	USDMXN	08/18/2021	80,000	20.84954	(1,667,963)
2021031703450	SO	USDMXN	08/18/2021	(1,301)	20.6933	26,915
2021031803385	SO	USDMXN	08/18/2021	(45,781)	20.75433	950,152
2021032403103	BO	USDMXN	08/18/2021	80,887	21.12402	(1,708,659)
2021032503409	SO	USDMXN	08/18/2021	(45,116)	21.05622	949,965
2021042103699	BO	USDMXN	08/18/2021	315,000	20.16398	(6,351,654)
2021042103758	BO	USDMXN	08/18/2021	17,000	20.16412	(342,790)
2021042203376	BO	USDMXN	08/18/2021	963,565	20.15969	(19,425,168)
2021042303379	BO	USDMXN	08/18/2021	201,267	20.09892	(4,045,250)
2021042303580	BO	USDMXN	08/18/2021	142,074	20.09629	(2,855,161)
2021042703603	BO	USDMXN	08/18/2021	287,434	20.31076	(5,838,004)
2021043003601	BO	USDMXN	08/18/2021	258,849	20.47469	(5,299,853)
2021050403083	SO	USDMXN	08/18/2021	(97,637)	20.49407	2,000,983
2021050603555	BO	USDMXN	08/18/2021	64,224	20.31057	(1,304,426)
2021051803189	SO	USDMXN	08/18/2021	(99,830)	20.04129	2,000,728
2021052103493	BO	USDMXN	08/18/2021	98,118	20.16719	(1,978,764)
2021052503506	SO	USDMXN	08/18/2021	(99,676)	20.07114	2,000,611
2021052803626	BO	USDMXN	08/18/2021	10,902	20.08773	(218,996)
2021063003285	BO	USDMXN	08/18/2021	752	20.05304	(15,076)
2021072703113	SO	USDMXN	08/18/2021	(149,000)	20.01795	2,982,674
2021072703155	SO	USDMXN	08/18/2021	(963)	20.0398	19,289
2021072903165	SO	USDMXN	08/18/2021	(29,000)	19.89587	576,980
2021072903272	SO	USDMXN	08/18/2021	(882)	19.88998	17,547
2021080403361	BO	USDMXN	08/18/2021	26,370	20.00978	(527,658)
2021081003455	B	USDMXN	08/18/2021	144,000	20.10121	(2,894,574)
2021081303036	B	USDMXN	08/18/2021	3,500,000	19.8648	(69,526,800)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021081603126	S	USDMXN	08/18/2021	(516,000)	19.8877	10,262,053
2021081603129	S	USDMXN	08/18/2021	(500,000)	19.88691	9,943,455
2021081603313	S	USDMXN	08/18/2021	(50,000)	19.89607	994,804
2021081703363	B	USDMXN	08/18/2021	25,635,452	20.01135	(513,000,000)
2021081703365	SO	USDMXN	08/18/2021	(10,000,000)	19.99725	199,972,510
2021081803014	S	USDMXN	08/18/2021	(30,000,000)	19.97	599,100,000
2021081803162	S	USDMXN	08/18/2021	(3,500,000)	20.015	70,052,500
2020090903475	BO	USDMXN	08/19/2021	34,000	22.36123	(760,282)
2020090903498	SO	USDMXN	08/19/2021	(34,000)	22.4363	762,834
2021022203068	SO	USDMXN	08/19/2021	(50,000)	21.17471	1,058,736
2021032503433	BO	USDMXN	08/19/2021	464,000	21.07187	(9,777,346)
2021032503446	SO	USDMXN	08/19/2021	(458)	21.03074	9,635
2021040603279	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.53964	(616,189)
2021040803226	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.39339	(611,802)
2021041503294	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.27849	(608,355)
2021041603306	B	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.17004	(605,101)
2021041903641	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.10391	(603,117)
2021042003653	BO	USDMXN	08/19/2021	50,000	20.23893	(1,011,947)
2021042103344	BO	USDMXN	08/19/2021	100,000	20.16603	(2,016,603)
2021042103612	BO	USDMXN	08/19/2021	100,000	20.16315	(2,016,315)
2021051003520	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.10873	(603,262)
2021051103172	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	20.07399	(602,220)
2021051703508	BO	USDMXN	08/19/2021	100,000	19.98802	(1,998,802)
2021051803353	BO	USDMXN	08/19/2021	60,000	19.99203	(1,199,522)
2021060703467	BO	USDMXN	08/19/2021	30,000	19.95783	(598,735)
2021060903190	BO	USDMXN	08/19/2021	1,000,000	19.81673	(19,816,732)
2021061703720	SO	USDMXN	08/19/2021	(50,000)	20.58995	1,029,498
2021062503320	B	USDMXN	08/19/2021	500,000	19.90545	(9,952,725)
2021070203478	BO	USDMXN	08/19/2021	600,000	19.87892	(11,927,349)
2021071203336	B	USDMXN	08/19/2021	500,000	19.93414	(9,967,072)
2021072703526	B	USDMXN	08/19/2021	50,000	20.03624	(1,001,812)
2021072903371	SO	USDMXN	08/19/2021	(303,000)	19.91002	6,032,735
2021072903415	SO	USDMXN	08/19/2021	(890)	19.89459	17,706
2021073003103	BO	USDMXN	08/19/2021	750,000	19.87979	(14,909,841)
2021080603324	SO	USDMXN	08/19/2021	(153,000)	20.04388	3,066,713
2021081703390	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.00763	(656,500)
2021081703393	B	USDMXN	08/19/2021	32,816	20.00995	(656,637)
2021081703395	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.00995	(656,576)
2021081703397	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.00949	(656,561)
2021081703399	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.00949	(656,561)
2021081703401	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.01042	(656,592)
2021081703403	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.0129	(656,673)
2021081703405	B	USDMXN	08/19/2021	32,813	20.0126	(656,663)
2021081703407	B	USDMXN	08/19/2021	26,250	20.01741	(525,457)
2021081703410	B	USDMXN	08/19/2021	26,250	20.01662	(525,436)
2021081703412	B	USDMXN	08/19/2021	26,250	20.0183	(525,480)
2021081703414	B	USDMXN	08/19/2021	26,250	20.01882	(525,494)
2021081703416	B	USDMXN	08/19/2021	26,250	20.0192	(525,504)
2021081703428	B	USDMXN	08/19/2021	300,000	20.0177	(6,005,310)
2021081803015	B	USDMXN	08/19/2021	30,000,000	19.9724	(599,172,000)
2021081903009	S	USDMXN	08/19/2021	(20,000,000)	20.142	402,840,000
2021030503571	BO	USDMXN	08/20/2021	1,000,000	21.6692	(21,669,197)
2021030903273	BO	USDMXN	08/20/2021	25,000	21.61022	(540,255)
2021031803614	BO	USDMXN	08/20/2021	4,422,000	20.79626	(91,961,071)
2021031803679	BO	USDMXN	08/20/2021	652	20.81873	(13,567)
2021040603503	BO	USDMXN	08/20/2021	328,518	20.45736	(6,720,611)
2021041503754	BO	USDMXN	08/20/2021	250,000	20.20551	(5,051,376)
2021042303421	BO	USDMXN	08/20/2021	150,000	20.11637	(3,017,455)
2021051203485	BO	USDMXN	08/20/2021	50,000	20.35263	(1,017,631)
2021060903277	BO	USDMXN	08/20/2021	200,000	19.84274	(3,968,548)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021061103317	BO	USDMXN	08/20/2021	500,000	19.79286	(9,896,430)
2021062203378	BO	USDMXN	08/20/2021	300,000	20.59226	(6,177,678)
2021072903109	SO	USDMXN	08/20/2021	(248,000)	19.87765	4,929,656
2021072903273	SO	USDMXN	08/20/2021	(1,182)	19.89545	23,517
2021073003573	B	USDMXN	08/20/2021	1,973,852	19.96535	(39,408,640)
2021080603325	SO	USDMXN	08/20/2021	(126,000)	20.04642	2,525,848
2021081203360	S	USDMXN	08/20/2021	(150,000)	19.88736	2,983,104
2021081803157	S	USDMXN	08/20/2021	(516,000)	20.0089	10,324,592
2021081803227	S	USDMXN	08/20/2021	(516,000)	20.0111	10,325,728
2021081803231	S	USDMXN	08/20/2021	(270,000)	20.0104	5,402,808
2021081803336	S	USDMXN	08/20/2021	(100,000)	20.0059	2,000,590
2021081803342	S	USDMXN	08/20/2021	(17,200)	19.9839	343,723
2021081903010	B	USDMXN	08/20/2021	20,000,000	20.1445	(402,890,000)
2021082003014	S	USDMXN	08/20/2021	(30,486,306)	20.337	620,000,000
2021042303568	BO	USDMXN	08/23/2021	253,320	20.09555	(5,090,597)
2021042303546	SO	USDMXN	08/23/2021	(126,000)	20.09241	2,531,643
2021042303590	SO	USDMXN	08/23/2021	(1,000)	20.08715	20,087
2021062803198	BO	USDMXN	08/23/2021	40,000	19.91914	(796,766)
2021073003032	BO	USDMXN	08/23/2021	50,000	19.86612	(993,306)
2021073003186	BO	USDMXN	08/23/2021	314	19.90058	(6,258)
2021080603334	SO	USDMXN	08/23/2021	(224,000)	20.05404	4,492,105
2021081803163	B	USDMXN	08/23/2021	3,500,000	20.0269	(70,094,150)
2021081903058	B	USDMXN	08/23/2021	400,000	20.1118	(8,044,720)
2021081903440	B	USDMXN	08/23/2021	3,700,000	20.1932	(74,714,840)
2021081903455	B	USDMXN	08/23/2021	932,288	20.1958	(18,828,311)
2021081903210	S	USDMXN	08/23/2021	(516,000)	20.1131	10,378,360
2021081903343	S	USDMXN	08/23/2021	(516,000)	20.1483	10,396,523
2021082003015	B	USDMXN	08/23/2021	30,475,217	20.3444	(620,000,000)
2021082303175	S	USDMXN	08/23/2021	(20,000,000)	20.36	407,200,000
2021082303398	S	USDMXN	08/23/2021	(3,500,000)	20.31	71,085,000
2021042103345	BO	USDMXN	08/24/2021	50,000	20.17796	(1,008,898)
2021051703510	BO	USDMXN	08/24/2021	100,000	20.00008	(2,000,008)
2021062903649	BO	USDMXN	08/24/2021	35,227	19.95257	(702,868)
2021070203560	BO	USDMXN	08/24/2021	41,000	19.89284	(815,606)
2021070203594	BO	USDMXN	08/24/2021	79	19.89841	(1,565)
2021072903173	B	USDMXN	08/24/2021	200,000	19.92431	(3,984,862)
2021072903387	B	USDMXN	08/24/2021	1,430,224	19.91514	(28,483,113)
2021073003063	BO	USDMXN	08/24/2021	620,000	19.86884	(12,318,679)
2021082003087	B	USDMXN	08/24/2021	5,000,000	20.3845	(101,922,500)
2021082003149	B	USDMXN	08/24/2021	344,000	20.4035	(7,018,804)
2021082003262	B	USDMXN	08/24/2021	1,000,000	20.40154	(20,401,540)
2021082003267	B	USDMXN	08/24/2021	1,000,000	20.40153	(20,401,530)
2021082003272	B	USDMXN	08/24/2021	1,500,000	20.4157	(30,623,550)
2021082003274	B	USDMXN	08/24/2021	1,500,000	20.407	(30,610,500)
2021082003300	B	USDMXN	08/24/2021	100,000	20.4027	(2,040,270)
2021082003281	S	USDMXN	08/24/2021	(516,000)	20.3904	10,521,446
2021082003477	S	USDMXN	08/24/2021	(516,000)	20.428	10,540,848
2021082303176	B	USDMXN	08/24/2021	20,000,000	20.36263	(407,252,600)
2021082303399	B	USDMXN	08/24/2021	3,500,000	20.3124	(71,093,400)
2021082403484	S	USDMXN	08/24/2021	(3,500,000)	20.21	70,735,000
2020100503500	BO	USDMXN	08/25/2021	600,000	22.14481	(13,286,884)
2020100503237	SO	USDMXN	08/25/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503352	BO	USDMXN	08/25/2021	45,000	21.51694	(968,262)
2020110503570	BO	USDMXN	08/25/2021	900,000	21.47809	(19,330,284)
2020110503444	SO	USDMXN	08/25/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020110503736	SO	USDMXN	08/25/2021	(45,000)	21.6226	973,017
2021031203217	SO	USDMXN	08/25/2021	(500,000)	21.19876	10,599,381
2021031803626	BO	USDMXN	08/25/2021	500,000	20.78405	(10,392,026)
2021032403095	SO	USDMXN	08/25/2021	(500,000)	21.19102	10,595,510
2021033103386	BO	USDMXN	08/25/2021	500,000	20.85683	(10,428,414)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021041903259 B		USDMXN	08/25/2021	25,000,000	20.09466	(502,366,420)
2021041903261 B		USDMXN	08/25/2021	25,000,000	20.09346	(502,336,593)
2021042103700 BO		USDMXN	08/25/2021	315,000	20.18066	(6,356,909)
2021042103759 BO		USDMXN	08/25/2021	17,000	20.18081	(343,074)
2021072103412 BO		USDMXN	08/25/2021	23,950	20.29095	(485,968)
2021072203426 BO		USDMXN	08/25/2021	84,100	20.18102	(1,697,223)
2021072303263 BO		USDMXN	08/25/2021	35,300	20.13649	(710,818)
2021072903194 B		USDMXN	08/25/2021	300,000	19.92097	(5,976,291)
2021073003412 BO		USDMXN	08/25/2021	30,250	19.94446	(603,320)
2021082303182 S		USDMXN	08/25/2021	(516,000)	20.3702	10,511,023
2020091003215 BO		USDMXN	08/26/2021	34,000	22.16426	(753,585)
2020091003335 SO		USDMXN	08/26/2021	(34,000)	22.23415	755,962
2020100103471 S		USDMXN	08/26/2021	(331,162)	22.65166	7,501,370
2020102303549 BO		USDMXN	08/26/2021	500,000	21.62337	(10,811,686)
2020102303004 SO		USDMXN	08/26/2021	(500,000)	21.658	10,829,000
2021010703333 B		USDMXN	08/26/2021	59,791	20.45888	(1,223,263)
2021010703272 S		USDMXN	08/26/2021	(59,791)	20.47276	1,224,093
2021010703291 S		USDMXN	08/26/2021	(59,791)	20.46149	1,223,419
2021012003487 SO		USDMXN	08/26/2021	(60,462)	20.06448	1,213,146
2021012703398 SO		USDMXN	08/26/2021	(58,600)	20.69757	1,212,884
2021020303234 SO		USDMXN	08/26/2021	(58,725)	20.65688	1,213,080
2021021003395 SO		USDMXN	08/26/2021	(59,109)	20.45001	1,208,779
2021021703462 SO		USDMXN	08/26/2021	(58,868)	20.60056	1,212,710
2021022403162 SO		USDMXN	08/26/2021	(81,918)	20.90434	1,712,434
2021030303238 SO		USDMXN	08/26/2021	(80,348)	21.31573	1,712,685
2021031003485 SO		USDMXN	08/26/2021	(80,167)	21.35935	1,712,320
2021032403168 SO		USDMXN	08/26/2021	(80,991)	21.13058	1,711,388
2021040603280 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.55615	(616,684)
2021040803227 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.40969	(612,291)
2021041503295 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.29514	(608,854)
2021041603310 B		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.18659	(605,598)
2021041903642 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.12017	(603,605)
2021042003654 BO		USDMXN	08/26/2021	50,000	20.25538	(1,012,769)
2021042103346 BO		USDMXN	08/26/2021	100,000	20.18272	(2,018,272)
2021051003519 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.12498	(603,749)
2021051103173 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	20.09053	(602,716)
2021051803354 BO		USDMXN	08/26/2021	60,000	20.00894	(1,200,537)
2021060703388 BO		USDMXN	08/26/2021	30,000	19.97382	(599,215)
2021060703393 SO		USDMXN	08/26/2021	(57,000)	19.95955	1,137,695
2021060703437 SO		USDMXN	08/26/2021	(72)	19.96656	1,433
2021060903193 BO		USDMXN	08/26/2021	1,000,000	19.85233	(19,852,333)
2021061703723 SO		USDMXN	08/26/2021	(50,000)	20.60684	1,030,342
2021062503301 BO		USDMXN	08/26/2021	500,000	19.86181	(9,930,907)
2021070203477 BO		USDMXN	08/26/2021	600,000	19.89549	(11,937,295)
2021071203340 B		USDMXN	08/26/2021	500,000	19.95448	(9,977,240)
2021072003263 SO		USDMXN	08/26/2021	(11,000)	20.24507	222,696
2021072903325 BO		USDMXN	08/26/2021	9,570	19.92254	(190,659)
2021073003104 BO		USDMXN	08/26/2021	750,000	19.89817	(14,923,626)
2021073003357 BO		USDMXN	08/26/2021	13,083	19.9295	(260,728)
2021081603314 B		USDMXN	08/26/2021	50,000	19.91937	(995,969)
2021082403189 B		USDMXN	08/26/2021	150,000	20.31153	(3,046,730)
2021082403298 B		USDMXN	08/26/2021	175,000	20.2658	(3,546,515)
2021082403485 B		USDMXN	08/26/2021	3,500,000	20.215	(70,752,500)
2021082403306 S		USDMXN	08/26/2021	(1,032,000)	20.2626	20,911,003
2021082503025 SO		USDMXN	08/26/2021	(5,420,000)	20.30375	110,046,320
2021082603010 SO		USDMXN	08/26/2021	(4,430,000)	20.30579	89,954,637
2021082603219 S		USDMXN	08/26/2021	(30,000,000)	20.357	610,710,000
2021030903274 BO		USDMXN	08/27/2021	25,000	21.6269	(540,673)
2021040603504 BO		USDMXN	08/27/2021	56,543	20.47385	(1,157,651)
2021040603507 BO		USDMXN	08/27/2021	9,863	20.49454	(202,132)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021040803334	BO	USDMXN	08/27/2021	1,000,000	20.40606	(20,406,063)
2021041503755	BO	USDMXN	08/27/2021	250,000	20.22208	(5,055,520)
2021051203486	BO	USDMXN	08/27/2021	50,000	20.36959	(1,018,480)
2021060703519	BO	USDMXN	08/27/2021	119,000	19.97779	(2,377,357)
2021060703575	BO	USDMXN	08/27/2021	321	19.9599	(6,416)
2021062303201	BO	USDMXN	08/27/2021	400,000	20.41087	(8,164,348)
2021062303227	BO	USDMXN	08/27/2021	100,000	20.39266	(2,039,266)
2021062403346	BO	USDMXN	08/27/2021	500,000	20.23513	(10,117,567)
2021070803363	S	USDMXN	08/27/2021	(500,000)	20.09255	10,046,276
2021071303243	S	USDMXN	08/27/2021	(500,000)	20.10421	10,052,105
2021081203112	B	USDMXN	08/27/2021	150,000	19.92576	(2,988,864)
2021081903505	SO	USDMXN	08/27/2021	(234,000)	20.19258	4,725,063
2021082503464	B	USDMXN	08/27/2021	175,000	20.25757	(3,545,075)
2021082503311	S	USDMXN	08/27/2021	(516,000)	20.338	10,494,408
2021082603220	B	USDMXN	08/27/2021	30,000,000	20.3595	(610,785,000)
2021082703005	S	USDMXN	08/27/2021	(3,500,000)	20.37	71,295,000
2021082703011	S	USDMXN	08/27/2021	(30,000,000)	20.36	610,800,000
2021082703017	S	USDMXN	08/27/2021	(10,000,000)	20.368	203,680,000
2021082703225	S	USDMXN	08/27/2021	(15,000,000)	20.23	303,450,000
2021052403456	BO	USDMXN	08/30/2021	248,200	20.10917	(4,991,096)
2021052503524	S	USDMXN	08/30/2021	(248,200)	20.09837	4,988,416
2021060403564	BO	USDMXN	08/30/2021	1,380,600	20.13125	(27,793,198)
2021060403624	BO	USDMXN	08/30/2021	11	20.14123	(219)
2021061603545	SO	USDMXN	08/30/2021	(125,000)	20.40374	2,550,468
2021061703115	SO	USDMXN	08/30/2021	(125,000)	20.71006	2,588,758
2021062803199	BO	USDMXN	08/30/2021	40,000	19.93616	(797,446)
2021070103476	BO	USDMXN	08/30/2021	9,472	20.13361	(190,712)
2021070103430	SO	USDMXN	08/30/2021	(273,000)	20.13546	5,496,980
2021070803493	B	USDMXN	08/30/2021	172,802	20.12105	(3,476,966)
2021072903426	B	USDMXN	08/30/2021	2,358,136	19.92411	(46,983,749)
2021072903555	BO	USDMXN	08/30/2021	500,000	19.94533	(9,972,666)
2021072903531	SO	USDMXN	08/30/2021	(229,428)	19.9295	4,572,386
2021080503376	BO	USDMXN	08/30/2021	453,837	19.98034	(9,067,811)
2021081303283	B	USDMXN	08/30/2021	200,000	19.89161	(3,978,321)
2021081903456	S	USDMXN	08/30/2021	(932,288)	20.21433	18,845,591
2021081903507	SO	USDMXN	08/30/2021	(216,000)	20.19968	4,363,131
2021082603453	B	USDMXN	08/30/2021	100,000	20.3504	(2,035,040)
2021082603455	B	USDMXN	08/30/2021	100,000	20.3469	(2,034,690)
2021082603484	B	USDMXN	08/30/2021	1,000,000	20.363	(20,363,000)
2021082603138	S	USDMXN	08/30/2021	(600,000)	20.3478	12,208,680
2021082603267	S	USDMXN	08/30/2021	(516,000)	20.3568	10,504,109
2021082603526	B	MXNUSD	08/30/2021	197,000,000	20.35189	(9,679,691)
2021082603536	S	USDMXN	08/30/2021	(750,000)	20.3464	15,259,800
2021082603538	S	USDMXN	08/30/2021	(862,196)	20.346	17,542,240
2021082703012	B	USDMXN	08/30/2021	30,000,000	20.3677	(611,031,000)
2021082703018	B	USDMXN	08/30/2021	10,000,000	20.3757	(203,757,000)
2021083003048	S	USDMXN	08/30/2021	(10,000,000)	20.18	201,800,000
2020082703575	BO	USDMXN	08/31/2021	616,498	22.93226	(14,137,680)
2020082703584	SO	USDMXN	08/31/2021	(616,498)	22.9611	14,155,461
2020121703686	BO	USDMXN	08/31/2021	106,000	20.38759	(2,161,085)
2020121703643	SO	USDMXN	08/31/2021	(106,000)	20.3942	2,161,785
2021042303422	BO	USDMXN	08/31/2021	150,000	20.14253	(3,021,380)
2021050503346	BO	USDMXN	08/31/2021	93,750	20.54059	(1,925,680)
2021050703339	BO	USDMXN	08/31/2021	93,750	20.21437	(1,895,097)
2021051703511	BO	USDMXN	08/31/2021	100,000	20.01697	(2,001,697)
2021052503525	B	USDMXN	08/31/2021	248,200	20.10263	(4,989,473)
2021052703174	BO	USDMXN	08/31/2021	175,000	20.0976	(3,517,080)
2021060203302	B	USDMXN	08/31/2021	298,200	20.11831	(5,999,281)
2021060703704	BO	USDMXN	08/31/2021	167,115	20.02265	(3,346,084)
2021060803469	BO	USDMXN	08/31/2021	175,000	19.93102	(3,487,928)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021071603156	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	19.9514	(9,860,481)
2021071603552	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	19.98775	(9,878,443)
2021071903429	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.15856	(9,962,865)
2021072003137	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.26394	(10,014,947)
2021072003392	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.24146	(10,003,835)
2021072103172	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.26692	(10,016,418)
2021072103400	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.29663	(10,031,100)
2021072203166	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.29959	(10,032,566)
2021072203309	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.23397	(10,000,132)
2021072203359	S	USDMXN	08/31/2021	(350,000)	20.22268	7,077,939
2021072303122	BO	USDMXN	08/31/2021	494,000	20.13996	(9,949,142)
2021072303127	BO	USDMXN	08/31/2021	225	20.10517	(4,522)
2021072303381	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.15779	(9,962,483)
2021072603327	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.09888	(9,933,370)
2021072603488	BO	USDMXN	08/31/2021	19,850	20.15172	(400,012)
2021072703126	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.03858	(9,903,569)
2021072703264	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.07616	(9,922,138)
2021072703478	S	USDMXN	08/31/2021	(11,000,000)	20.0656	220,721,633
2021072803456	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	20.00754	(9,888,225)
2021072903199	B	USDMXN	08/31/2021	300,000	19.93037	(5,979,112)
2021072903271	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	19.9317	(9,850,743)
2021073003180	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	19.9184	(9,844,172)
2021073003294	B	USDMXN	08/31/2021	494,225	19.92442	(9,847,145)
2021080903270	BO	USDMXN	08/31/2021	50,000	20.11056	(1,005,528)
2021081903506	SO	USDMXN	08/31/2021	(126,000)	20.20239	2,545,501
2021082403190	S	USDMXN	08/31/2021	(150,000)	20.32368	3,048,552
2021082703226	B	USDMXN	08/31/2021	15,000,000	20.2403	(303,604,500)
2021082703541	B	USDMXN	08/31/2021	513,000	20.1902	(10,357,573)
2021082703543	B	USDMXN	08/31/2021	127,000	20.1908	(2,564,232)
2021082703545	B	USDMXN	08/31/2021	114,000	20.191	(2,301,774)
2021082703547	B	USDMXN	08/31/2021	407,000	20.191	(8,217,737)
2021083003049	B	USDMXN	08/31/2021	10,000,000	20.1827	(201,827,000)
2020090103317	BO	USDMXN	09/01/2021	2,800,000	22.69896	(63,557,080)
2020090103316	SO	USDMXN	09/01/2021	(2,800,000)	22.7899	63,811,720
2020092903219	SO	USDMXN	09/01/2021	(367,000)	23.35389	8,570,877
2020092903294	SO	USDMXN	09/01/2021	(1,324)	23.30037	30,853
2020100503507	BO	USDMXN	09/01/2021	600,000	22.1637	(13,298,220)
2020100503238	SO	USDMXN	09/01/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503571	BO	USDMXN	09/01/2021	900,000	21.49482	(19,345,342)
2020110503447	SO	USDMXN	09/01/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
202011903523	BO	USDMXN	09/01/2021	200,000	20.81824	(4,163,648)
202011903534	SO	USDMXN	09/01/2021	(200,000)	20.819	4,163,800
2021011403558	SO	USDMXN	09/01/2021	(32,089)	20.21857	648,789
2021011403596	SO	USDMXN	09/01/2021	(14,884)	20.21611	300,896
2021021103371	SO	USDMXN	09/01/2021	(46,549)	20.40303	949,742
2021021803512	SO	USDMXN	09/01/2021	(45,665)	20.79273	949,510
2021022503464	SO	USDMXN	09/01/2021	(44,716)	21.24537	950,017
2021030403322	SO	USDMXN	09/01/2021	(44,830)	21.18007	949,510
2021031203010	SO	USDMXN	09/01/2021	(45,111)	21.05051	949,617
2021031803552	SO	USDMXN	09/01/2021	(45,746)	20.7718	950,219
2021042103701	BO	USDMXN	09/01/2021	315,000	20.19734	(6,362,161)
2021042103760	BO	USDMXN	09/01/2021	17,000	20.19746	(343,357)
2021042703357	SO	USDMXN	09/01/2021	(82,000)	20.27423	1,662,488
2021042703515	SO	USDMXN	09/01/2021	(207)	20.31587	4,206
2021050403084	SO	USDMXN	09/01/2021	(113,721)	20.52136	2,333,716
2021051103308	SO	USDMXN	09/01/2021	(99,236)	20.16141	2,000,735
2021051803190	SO	USDMXN	09/01/2021	(99,636)	20.07447	2,000,147
2021061803377	SO	USDMXN	09/01/2021	(357,500)	20.8912	7,468,605
2021072703513	BO	USDMXN	09/01/2021	21,950	20.06316	(440,386)
2021072903499	B	USDMXN	09/01/2021	300,000	19.93062	(5,979,186)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021080203241	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.94013	(10,289,105)
2021080203413	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.98324	(10,311,351)
2021080303285	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.96219	(10,300,489)
2021080303415	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.9663	(10,302,613)
2021080403457	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	20.03908	(10,340,164)
2021080503113	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.98546	(10,312,498)
2021080903118	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	20.15182	(10,398,340)
2021080903195	BO	USDMXN	09/01/2021	516,000	20.11065	(10,377,094)
2021081003182	BO	USDMXN	09/01/2021	516,000	20.17328	(10,409,411)
2021081003242	BO	USDMXN	09/01/2021	516,000	20.141	(10,392,757)
2021081103220	BO	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.99201	(10,315,879)
2021081203178	B	USDMXN	09/01/2021	1,032,000	19.94055	(20,578,645)
2021081303189	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.88693	(10,261,654)
2021081303216	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.87869	(10,257,405)
2021081303435	BO	USDMXN	09/01/2021	30,950	19.90747	(616,136)
2021081603127	B	USDMXN	09/01/2021	516,000	19.92537	(10,281,489)
2021081903271	SO	USDMXN	09/01/2021	(138,000)	20.1471	2,780,300
2021081903273	SO	USDMXN	09/01/2021	(805)	20.13303	16,211
2021082003342	SO	USDMXN	09/01/2021	(22,000)	20.42037	449,248
2021082003393	SO	USDMXN	09/01/2021	(430)	20.42597	8,787
2021082703006	B	USDMXN	09/01/2021	3,500,000	20.3825	(71,338,750)
2021083003062	S	USDMXN	09/01/2021	(516,000)	20.1647	10,404,985
2021083003184	S	USDMXN	09/01/2021	(516,000)	20.1267	10,385,377
2020110503353	BO	USDMXN	09/02/2021	45,000	21.53616	(969,127)
2020110503739	SO	USDMXN	09/02/2021	(45,000)	21.642	973,890
2021040603281	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.57266	(617,180)
2021040803228	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.426	(612,780)
2021041503296	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.31179	(609,354)
2021041603312	B	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.2034	(606,102)
2021041903643	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.13642	(604,092)
2021051003522	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.14122	(604,237)
2021051103174	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	20.10707	(603,212)
2021051803356	BO	USDMXN	09/02/2021	60,000	20.02595	(1,201,557)
2021060703358	BO	USDMXN	09/02/2021	30,000	19.98989	(599,697)
2021061703721	SO	USDMXN	09/02/2021	(50,000)	20.62417	1,031,208
2021063003230	S	USDMXN	09/02/2021	(2,000,000)	20.09476	40,189,513
2021063003348	S	USDMXN	09/02/2021	(2,000,000)	20.09167	40,183,343
2021070203023	B	USDMXN	09/02/2021	4,000,000	19.98226	(79,929,038)
2021072903186	B	USDMXN	09/02/2021	250,000	19.93636	(4,984,090)
2021073003359	BO	USDMXN	09/02/2021	26,165	19.94815	(521,933)
2021081003409	B	USDMXN	09/02/2021	250,000	20.14835	(5,037,087)
2021081203422	BO	USDMXN	09/02/2021	200,000	19.91441	(3,982,881)
2021083003178	B	MXNUSD	09/02/2021	31,780,964	20.1337	(1,578,496)
2021083003181	B	MXNUSD	09/02/2021	58,772,646	20.13347	(2,919,151)
2021083103457	S	USDMXN	09/02/2021	(1,032,000)	20.07471	20,717,101
2020082803150	S	MXNUSD	09/03/2021	(33,077,686)	22.84758	1,447,755
2020082803154	S	MXNUSD	09/03/2021	(103,328,790)	22.84768	4,522,508
2020082803241	B	USDMXN	09/03/2021	2,012,888	22.84775	(45,989,960)
2020082803445	BO	USDMXN	09/03/2021	3,243	22.8337	(74,039)
2020092903445	B	USDMXN	09/03/2021	86,561	23.30312	(2,017,139)
2020092903378	SO	USDMXN	09/03/2021	(8,072,954)	22.59352	182,396,436
2021040603386	BO	USDMXN	09/03/2021	440,000	20.49688	(9,018,627)
2021040703188	BO	USDMXN	09/03/2021	180,000	20.48652	(3,687,573)
2021040803263	BO	USDMXN	09/03/2021	50,000	20.44412	(1,022,206)
2021040803335	BO	USDMXN	09/03/2021	1,000,000	20.42244	(20,422,441)
2021041503568	BO	USDMXN	09/03/2021	50,000	20.25188	(1,012,595)
2021041503756	BO	USDMXN	09/03/2021	250,000	20.23866	(5,059,664)
2021042003249	BO	USDMXN	09/03/2021	3,100,000	20.23439	(62,726,619)
2021051703550	BO	USDMXN	09/03/2021	65,000	20.02163	(1,301,406)
2021061803321	SO	USDMXN	09/03/2021	(500,000)	20.86137	10,430,683

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021062403526	BO	USDMXN	09/03/2021	500,000	20.0414	(10,020,698)
2021062503147	BO	USDMXN	09/03/2021	1,900,000	19.98585	(37,973,116)
2021062503274	BO	USDMXN	09/03/2021	500,000	19.95684	(9,978,418)
2021071503373	S	USDMXN	09/03/2021	(500,000)	20.108	10,053,998
2021072203487	S	USDMXN	09/03/2021	(500,000)	20.21705	10,108,526
2021081903508	SO	USDMXN	09/03/2021	(237,000)	20.21052	4,789,893
2021082603487	SO	USDMXN	09/03/2021	(65,000)	20.36689	1,323,848
2021082603493	SO	USDMXN	09/03/2021	(356)	20.36123	7,257
2021082703258	SO	USDMXN	09/03/2021	(20,754)	20.22131	419,665
2021083003176	B	MXNUSD	09/03/2021	90,553,609	20.13608	(4,497,082)
2021090103070	S	USDMXN	09/03/2021	(550,000)	19.98	10,989,000
2021090103158	S	USDMXN	09/03/2021	(300,000)	19.9342	5,980,260
2021090103160	S	USDMXN	09/03/2021	(300,000)	19.9371	5,981,130
2021090103169	S	USDMXN	09/03/2021	(300,000)	19.9346	5,980,380
2021090103335	S	USDMXN	09/03/2021	(700,000)	19.95655	13,969,585
2021090103342	S	USDMXN	09/03/2021	(700,000)	19.95275	13,966,925
2021090103346	S	USDMXN	09/03/2021	(700,000)	19.95592	13,969,144
2021090103467	S	USDMXN	09/03/2021	(1,650,000)	19.9826	32,971,290
2021031703425	BO	USDMXN	09/07/2021	4,300,000	20.93509	(90,020,883)
2021040603753	BO	USDMXN	09/07/2021	1,000,000	20.54773	(20,547,727)
2021040703190	BO	USDMXN	09/07/2021	100,000	20.4959	(2,049,590)
2021060803156	BO	USDMXN	09/07/2021	200,000	19.95945	(3,991,890)
2021062903651	BO	USDMXN	09/07/2021	36,338	19.98725	(726,289)
2021071303306	BO	USDMXN	09/07/2021	60,000	20.1245	(1,207,471)
2021082003391	SO	USDMXN	09/07/2021	(220,286)	20.44223	4,503,136
2021082703542	S	USDMXN	09/07/2021	(513,000)	20.2086	10,367,013
2021083003169	B	MXNUSD	09/07/2021	90,553,609	20.14076	(4,496,037)
2021083003172	B	MXNUSD	09/07/2021	81,249,516	20.14491	(4,033,253)
2021083003174	B	MXNUSD	09/07/2021	9,304,094	20.14604	(461,832)
2021090203288	B	USDMXN	09/07/2021	1,000,000	19.9938	(19,993,800)
2020092903059	B	USDMXN	09/08/2021	1,704,765	23.16622	(39,492,961)
202100503509	BO	USDMXN	09/08/2021	600,000	22.18202	(13,309,213)
2020100503241	SO	USDMXN	09/08/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503572	BO	USDMXN	09/08/2021	900,000	21.51155	(19,360,399)
2020110503448	SO	USDMXN	09/08/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2020112703405	BO	USDMXN	09/08/2021	250,000	20.73841	(5,184,602)
2020112703426	SO	USDMXN	09/08/2021	(250,000)	20.743	5,185,750
2020121503475	BO	USDMXN	09/08/2021	250,000	20.53763	(5,134,407)
2020121503448	SO	USDMXN	09/08/2021	(250,000)	20.539	5,134,750
2020121603228	BO	USDMXN	09/08/2021	250,000	20.5531	(5,138,275)
2020121603085	SO	USDMXN	09/08/2021	(250,000)	20.554	5,138,500
2020121703146	BO	USDMXN	09/08/2021	250,000	20.40013	(5,100,032)
2020121703088	SO	USDMXN	09/08/2021	(250,000)	20.4	5,100,000
2020122403091	BO	USDMXN	09/08/2021	300,000	20.47811	(6,143,433)
2020122403086	SO	USDMXN	09/08/2021	(300,000)	20.4941	6,148,230
2021041503053	BO	USDMXN	09/08/2021	300,000	20.28722	(6,086,165)
2021042103702	BO	USDMXN	09/08/2021	315,000	20.214	(6,367,411)
2021042103761	BO	USDMXN	09/08/2021	17,000	20.21411	(343,640)
2021072903204	B	USDMXN	09/08/2021	300,000	19.94501	(5,983,504)
2021073003041	BO	USDMXN	09/08/2021	57,000	19.90271	(1,134,454)
2021073003181	BO	USDMXN	09/08/2021	850	19.94758	(16,958)
2021080403501	BO	USDMXN	09/08/2021	51,150	20.06829	(1,026,493)
2021080603479	BO	USDMXN	09/08/2021	29,700	20.13174	(597,913)
2021081603228	BO	USDMXN	09/08/2021	27,350	19.97335	(546,271)
2021081703577	BO	USDMXN	09/08/2021	40,800	20.0772	(819,150)
2021083003162	B	MXNUSD	09/08/2021	88,584,089	20.14824	(4,396,617)
2021083003167	B	MXNUSD	09/08/2021	1,969,521	20.14843	(97,751)
2021090303656	S	USDMXN	09/08/2021	(500,000)	19.92034	9,960,170
2021090303658	S	USDMXN	09/08/2021	(500,000)	19.92034	9,960,170
2020100103111	B	USDMXN	09/09/2021	330,000	22.83774	(7,536,454)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
202100103454	BO	USDMXN	09/09/2021	3	22.70668	(70)
202100103072	SO	USDMXN	09/09/2021	(330,000)	22.88066	7,550,619
202100103089	SO	USDMXN	09/09/2021	(330,000)	22.87592	7,549,055
2021010703335	B	USDMXN	09/09/2021	54,751	20.48993	(1,121,842)
2021010703274	S	USDMXN	09/09/2021	(54,751)	20.49798	1,122,283
2021010703295	S	USDMXN	09/09/2021	(54,751)	20.49062	1,121,880
2021012003512	SO	USDMXN	09/09/2021	(55,395)	20.10522	1,113,721
2021012703399	SO	USDMXN	09/09/2021	(53,675)	20.72958	1,112,666
2021020303235	SO	USDMXN	09/09/2021	(53,803)	20.68774	1,113,053
2021021003396	SO	USDMXN	09/09/2021	(54,151)	20.48175	1,109,107
2021021703470	SO	USDMXN	09/09/2021	(53,928)	20.63173	1,112,623
2021022403163	SO	USDMXN	09/09/2021	(65,554)	20.93576	1,372,425
2021030303310	SO	USDMXN	09/09/2021	(64,166)	21.34686	1,369,752
2021031003367	SO	USDMXN	09/09/2021	(64,091)	21.38331	1,370,486
2021040603282	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.58918	(617,675)
2021040803229	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.4423	(613,269)
2021041503297	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.32843	(609,853)
2021041603319	B	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.21954	(606,586)
2021041903644	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.15266	(604,580)
2021051003521	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.15747	(604,724)
2021051103175	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.12361	(603,708)
2021051803357	BO	USDMXN	09/09/2021	60,000	20.04296	(1,202,577)
2021060703359	BO	USDMXN	09/09/2021	30,000	20.00587	(600,176)
2021060703394	SO	USDMXN	09/09/2021	(136,000)	19.99027	2,718,677
2021060703438	SO	USDMXN	09/09/2021	(632)	19.9983	12,638
2021061703722	SO	USDMXN	09/09/2021	(50,000)	20.64149	1,032,075
2021073003360	BO	USDMXN	09/09/2021	26,165	19.96796	(522,452)
2021080903084	BO	USDMXN	09/09/2021	100	20.17092	(2,017)
2021080903272	SO	USDMXN	09/09/2021	(100)	20.12578	2,013
2021081003422	B	USDMXN	09/09/2021	250,000	20.16734	(5,041,835)
2021081203423	BO	USDMXN	09/09/2021	200,000	19.93275	(3,986,549)
2021082603489	BO	USDMXN	09/09/2021	15,705	20.3853	(320,151)
2021082703544	S	USDMXN	09/09/2021	(127,000)	20.21455	2,567,248
2021083003157	B	MXNUSD	09/09/2021	11,743,045	20.15088	(582,756)
2021083003160	B	MXNUSD	09/09/2021	78,810,564	20.15204	(3,910,798)
2021083103387	BO	USDMXN	09/09/2021	9,140	20.10761	(183,784)
2021090103071	B	USDMXN	09/09/2021	550,000	19.99643	(10,998,035)
2021090103573	SO	USDMXN	09/09/2021	(300,000)	20.01275	6,003,825
2020112403122	BO	USDMXN	09/10/2021	146,500	20.72141	(3,035,686)
2020112403026	SO	USDMXN	09/10/2021	(146,500)	20.7202	3,035,509
2020121403361	BO	USDMXN	09/10/2021	500,000	20.82057	(10,410,285)
2020121403620	SO	USDMXN	09/10/2021	(500,000)	20.9986	10,499,300
2021040703189	BO	USDMXN	09/10/2021	100,000	20.50295	(2,050,295)
2021040803264	BO	USDMXN	09/10/2021	50,000	20.46052	(1,023,026)
2021041503569	BO	USDMXN	09/10/2021	50,000	20.26835	(1,013,418)
2021041503757	BO	USDMXN	09/10/2021	250,000	20.25523	(5,063,808)
2021051703551	BO	USDMXN	09/10/2021	65,000	20.03812	(1,302,478)
2021060403602	B	USDMXN	09/10/2021	136,663	20.16443	(2,755,732)
2021070803495	B	USDMXN	09/10/2021	132,338	20.14736	(2,666,258)
2021072303455	S	USDMXN	09/10/2021	(418,438)	20.19114	8,448,745
2021080403029	BO	USDMXN	09/10/2021	282,000	19.91765	(5,616,778)
2021080403366	BO	USDMXN	09/10/2021	191	20.06441	(3,830)
2021080603415	BO	USDMXN	09/10/2021	282,000	20.14956	(5,682,177)
2021080603427	SO	USDMXN	09/10/2021	(1,317)	20.14972	26,545
2021081203569	BO	USDMXN	09/10/2021	130,837	20.01736	(2,619,003)
2021082303311	BO	USDMXN	09/10/2021	25,000	20.36914	(509,229)
2021082303367	BO	USDMXN	09/10/2021	1,942	20.35741	(39,527)
2021082703546	S	USDMXN	09/10/2021	(114,000)	20.21745	2,304,790
2021083003154	B	MXNUSD	09/10/2021	90,553,609	20.15317	(4,493,269)
2021083103359	SO	USDMXN	09/10/2021	(141,000)	20.12465	2,837,575

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021090803473	S	USDMXN	09/10/2021	(500,000)	19.93273	9,966,365
2021010403050	BO	USDMXN	09/13/2021	300,000	20.33692	(6,101,076)
2021010403053	SO	USDMXN	09/13/2021	(300,000)	20.339	6,101,700
2021010603222	BO	USDMXN	09/13/2021	300,000	20.30935	(6,092,807)
2021010603136	SO	USDMXN	09/13/2021	(300,000)	20.311	6,093,300
2021011403518	BO	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.23615	(5,059,038)
2021011403437	SO	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.241	5,060,250
2021011903148	BO	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.2166	(5,052,916)
2021011903025	SO	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.209	5,052,250
2021012003111	BO	USDMXN	09/13/2021	250,000	20.15201	(5,038,003)
2021012003022	SO	USDMXN	09/13/2021	(250,000)	20.156	5,039,000
2021060803308	BO	USDMXN	09/13/2021	5,000,000	19.97392	(99,869,590)
2021060803475	BO	USDMXN	09/13/2021	4,527	19.92446	(90,191)
2021063003371	BO	USDMXN	09/13/2021	56,000	20.12571	(1,127,040)
2021073003043	BO	USDMXN	09/13/2021	57,000	19.91351	(1,135,070)
2021073003182	BO	USDMXN	09/13/2021	828	19.9607	(16,535)
2021080303366	S	USDMXN	09/13/2021	(9,248,728)	20.00412	185,012,702
2021082403474	SO	USDMXN	09/13/2021	(735,700)	20.2588	14,904,398
2021082403512	SO	USDMXN	09/13/2021	(23)	20.26274	468
2021082703548	S	USDMXN	09/13/2021	(407,000)	20.2256	8,231,818
2021083003147	B	MXNUSD	09/13/2021	19,077,619	20.16566	(946,045)
2021083003149	B	MXNUSD	09/13/2021	71,475,991	20.16196	(3,545,091)
2021090803404	B	USDMXN	09/13/2021	2,106,697	19.94614	(42,020,467)
2021090903571	S	USDMXN	09/13/2021	(50,000)	19.92346	996,173
2020100903063	BO	USDMXN	09/14/2021	500,000	22.07267	(11,036,333)
2020100903070	SO	USDMXN	09/14/2021	(500,000)	22.1	11,050,000
2021012103645	B	USDMXN	09/14/2021	100,000	20.23314	(2,023,314)
2021012103631	SO	USDMXN	09/14/2021	(100,000)	20.2523	2,025,230
2021040703191	BO	USDMXN	09/14/2021	100,000	20.51236	(2,051,236)
2021060803155	BO	USDMXN	09/14/2021	1,000,000	19.97537	(19,975,367)
2021073003045	BO	USDMXN	09/14/2021	115,000	19.92455	(2,291,324)
2021073003187	BO	USDMXN	09/14/2021	528	19.95971	(10,538)
2021080403478	BO	USDMXN	09/14/2021	50,000	20.07063	(1,003,531)
2021080903271	BO	USDMXN	09/14/2021	50,000	20.14652	(1,007,326)
2021082003301	S	USDMXN	09/14/2021	(100,000)	20.46009	2,046,009
2021083003145	B	MXNUSD	09/14/2021	90,553,609	20.16542	(4,490,539)
2021090703335	BO	USDMXN	09/14/2021	43,000	19.96567	(858,524)
2021091003637	S	USDMXN	09/14/2021	(900,000)	19.875	17,887,500
2021091403005	S	USDMXN	09/14/2021	(20,000,000)	19.85	397,000,000
2020092903229	SO	USDMXN	09/15/2021	(350,000)	23.38635	8,185,222
2020092903427	SO	USDMXN	09/15/2021	(197,383)	23.31998	4,602,963
2020100503508	BO	USDMXN	09/15/2021	600,000	22.20064	(13,320,385)
2020100503242	SO	USDMXN	09/15/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503573	BO	USDMXN	09/15/2021	900,000	21.52885	(19,375,968)
2020110503451	SO	USDMXN	09/15/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
202011903583	BO	USDMXN	09/15/2021	521,000	20.88832	(10,882,814)
2021011503215	BO	USDMXN	09/15/2021	944,414	20.41344	(19,278,738)
2021011503001	SO	USDMXN	09/15/2021	(79,816)	20.35146	1,624,365
2021011503103	SO	USDMXN	09/15/2021	(944,414)	20.251	19,125,328
2021012003258	BO	USDMXN	09/15/2021	1,000,000	20.09789	(20,097,885)
2021012003325	BO	USDMXN	09/15/2021	733,897	20.12106	(14,766,785)
2021012003630	BO	USDMXN	09/15/2021	274,662	20.08839	(5,517,516)
2021012003229	SO	USDMXN	09/15/2021	(733,897)	19.9662	14,653,134
2021012003243	SO	USDMXN	09/15/2021	(1,000,000)	20.099	20,099,000
2021012003573	SO	USDMXN	09/15/2021	(274,662)	19.9372	5,475,991
2021012103119	BO	USDMXN	09/15/2021	250,000	20.1904	(5,047,599)
2021012103213	BO	USDMXN	09/15/2021	580,746	20.21726	(11,741,093)
2021012103047	SO	USDMXN	09/15/2021	(250,000)	20.195	5,048,750
2021012103165	SO	USDMXN	09/15/2021	(580,746)	20.0648	11,652,552
2021012603499	BO	USDMXN	09/15/2021	94,276	20.5117	(1,933,761)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021012703793	BO	USDMXN	09/15/2021	62,960	20.79705	(1,309,382)
2021020403619	B	USDMXN	09/15/2021	1,873,622	20.88205	(39,125,063)
2021021103372	SO	USDMXN	09/15/2021	(79,117)	20.43464	1,616,718
2021021203542	BO	USDMXN	09/15/2021	113,207	20.41389	(2,310,995)
2021021503155	BO	USDMXN	09/15/2021	200,000	20.35223	(4,070,460)
2021021803511	SO	USDMXN	09/15/2021	(77,638)	20.82445	1,616,779
2021030303436	BO	USDMXN	09/15/2021	20,458	21.34167	(436,608)
2021031803114	BO	USDMXN	09/15/2021	150,000	20.86558	(3,129,837)
2021032403104	BO	USDMXN	09/15/2021	64,856	21.196	(1,374,688)
2021040603283	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.60337	(618,101)
2021040803230	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.45629	(613,689)
2021041503324	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.34268	(610,280)
2021041603323	B	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.23621	(607,086)
2021041903034	BO	USDMXN	09/15/2021	300,000	20.18366	(6,055,098)
2021041903645	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.16659	(604,998)
2021042103703	BO	USDMXN	09/15/2021	315,000	20.23067	(6,372,660)
2021042103762	BO	USDMXN	09/15/2021	17,000	20.23076	(343,923)
2021042203377	BO	USDMXN	09/15/2021	975,559	20.22602	(19,731,672)
2021042303380	BO	USDMXN	09/15/2021	203,772	20.16543	(4,109,150)
2021042303581	BO	USDMXN	09/15/2021	143,843	20.16164	(2,900,111)
2021042703604	BO	USDMXN	09/15/2021	291,012	20.37879	(5,930,471)
2021043003602	BO	USDMXN	09/15/2021	259,381	20.54338	(5,328,561)
2021050603556	BO	USDMXN	09/15/2021	65,023	20.37658	(1,324,946)
2021051003523	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.17164	(605,149)
2021051103176	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.13793	(604,138)
2021051803358	BO	USDMXN	09/15/2021	60,000	20.05754	(1,203,452)
2021052103494	BO	USDMXN	09/15/2021	99,339	20.23279	(2,009,905)
2021052503505	SO	USDMXN	09/15/2021	(133,277)	20.13308	2,683,277
2021052803629	BO	USDMXN	09/15/2021	11,038	20.15163	(222,434)
2021060203236	SO	USDMXN	09/15/2021	(133,208)	20.13651	2,682,335
2021060403573	B	USDMXN	09/15/2021	1,000,000	20.1724	(20,172,404)
2021060703360	BO	USDMXN	09/15/2021	30,000	20.01938	(600,581)
2021061603546	SO	USDMXN	09/15/2021	(175,000)	20.44215	3,577,376
2021061703118	SO	USDMXN	09/15/2021	(175,000)	20.74952	3,631,166
2021070203592	BO	USDMXN	09/15/2021	50,000	19.93731	(996,866)
2021070903197	B	USDMXN	09/15/2021	100,000	20.04901	(2,004,901)
2021071603304	B	USDMXN	09/15/2021	100,000	19.97859	(1,997,859)
2021071903545	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000)	20.22018	1,011,009
2021072903208	B	USDMXN	09/15/2021	300,000	19.97031	(5,991,093)
2021073003634	BO	USDMXN	09/15/2021	29,051	20.03828	(582,132)
2021080403362	BO	USDMXN	09/15/2021	20,243	20.08335	(406,547)
2021080603478	BO	USDMXN	09/15/2021	21,400	20.15105	(431,233)
2021082603490	BO	USDMXN	09/15/2021	15,705	20.40272	(320,425)
2021082603454	S	USDMXN	09/15/2021	(100,000)	20.39461	2,039,461
2021083003139	B	MXNUSD	09/15/2021	32,790,185	20.16464	(1,626,123)
2021083003142	B	MXNUSD	09/15/2021	57,763,425	20.1667	(2,864,298)
2021090203289	S	USDMXN	09/15/2021	(1,000,000)	20.01518	20,015,184
2021090303405	BO	USDMXN	09/15/2021	240,000	19.91357	(4,779,256)
2021091303433	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000)	19.87303	993,652
2021040703192	BO	USDMXN	09/17/2021	100,000	20.51942	(2,051,942)
2021040803265	BO	USDMXN	09/17/2021	50,000	20.47695	(1,023,848)
2021041503570	BO	USDMXN	09/17/2021	50,000	20.28482	(1,014,241)
2021041503758	BO	USDMXN	09/17/2021	250,000	20.27181	(5,067,952)
2021051703554	BO	USDMXN	09/17/2021	65,000	20.05501	(1,303,576)
2021061803089	BO	USDMXN	09/17/2021	71,000	20.89942	(1,483,859)
2021061803696	SO	USDMXN	09/17/2021	(767)	20.8163	15,976
2021071603282	BO	USDMXN	09/17/2021	500,000	19.99225	(9,996,127)
2021073003035	BO	USDMXN	09/17/2021	115,000	19.92927	(2,291,865)
2021073003188	BO	USDMXN	09/17/2021	550	19.97148	(10,975)
2021082003273	S	USDMXN	09/17/2021	(1,500,000)	20.48115	30,721,727

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021083003136	B	MXNUSD	09/17/2021	90,553,609	20.17144	(4,489,199)
2021090303415	BO	USDMXN	09/17/2021	1,500,000	19.96187	(29,942,798)
2021091403006	B	USDMXN	09/17/2021	20,000,000	19.8575	(397,150,000)
2021091703152	S	USDMXN	09/17/2021	(6,006,908)	19.977	120,000,000
2021091703156	S	USDMXN	09/17/2021	(14,000,000)	19.977	279,678,000
2021042103308	BO	USDMXN	09/20/2021	300,000	20.24114	(6,072,341)
2021050703640	BO	USDMXN	09/20/2021	300,000	20.24173	(6,072,519)
2021063003372	BO	USDMXN	09/20/2021	56,000	20.14408	(1,128,068)
2021083003130	B	MXNUSD	09/20/2021	40,124,758	20.18563	(1,987,788)
2021083003133	B	MXNUSD	09/20/2021	50,428,852	20.1826	(2,498,630)
2021090203336	BO	USDMXN	09/20/2021	31,000	20.01233	(620,382)
2021090903339	BO	USDMXN	09/20/2021	10,000	19.95995	(199,600)
2021090903431	BO	USDMXN	09/20/2021	100,000	19.95378	(1,995,379)
2021090903608	SO	USDMXN	09/20/2021	(10,000)	19.95616	199,562
2021091503042	S	USDMXN	09/20/2021	(634,750)	19.8972	12,629,748
2021091703153	B	USDMXN	09/20/2021	6,004,594	19.9847	(120,000,000)
2021091703157	B	USDMXN	09/20/2021	14,000,000	19.9847	(279,785,800)
2021092003207	SO	USDMXN	09/20/2021	(5,000,000)	20.1562	100,781,005
2021012703410	B	USDMXN	09/21/2021	53,644	20.75068	(1,113,150)
2021012703338	SO	USDMXN	09/21/2021	(53,644)	20.72367	1,111,701
2021040703193	BO	USDMXN	09/21/2021	100,000	20.52883	(2,052,883)
2021041303289	BO	USDMXN	09/21/2021	344,000	20.42682	(7,026,828)
2021052003022	BO	USDMXN	09/21/2021	110,000	20.16734	(2,218,408)
2021052003527	BO	USDMXN	09/21/2021	937	20.14636	(18,872)
2021062903652	BO	USDMXN	09/21/2021	84,906	20.02334	(1,700,109)
2021070103328	BO	USDMXN	09/21/2021	94	20.20182	(1,892)
2021072903374	BO	USDMXN	09/21/2021	292,600	19.99683	(5,851,074)
2021072903418	BO	USDMXN	09/21/2021	46	19.99162	(920)
2021080403479	BO	USDMXN	09/21/2021	15,000	20.08987	(301,348)
2021081203488	B	USDMXN	09/21/2021	2,500,000	20.03028	(50,075,708)
2021081203495	B	USDMXN	09/21/2021	2,765,000	20.04221	(55,416,713)
2021081203512	B	USDMXN	09/21/2021	2,000,000	20.04275	(40,085,493)
2021081303392	B	USDMXN	09/21/2021	50,000	19.95331	(997,666)
2021081803343	B	USDMXN	09/21/2021	17,200	20.07176	(345,234)
2021082003150	S	USDMXN	09/21/2021	(344,000)	20.48084	7,045,408
2021082403291	BO	USDMXN	09/21/2021	15,100	20.34854	(307,263)
2021083003473	BO	USDMXN	09/21/2021	32,000	20.17566	(645,621)
2021083003128	B	MXNUSD	09/21/2021	90,553,609	20.18983	(4,485,111)
2021090103470	BO	USDMXN	09/21/2021	300,000	20.02166	(6,006,498)
2021091003638	B	USDMXN	09/21/2021	900,000	19.89361	(17,904,246)
2021091703573	S	USDMXN	09/21/2021	(50,000)	20.01597	1,000,799
2021091703605	S	USDMXN	09/21/2021	(5,765,000)	20.0197	115,413,571
2020100503510	BO	USDMXN	09/22/2021	600,000	22.21918	(13,331,508)
2020100503244	SO	USDMXN	09/22/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503574	BO	USDMXN	09/22/2021	900,000	21.54625	(19,391,623)
2020110503452	SO	USDMXN	09/22/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021041403234	BO	USDMXN	09/22/2021	1,000,000	20.3809	(20,380,898)
2021042103704	BO	USDMXN	09/22/2021	315,000	20.24733	(6,377,910)
2021042103763	BO	USDMXN	09/22/2021	17,000	20.24742	(344,206)
2021051403049	BO	USDMXN	09/22/2021	500,000	20.08112	(10,040,562)
2021072903256	B	USDMXN	09/22/2021	300,000	19.98854	(5,996,561)
2021072903501	B	USDMXN	09/22/2021	300,000	19.98706	(5,996,117)
2021081703429	S	USDMXN	09/22/2021	(300,000)	20.11066	6,033,199
2021081903559	BO	USDMXN	09/22/2021	32,600	20.26051	(660,493)
2021082603485	S	USDMXN	09/22/2021	(1,000,000)	20.42613	20,426,133
2021083003466	BO	USDMXN	09/22/2021	21,900	20.17864	(441,912)
2021083003121	B	MXNUSD	09/22/2021	47,459,331	20.20111	(2,349,343)
2021083003125	B	MXNUSD	09/22/2021	43,094,278	20.19987	(2,133,394)
2020100103452	BO	USDMXN	09/23/2021	435	22.74938	(9,901)
2020100103112	S	USDMXN	09/23/2021	(330,000)	22.86894	7,546,751

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021010703338	B	USDMXN	09/23/2021	54,616	20.51629	(1,120,527)
2021010703278	S	USDMXN	09/23/2021	(54,616)	20.53088	1,121,324
2021010703297	S	USDMXN	09/23/2021	(54,616)	20.51772	1,120,605
2021012003523	SO	USDMXN	09/23/2021	(55,304)	20.15474	1,114,631
2021012703411	S	USDMXN	09/23/2021	(53,644)	20.75152	1,113,194
2021020303236	SO	USDMXN	09/23/2021	(53,714)	20.71925	1,112,922
2021030303317	SO	USDMXN	09/23/2021	(64,085)	21.38525	1,370,482
2021031003486	SO	USDMXN	09/23/2021	(63,933)	21.42641	1,369,852
2021032403238	SO	USDMXN	09/23/2021	(64,599)	21.20852	1,370,050
2021040603284	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.6223	(618,669)
2021040803231	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.47498	(614,249)
2021041503325	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.36172	(610,852)
2021041603326	B	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.25415	(607,625)
2021041903646	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.18517	(605,555)
2021042003655	BO	USDMXN	09/23/2021	50,000	20.32101	(1,016,050)
2021051003524	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.19117	(605,735)
2021051103177	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.15744	(604,723)
2021051803359	BO	USDMXN	09/23/2021	60,000	20.07714	(1,204,629)
2021060703385	BO	USDMXN	09/23/2021	30,000	20.03842	(601,153)
2021060703383	SO	USDMXN	09/23/2021	(136,407)	20.02321	2,731,302
2021071903547	S	USDMXN	09/23/2021	(50,000)	20.24156	1,012,078
2021072803144	BO	USDMXN	09/23/2021	300,000	20.09429	(6,028,287)
2021081003427	B	USDMXN	09/23/2021	250,000	20.20478	(5,051,195)
2021081203424	BO	USDMXN	09/23/2021	100,000	19.97081	(1,997,081)
2021081203426	BO	USDMXN	09/23/2021	100,000	19.97083	(1,997,083)
2021081303293	B	USDMXN	09/23/2021	300,000	19.95737	(5,987,212)
2021083003118	B	MXNUSD	09/23/2021	90,553,609	20.2	(4,482,853)
2021090903572	B	USDMXN	09/23/2021	50,000	19.95025	(997,512)
2021092103308	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11861	(660,142)
2021092103310	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.1187	(660,145)
2021092103312	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11886	(660,150)
2021092103316	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11889	(660,151)
2021092103320	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11832	(2,640,530)
2021092103324	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11866	(2,640,574)
2021092103336	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11891	(2,640,607)
2021092103341	B	USDMXN	09/23/2021	78,750	20.1201	(1,584,458)
2021092103350	B	USDMXN	09/23/2021	78,750	20.11883	(1,584,358)
2021092103354	B	USDMXN	09/23/2021	78,750	20.11842	(1,584,326)
2021092103356	B	USDMXN	09/23/2021	78,750	20.11771	(1,584,270)
2021092103358	B	USDMXN	09/23/2021	78,750	20.11813	(1,584,303)
2021092103360	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11792	(660,119)
2021092103362	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11794	(660,120)
2021092103365	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11873	(660,146)
2021092103368	B	USDMXN	09/23/2021	32,813	20.11897	(660,154)
2021092103370	B	USDMXN	09/23/2021	65,625	20.11841	(1,320,271)
2021092103372	B	USDMXN	09/23/2021	65,625	20.11807	(1,320,248)
2021092103374	B	USDMXN	09/23/2021	65,625	20.11836	(1,320,267)
2021092103377	B	USDMXN	09/23/2021	65,625	20.11878	(1,320,295)
2021092103379	B	USDMXN	09/23/2021	52,500	20.11824	(1,056,208)
2021092103381	B	USDMXN	09/23/2021	52,500	20.11885	(1,056,240)
2021092103383	B	USDMXN	09/23/2021	52,500	20.11888	(1,056,241)
2021092103386	B	USDMXN	09/23/2021	52,500	20.11869	(1,056,231)
2021092103388	B	USDMXN	09/23/2021	52,500	20.11927	(1,056,262)
2021092103390	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11987	(2,640,733)
2021092103392	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11983	(2,640,728)
2021092103394	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11998	(2,640,747)
2021092103397	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.12327	(2,641,179)
2021092103399	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.12327	(2,112,943)
2021092103401	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.12363	(2,112,981)
2021092103403	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.12364	(2,112,982)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021092103408	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.12347	(2,112,964)
2021092103410	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.11937	(2,112,534)
2021092103412	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11925	(2,640,652)
2021092103414	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.12228	(2,641,049)
2021092103417	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.12075	(2,640,848)
2021092103419	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.12111	(2,640,896)
2021092103423	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11958	(2,640,695)
2021092103425	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11899	(2,640,617)
2021092103427	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.1193	(2,640,658)
2021092103429	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.11925	(2,640,652)
2021092103431	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.11925	(2,112,521)
2021092103433	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.11952	(2,112,550)
2021092103435	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.1179	(2,112,380)
2021092103437	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.1186	(2,112,453)
2021092103440	B	USDMXN	09/23/2021	105,000	20.1169	(2,112,275)
2021092103442	B	USDMXN	09/23/2021	131,250	20.1171	(2,640,369)
2021092103515	S	USDMXN	09/23/2021	(18,800,000)	20.1285	378,415,800
2021092103742	S	USDMXN	09/23/2021	(25,044)	20.13073	504,152
2021040703194	BO	USDMXN	09/24/2021	100,000	20.53589	(2,053,589)
2021040803266	BO	USDMXN	09/24/2021	50,000	20.49342	(1,024,671)
2021041503571	BO	USDMXN	09/24/2021	50,000	20.30132	(1,015,066)
2021041503759	BO	USDMXN	09/24/2021	250,000	20.28841	(5,072,103)
2021051703555	BO	USDMXN	09/24/2021	65,000	20.07194	(1,304,676)
2021081903059	S	USDMXN	09/24/2021	(400,000)	20.20062	8,080,247
2021083003114	B	MXNUSD	09/24/2021	61,171,897	20.21307	(3,026,354)
2021083003116	B	MXNUSD	09/24/2021	29,381,712	20.20288	(1,454,333)
2021090303382	BO	USDMXN	09/24/2021	500,000	19.94157	(9,970,786)
2021091003476	BO	USDMXN	09/24/2021	100,000	19.88606	(1,988,606)
2021022203049	SO	USDMXN	09/27/2021	(300,000)	21.02749	6,308,248
2021022603369	BO	USDMXN	09/27/2021	300,000	21.39881	(6,419,643)
2021060703272	B	USDMXN	09/27/2021	1,997,204	20.04734	(40,038,618)
2021063003373	BO	USDMXN	09/27/2021	56,000	20.16245	(1,129,097)
2021072303083	BO	USDMXN	09/27/2021	97,000	20.17479	(1,956,955)
2021072303128	BO	USDMXN	09/27/2021	191	20.17804	(3,863)
2021082603139	B	USDMXN	09/27/2021	600,000	20.42681	(12,256,086)
2021083003111	B	MXNUSD	09/27/2021	90,553,609	20.2218	(4,478,019)
2021090203335	BO	USDMXN	09/27/2021	63,000	20.03123	(1,261,968)
2021091003493	BO	USDMXN	09/27/2021	1,200,000	19.89429	(23,873,143)
2021091003295	SO	USDMXN	09/27/2021	(600,000)	19.89624	11,937,745
2021092003236	SO	USDMXN	09/27/2021	(577,000)	20.18348	11,645,866
2021092303081	B	USDMXN	09/27/2021	450,000	20.03318	(9,014,931)
2021092303234	S	USDMXN	09/27/2021	(634,750)	20.00162	12,696,028
2021092303264	S	USDMXN	09/27/2021	(2,500,000)	20.01033	50,025,825
2021022203069	SO	USDMXN	09/28/2021	(50,000)	21.26692	1,063,346
2021040703195	BO	USDMXN	09/28/2021	100,000	20.5453	(2,054,530)
2021042003656	BO	USDMXN	09/28/2021	50,000	20.33276	(1,016,638)
2021071903549	S	USDMXN	09/28/2021	(50,000)	20.25376	1,012,688
2021073003170	B	USDMXN	09/28/2021	500,000	20.0016	(10,000,798)
2021081303397	B	USDMXN	09/28/2021	50,000	19.97182	(998,591)
2021082403292	BO	USDMXN	09/28/2021	36,000	20.36893	(733,281)
2021083003472	BO	USDMXN	09/28/2021	5,000	20.19437	(100,972)
2021083003107	B	MXNUSD	09/28/2021	68,506,470	20.22413	(3,387,364)
2021083003109	B	MXNUSD	09/28/2021	22,047,139	20.22624	(1,090,027)
2021090303398	BO	USDMXN	09/28/2021	270,000	19.94347	(5,384,738)
2021090703336	BO	USDMXN	09/28/2021	20,500	20.00289	(410,060)
2021091003495	B	USDMXN	09/28/2021	100,000	19.89834	(1,989,834)
2021091303434	B	USDMXN	09/28/2021	50,000	19.907	(995,350)
2021092003237	SO	USDMXN	09/28/2021	(187,000)	20.18614	3,774,809
2021092403049	B	USDMXN	09/28/2021	1,000,000	20.1024	(20,102,400)
2021092403230	S	USDMXN	09/28/2021	(634,750)	20.06577	12,736,748

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2020100503511	BO	USDMXN	09/29/2021	600,000	22.2378	(13,342,680)
2020100503247	SO	USDMXN	09/29/2021	(600,000)	22.0404	13,224,240
2020110503575	BO	USDMXN	09/29/2021	900,000	21.56364	(19,407,280)
2020110503453	SO	USDMXN	09/29/2021	(900,000)	21.3655	19,228,950
2021010703302	S	USDMXN	09/29/2021	(78,818)	20.54682	1,619,450
2021011403597	SO	USDMXN	09/29/2021	(5,976)	20.27903	121,192
2021011403659	S	USDMXN	09/29/2021	(73,682)	20.28676	1,494,771
2021021103373	SO	USDMXN	09/29/2021	(79,039)	20.46674	1,617,673
2021021803513	SO	USDMXN	09/29/2021	(77,519)	20.85638	1,616,773
2021022503465	SO	USDMXN	09/29/2021	(75,982)	21.31353	1,619,442
2021031203011	SO	USDMXN	09/29/2021	(76,547)	21.11585	1,616,349
2021032503410	SO	USDMXN	09/29/2021	(76,427)	21.15726	1,616,991
2021041603515	SO	USDMXN	09/29/2021	(1,301)	20.27089	26,364
2021042103705	BO	USDMXN	09/29/2021	315,000	20.26401	(6,383,162)
2021042103764	BO	USDMXN	09/29/2021	17,000	20.26411	(344,490)
2021051803199	SO	USDMXN	09/29/2021	(133,270)	20.12962	2,682,674
2021072903269	B	USDMXN	09/29/2021	300,000	20.00685	(6,002,054)
2021080503379	S	USDMXN	09/29/2021	(4,643,116)	20.0613	93,146,965
2021081703447	BO	USDMXN	09/29/2021	20,900	20.14026	(420,931)
2021082403447	BO	USDMXN	09/29/2021	41,750	20.30752	(847,839)
2021082603537	B	USDMXN	09/29/2021	750,000	20.42912	(15,321,839)
2021083003031	BO	USDMXN	09/29/2021	5	20.24951	(102)
2021083003651	BO	USDMXN	09/29/2021	46,444	20.20881	(938,578)
2021083003105	B	MXNUSD	09/29/2021	90,553,609	20.22658	(4,476,960)
2021090203538	BO	USDMXN	09/29/2021	120,000	20.04016	(2,404,819)
2021090903585	SO	USDMXN	09/29/2021	(118,000)	19.96264	2,355,592
2021091003477	BO	USDMXN	09/29/2021	100,000	19.89909	(1,989,909)
2021091003496	S	USDMXN	09/29/2021	(100,000)	19.90036	1,990,036
2021092303500	BO	USDMXN	09/29/2021	163,312	20.04671	(3,273,868)
2021092703058	S	USDMXN	09/29/2021	(634,750)	20.0962	12,756,063
2021092903626	S	USDMXN	09/29/2021	(2,500,000)	20.54	51,350,000
2020082703576	BO	USDMXN	09/30/2021	424,328	23.01528	(9,766,029)
2020082703587	SO	USDMXN	09/30/2021	(424,328)	23.045	9,778,638
2020100103346	BO	USDMXN	09/30/2021	600,000	22.88078	(13,728,468)
2020121703687	BO	USDMXN	09/30/2021	106,000	20.45728	(2,168,472)
2020121703644	SO	USDMXN	09/30/2021	(106,000)	20.4643	2,169,216
2020122203557	SO	USDMXN	09/30/2021	(600,000)	20.78505	12,471,030
2021040603285	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.63886	(619,166)
2021040803232	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.49133	(614,740)
2021041503326	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.37843	(611,353)
2021041603329	B	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.27057	(608,117)
2021041903647	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.20143	(606,043)
2021050503348	BO	USDMXN	09/30/2021	93,750	20.61194	(1,932,369)
2021050703340	BO	USDMXN	09/30/2021	93,750	20.28508	(1,901,726)
2021051003525	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.20825	(606,248)
2021051103178	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.17451	(605,235)
2021051803360	BO	USDMXN	09/30/2021	60,000	20.09455	(1,205,674)
2021052703175	BO	USDMXN	09/30/2021	175,000	20.16828	(3,529,449)
2021060703386	BO	USDMXN	09/30/2021	30,000	20.05516	(601,655)
2021060803470	BO	USDMXN	09/30/2021	175,000	20.00079	(3,500,138)
2021061603547	SO	USDMXN	09/30/2021	(125,000)	20.47679	2,559,598
2021061703117	SO	USDMXN	09/30/2021	(125,000)	20.78631	2,598,289
2021061803681	SO	USDMXN	09/30/2021	(150,000)	20.84554	3,126,831
2021062503275	BO	USDMXN	09/30/2021	150,000	20.03019	(3,004,528)
2021062903558	BO	USDMXN	09/30/2021	1,000,000	20.03059	(20,030,587)
2021062903559	BO	USDMXN	09/30/2021	1,000,000	20.03119	(20,031,187)
2021062903560	BO	USDMXN	09/30/2021	1,000,000	20.02898	(20,028,983)
2021062903561	BO	USDMXN	09/30/2021	76,811	20.02714	(1,538,300)
2021071903552	S	USDMXN	09/30/2021	(50,000)	20.26031	1,013,016
2021072003471	SO	USDMXN	09/30/2021	(441,160)	20.31789	8,963,440

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021072803143	BO	USDMXN	09/30/2021	300,000	20.11383	(6,034,148)
2021080303307	BO	USDMXN	09/30/2021	438,000	20.044	(8,779,271)
2021080303377	BO	USDMXN	09/30/2021	30,047	20.04804	(602,383)
2021080503395	B	USDMXN	09/30/2021	185,000	20.06401	(3,711,842)
2021081003430	B	USDMXN	09/30/2021	250,000	20.22281	(5,055,702)
2021081203427	BO	USDMXN	09/30/2021	200,000	19.98915	(3,997,830)
2021081303289	B	USDMXN	09/30/2021	300,000	19.97264	(5,991,793)
2021081703461	BO	USDMXN	09/30/2021	191,000	20.13012	(3,844,853)
2021081703522	BO	USDMXN	09/30/2021	378	20.14467	(7,621)
2021081803158	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.12136	(10,382,622)
2021081803228	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.12354	(10,383,749)
2021081903211	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.21862	(10,432,806)
2021081903344	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.25309	(10,450,596)
2021081903509	SO	USDMXN	09/30/2021	(100,000)	20.28844	2,028,844
2021082003282	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.49285	(10,574,311)
2021082003478	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.53026	(10,593,616)
2021082303183	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.47074	(10,562,903)
2021082403307	B	USDMXN	09/30/2021	1,032,000	20.36191	(21,013,486)
2021082403299	S	USDMXN	09/30/2021	(175,000)	20.36061	3,563,107
2021082503312	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.43389	(10,543,886)
2021082603268	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.44321	(10,548,696)
2021083003063	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.24241	(10,445,084)
2021083003185	B	USDMXN	09/30/2021	516,000	20.20434	(10,425,440)
2021083003101	B	MXNUSD	09/30/2021	82,219,036	20.22887	(4,064,441)
2021083003103	B	MXNUSD	09/30/2021	8,334,573	20.23012	(411,988)
2021083103458	B	USDMXN	09/30/2021	1,032,000	20.15015	(20,794,957)
2021091703574	B	USDMXN	09/30/2021	50,000	20.04027	(1,002,014)
2021092103665	B	USDMXN	09/30/2021	7,193,740	20.14593	(144,924,561)
2021092103677	B	USDMXN	09/30/2021	8,000,000	20.14718	(161,177,428)
2021092103740	BO	USDMXN	09/30/2021	5,000,000	20.14649	(100,732,465)
2021092103775	B	USDMXN	09/30/2021	272,676	20.14136	(5,492,056)
2021092303082	S	USDMXN	09/30/2021	(450,000)	20.04091	9,018,411
2021092803418	B	USDMXN	09/30/2021	300,000	20.34793	(6,104,379)
2021092803491	B	USDMXN	09/30/2021	100,000	20.37806	(2,037,806)
2021092903627	B	USDMXN	09/30/2021	2,500,000	20.5425	(51,356,250)
2021093003024	B	USDMXN	09/30/2021	90,000,000	20.5	(1,845,000,000)
2021092803499	BO	EURUSD	09/29/2021	4,470,000	1.16798	(5,220,875)
2021062203350	S	USDMXN	07/01/2021	(30,000,000)	20.45706	613,711,944
2021062203395	S	USDMXN	07/01/2021	(20,000,000)	20.42664	408,532,846
2021062903049	B	USDMXN	07/01/2021	6,791,041	19.8182	(134,586,200)
2021062903205	B	USDMXN	07/01/2021	2,200,000	19.8009	(43,561,980)
2021062903421	B	USDMXN	07/01/2021	25,500,000	19.83	(505,665,000)
2021062903423	B	USDMXN	07/01/2021	8,959	19.8222	(177,596)
2021062303364	S	USDMXN	07/02/2021	(20,000,000)	20.2081	404,162,000
2021062903422	S	USDMXN	07/02/2021	(25,500,000)	19.83245	505,727,475
2021062903424	S	USDMXN	07/02/2021	(8,959)	19.82462	177,618
2021063003424	B	USDMXN	07/02/2021	30,000,000	19.9378	(598,134,000)
2021063003432	B	USDMXN	07/02/2021	12,671,985	19.9362	(252,631,232)
2021070103001	B	USDMXN	07/02/2021	2,000,000	19.9492	(39,898,406)
2021030103188	B	USDMXN	07/06/2021	70,000,000	20.8835	(1,461,845,000)
2021062103414	B	USDMXN	07/06/2021	100,000,000	20.5375	(2,053,750,000)
2021062103416	S	USDMXN	07/06/2021	(100,000,000)	20.5375	2,053,750,000
2021063003425	S	USDMXN	07/06/2021	(30,000,000)	19.94794	598,438,308
2021063003433	S	USDMXN	07/06/2021	(12,671,985)	19.94634	252,759,765
2021070103002	S	USDMXN	07/06/2021	(2,000,000)	19.9592	39,918,400
2021070203016	S	USDMXN	07/06/2021	(27,328,015)	19.873	543,089,637
2021070203017	B	USDMXN	07/07/2021	27,328,015	19.8754	(543,155,225)
2021070203354	B	USDMXN	07/07/2021	10,000,000	19.7801	(197,801,000)
2021070203557	B	USDMXN	07/07/2021	15,000,000	19.7615	(296,422,500)
2021070203007	S	USDMXN	07/07/2021	(1,500,000)	19.9474	29,921,100

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021070203550	S	USDMXN	07/07/2021	(15,000,000)	19.7615	296,422,500
2021070603032	S	USDMXN	07/07/2021	(35,528,015)	19.8709	705,973,700
2021070603033	B	USDMXN	07/08/2021	35,528,015	19.8734	(706,062,449)
2021070703007	S	USDMXN	07/08/2021	(39,816,345)	19.95	794,336,082
2021061603248	S	USDMXN	07/09/2021	(50,000,000)	20.092	1,004,600,000
2021070703008	B	USDMXN	07/09/2021	39,816,345	19.95255	(794,437,613)
2021070703020	S	USDMXN	07/09/2021	(20,000,000)	19.98	399,600,000
2021070703243	S	USDMXN	07/09/2021	(2,000,000)	19.9778	39,955,600
2021070803092	B	USDMXN	07/09/2021	2,183,655	20.02139	(43,719,820)
2021040803098	S	USDMXN	07/12/2021	(20,000,000)	20.302	406,040,000
2021051003379	B	USDMXN	07/12/2021	30,000,000	20.017	(600,510,000)
2021070803093	S	USDMXN	07/12/2021	(2,183,655)	20.0291	43,736,645
2021070903017	B	USDMXN	07/12/2021	22,183,655	19.915	(441,787,490)
2021051103024	B	USDMXN	07/13/2021	20,000,000	19.997	(399,940,000)
2021070903018	S	USDMXN	07/13/2021	(22,183,655)	19.9175	441,842,949
2021071203001	B	USDMXN	07/13/2021	1,441,988	19.9364	(28,748,043)
2021071303538	B	USDMXN	07/13/2021	1,000,000	20.06	(20,060,000)
2021062403307	B	USDMXN	07/14/2021	15,186,917	20.0277	(304,159,012)
2021062403433	B	USDMXN	07/14/2021	6,865,217	20.0275	(137,493,142)
2021071203022	B	USDMXN	07/14/2021	25,000,000	19.9018	(497,545,000)
2021071203025	B	USDMXN	07/14/2021	25,000,000	19.889	(497,225,000)
2021071203043	B	USDMXN	07/14/2021	25,000,000	19.895	(497,375,000)
2021071203314	B	USDMXN	07/14/2021	15,000,000	19.848	(297,720,000)
2021071203002	S	USDMXN	07/14/2021	(1,441,988)	19.9389	28,751,648
2021071203032	S	USDMXN	07/14/2021	(118,290,103)	19.905	2,354,564,500
2021071303020	B	USDMXN	07/14/2021	24,852,064	19.885	(494,183,297)
2021071303539	S	USDMXN	07/14/2021	(1,000,000)	20.0627	20,062,700
2021062903169	B	USDMXN	07/15/2021	3,500,000	19.8368	(69,428,800)
2021062903141	S	USDMXN	07/15/2021	(2,200,000)	19.8368	43,640,960
2021062903175	S	USDMXN	07/15/2021	(3,500,000)	19.8368	69,428,800
2021071303021	S	USDMXN	07/15/2021	(24,852,064)	19.8874	494,242,942
2021071403023	B	USDMXN	07/15/2021	23,984,358	19.955	(478,607,869)
2021071403107	B	USDMXN	07/15/2021	11,500,000	19.90851	(228,947,890)
2021071403074	S	USDMXN	07/15/2021	(11,500,000)	19.91	228,965,000
2021071403399	S	USDMXN	07/15/2021	(35,000,000)	19.88	695,800,000
2021071403400	B	USDMXN	07/16/2021	35,000,000	19.88245	(695,885,750)
2021071403024	S	USDMXN	07/16/2021	(23,984,358)	19.9574	478,665,431
2021071403108	S	USDMXN	07/16/2021	(11,500,000)	19.9109	228,975,350
2021071403141	S	USDMXN	07/16/2021	(50,000,000)	19.885	994,250,000
2021071403472	S	USDMXN	07/16/2021	(20,000,000)	19.87	397,400,000
2021071503003	B	USDMXN	07/16/2021	20,484,358	19.97	(409,072,634)
2021071503422	B	MXNUSD	07/16/2021	30,000,000	19.962	(1,502,855)
2021071503426	S	USDMXN	07/16/2021	(30,000,000)	19.95437	598,631,097
2021031703141	S	USDMXN	07/19/2021	(30,000,000)	20.9695	629,085,000
2021051303170	B	USDMXN	07/19/2021	30,000,000	20.223	(606,690,000)
2021061603249	B	USDMXN	07/19/2021	50,000,000	20.114	(1,005,700,000)
2021071503423	S	MXNUSD	07/19/2021	(30,000,000)	19.9693	1,502,306
2021071503427	B	USDMXN	07/19/2021	30,000,000	19.9617	(598,851,000)
2021071503004	S	USDMXN	07/19/2021	(20,484,358)	19.97713	409,218,585
2021071603019	B	USDMXN	07/19/2021	31,280,000	19.88	(621,846,400)
2021071603041	S	USDMXN	07/19/2021	(20,000,000)	19.88	397,600,000
2021071603049	S	USDMXN	07/19/2021	(42,560,904)	19.86	845,259,557
2021041603279	S	USDMXN	07/20/2021	(100,000,000)	20.1025	2,010,250,000
2021071603042	B	USDMXN	07/20/2021	20,000,000	19.88245	(397,649,000)
2021071603050	B	USDMXN	07/20/2021	42,560,904	19.86245	(845,363,832)
2021071603020	S	USDMXN	07/20/2021	(31,280,000)	19.88243	621,922,254
2021071903031	B	USDMXN	07/20/2021	20,000,000	19.94789	(398,957,866)
2021071903046	B	USDMXN	07/20/2021	31,219,096	19.995	(624,225,821)
2021071903500	S	USDMXN	07/20/2021	(30,000,000)	20.06159	601,847,685
2021072003153	B	USDMXN	07/20/2021	15,000,000	20.14	(302,100,000)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021072003517	S	USDMXN	07/20/2021	(15,000,000)	20.16	302,400,000
2021041903567	B	USDMXN	07/21/2021	30,000,000	20.0335	(601,005,000)
2021071903501	B	USDMXN	07/21/2021	30,000,000	20.0645	(601,935,000)
2021071903032	S	USDMXN	07/21/2021	(20,000,000)	19.9504	399,008,000
2021071903048	S	USDMXN	07/21/2021	(31,219,096)	19.9975	624,303,868
2021072003063	B	USDMXN	07/21/2021	44,219,096	20.14	(890,572,589)
2021072103036	B	USDMXN	07/21/2021	20,000,000	20.195	(403,900,000)
2021072103029	S	USDMXN	07/21/2021	(20,000,000)	20.21	404,200,000
2021072003065	B	USDMXN	07/22/2021	30,000,000	20.1325	(603,975,000)
2021072003077	B	USDMXN	07/22/2021	15,000,000	20.099	(301,485,000)
2021072003064	S	USDMXN	07/22/2021	(44,219,096)	20.1432	890,714,091
2021072103030	B	USDMXN	07/22/2021	20,000,000	20.2127	(404,254,000)
2021072103000	S	USDMXN	07/22/2021	(682,904)	20.1985	13,793,641
2021072103037	S	USDMXN	07/22/2021	(20,000,000)	20.1986	403,972,000
2021042103166	B	USDMXN	07/23/2021	15,000,000	20.0825	(301,237,500)
2021072103001	B	USDMXN	07/23/2021	682,904	20.2021	(13,796,099)
2021072103361	B	USDMXN	07/23/2021	4,317,096	20.1882	(87,154,393)
2021072103358	S	USDMXN	07/23/2021	(20,000,000)	20.17	403,400,000
2021071403075	B	USDMXN	07/26/2021	11,500,000	19.937	(229,275,500)
2021072003518	B	USDMXN	07/26/2021	15,000,000	20.1775	(302,662,500)
2021072003154	S	USDMXN	07/26/2021	(15,000,000)	20.1583	302,374,500
2021072103359	B	USDMXN	07/26/2021	20,000,000	20.1796	(403,592,000)
2021072103362	S	USDMXN	07/26/2021	(4,317,096)	20.19841	87,198,466
2021072203020	S	USDMXN	07/26/2021	(20,000,000)	20.142	402,840,000
2021072203435	S	USDMXN	07/26/2021	(7,132,904)	20.0915	143,310,745
2020102303147	B	USDMXN	07/27/2021	12,000,000	21.57174	(258,860,820)
2020102303140	S	USDMXN	07/27/2021	(12,000,000)	21.573	258,876,000
2021042303308	B	USDMXN	07/27/2021	10,000,000	20.063	(200,630,000)
2021072203436	B	USDMXN	07/27/2021	7,132,904	20.09496	(143,335,409)
2021072603031	B	USDMXN	07/27/2021	21,200,000	20.03882	(424,822,886)
2021072603008	S	USDMXN	07/27/2021	(17,282,904)	20.11	347,559,203
2021072603026	S	USDMXN	07/27/2021	(21,200,000)	20.05	425,060,000
2021021203212	BO	USDMXN	07/28/2021	14,630,000	20.3085	(297,113,355)
2021072603009	B	USDMXN	07/28/2021	17,282,904	20.11295	(347,610,188)
2021072603330	B	USDMXN	07/28/2021	30,000,000	20.072	(602,160,000)
2021072603032	S	USDMXN	07/28/2021	(21,200,000)	20.0416	424,881,920
2021072703174	S	USDMXN	07/28/2021	(42,660,000)	19.975	852,133,500
2021072703178	S	USDMXN	07/28/2021	(2,904)	19.98135	58,030
2021072703056	B	USDMXN	07/29/2021	10,000,000	19.97	(199,700,000)
2021072703175	B	USDMXN	07/29/2021	42,660,000	19.9778	(852,252,948)
2021072703179	B	USDMXN	07/29/2021	2,904	19.9842	(58,038)
2021072703051	S	USDMXN	07/29/2021	(20,000,000)	19.97	399,400,000
2021072803040	S	USDMXN	07/29/2021	(20,880,000)	19.955	416,660,400
2021072803045	S	USDMXN	07/29/2021	(2,429)	19.94748	48,444
2021062303011	B	USDMXN	07/30/2021	19,634,215	20.3726	(400,000,000)
2021072803041	B	USDMXN	07/30/2021	20,880,000	19.95783	(416,719,386)
2021072803046	B	USDMXN	07/30/2021	2,429	19.9503	(48,451)
2021072803319	B	USDMXN	07/30/2021	10,000,000	19.963	(199,630,000)
2021072803493	B	USDMXN	07/30/2021	10,000,000	19.905	(199,050,000)
2021072803314	S	USDMXN	07/30/2021	(12,000,000)	19.963	239,556,000
2021072803491	S	USDMXN	07/30/2021	(15,000,000)	19.905	298,575,000
2021072903465	B	USDMXN	07/30/2021	2,000,000	19.8365	(39,672,992)
2021072903015	S	USDMXN	07/30/2021	(28,130,000)	19.86	558,661,800
2021072903020	S	USDMXN	07/30/2021	(8,496)	19.85987	168,738
2021072903016	B	USDMXN	08/02/2021	28,130,000	19.86765	(558,876,995)
2021072903021	B	USDMXN	08/02/2021	8,496	19.8677	(168,804)
2021072903431	B	USDMXN	08/02/2021	5,000,000	19.86	(99,300,000)
2021072903675	B	USDMXN	08/02/2021	16,642,504	19.85	(330,353,696)
2021072903382	S	USDMXN	08/02/2021	(15,000,000)	19.865	297,975,000
2021072903466	S	USDMXN	08/02/2021	(2,000,000)	19.8443	39,688,600

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021072903703	S	USDMXN	08/02/2021	(5,000,000)	19.858	99,290,000
2021060103214	B	USDMXN	08/03/2021	15,000,000	20.0225	(300,337,500)
2021060103249	B	USDMXN	08/03/2021	50,000,000	20.038	(1,001,900,000)
2021072903676	S	USDMXN	08/03/2021	(16,642,504)	19.8527	330,398,631
2021073003491	B	USDMXN	08/03/2021	20,000,000	19.875	(397,500,000)
2021073003488	S	USDMXN	08/03/2021	(20,000,000)	19.875	397,500,000
2021073003555	S	USDMXN	08/03/2021	(48,507,496)	19.91	965,784,254
2021072603027	B	USDMXN	08/04/2021	21,200,000	20.0721	(425,528,520)
2021072603331	S	USDMXN	08/04/2021	(30,000,000)	20.0919	602,757,000
2021073003556	B	USDMXN	08/04/2021	48,507,496	19.9126	(965,910,373)
2021080303289	B	USDMXN	08/04/2021	21,850,000	19.88413	(434,468,168)
2021080303005	S	USDMXN	08/04/2021	(36,000,000)	19.844	714,384,000
2021080303010	S	USDMXN	08/04/2021	(6,207,496)	19.84992	123,218,289
2021080303286	S	USDMXN	08/04/2021	(21,850,000)	19.89	434,596,500
2021080303006	B	USDMXN	08/05/2021	36,000,000	19.84625	(714,465,000)
2021080303011	B	USDMXN	08/05/2021	6,207,496	19.8522	(123,232,460)
2021080303290	S	USDMXN	08/05/2021	(21,850,000)	19.8865	434,520,025
2021080403025	S	USDMXN	08/05/2021	(20,357,496)	19.82856	403,659,904
2021080403026	B	USDMXN	08/06/2021	20,357,496	19.8309	(403,707,476)
2021080403390	S	USDMXN	08/06/2021	(100,000,000)	19.987	1,998,700,000
2021080403393	S	USDMXN	08/06/2021	(50,000,000)	19.985	999,250,000
2021080403502	S	USDMXN	08/06/2021	(30,000,000)	19.975	599,250,000
2021080503001	S	USDMXN	08/06/2021	(22,000,000)	19.954	438,988,000
2021080503005	S	USDMXN	08/06/2021	(30,558,241)	19.92387	608,838,335
2021050503360	S	USDMXN	08/09/2021	(30,000,000)	20.4695	614,085,000
2021060403219	S	USDMXN	08/09/2021	(17,391,736)	20.1245	350,000,000
2021080503002	B	USDMXN	08/09/2021	22,000,000	19.9609	(439,139,800)
2021080503006	B	USDMXN	08/09/2021	30,558,241	19.931	(609,056,310)
2021080503126	B	USDMXN	08/09/2021	25,000,000	19.915	(497,875,000)
2021080503361	B	USDMXN	08/09/2021	10,000,000	19.95	(199,500,000)
2021080503130	S	USDMXN	08/09/2021	(25,000,000)	19.915	497,875,000
2021080503358	S	USDMXN	08/09/2021	(14,000,000)	19.95	279,300,000
2021080603006	S	USDMXN	08/09/2021	(1,166,505)	19.93336	23,252,362
2021080603007	B	USDMXN	08/10/2021	1,166,505	19.9357	(23,255,093)
2021080603386	B	USDMXN	08/10/2021	10,000,000	20.043	(200,430,000)
2021080603003	S	USDMXN	08/10/2021	(1,166,505)	19.9275	23,245,528
2021080903009	S	USDMXN	08/10/2021	(7,500,000)	20.01118	150,083,873
2021080603004	B	USDMXN	08/11/2021	1,166,505	19.92986	(23,248,284)
2021080903010	B	USDMXN	08/11/2021	7,500,000	20.0135	(150,101,250)
2021081003002	S	USDMXN	08/11/2021	(8,666,505)	20.09768	174,176,600
2021080303287	B	USDMXN	08/12/2021	21,850,000	19.90895	(435,010,558)
2021081003003	B	USDMXN	08/12/2021	8,666,505	20.1	(174,196,750)
2021081003134	B	USDMXN	08/12/2021	30,000,000	20.10669	(603,200,700)
2021081003360	B	USDMXN	08/12/2021	25,000,000	20.085	(502,125,000)
2021081003163	S	USDMXN	08/12/2021	(38,000,000)	20.106	764,028,000
2021081003346	S	USDMXN	08/12/2021	(30,000,000)	20.085	602,550,000
2021081103008	S	USDMXN	08/12/2021	(1,750,301)	19.98042	34,971,755
2021081103009	B	USDMXN	08/13/2021	1,750,301	19.9829	(34,976,088)
2021081103051	B	USDMXN	08/13/2021	10,000,000	20.008	(200,080,000)
2021081103102	B	USDMXN	08/13/2021	20,000,000	19.975	(399,500,000)
2021081103035	S	USDMXN	08/13/2021	(25,000,000)	20.005	500,125,000
2021081203010	S	USDMXN	08/13/2021	(15,750,301)	19.89	313,273,485
2021081203011	B	USDMXN	08/16/2021	15,750,301	19.8974	(313,390,038)
2021081603001	S	USDMXN	08/16/2021	(15,750,301)	19.91098	313,603,997
2021021203114	B	USDMXN	08/17/2021	71,130,000	20.4085	(1,451,656,605)
2021021203217	S	USDMXN	08/17/2021	(50,000,000)	20.3525	1,017,625,000
2021021203527	S	USDMXN	08/17/2021	(15,000,000)	20.3605	305,407,500
2021051303100	B	USDMXN	08/17/2021	50,000,000	20.36	(1,018,000,000)
2021051303171	S	USDMXN	08/17/2021	(30,000,000)	20.2915	608,745,000
2021051303316	S	USDMXN	08/17/2021	(40,000,000)	20.2345	809,380,000

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021081303270	B	USDMXN	08/17/2021	5,000,000	19.847	(99,235,000)
2021081303004	S	USDMXN	08/17/2021	(15,750,301)	19.8682	312,930,129
2021081603002	B	USDMXN	08/17/2021	15,750,301	19.91348	(313,643,255)
2021081603003	B	USDMXN	08/17/2021	8,870,000	19.912	(176,619,458)
2021081703012	SO	MXNUSD	08/17/2021	(3,372,856)	19.93751	169,171
2021061603193	S	USDMXN	08/18/2021	(25,000,000)	20.1625	504,062,500
2021081303005	B	USDMXN	08/18/2021	15,750,301	19.87081	(312,971,245)
2021081603004	S	USDMXN	08/18/2021	(8,870,000)	19.9145	176,641,615
2021081703072	B	USDMXN	08/18/2021	18,480,000	19.975	(369,138,000)
2021081703074	S	USDMXN	08/18/2021	(2,301)	19.98967	45,992
2021081803009	B	USDMXN	08/18/2021	1,100,000	19.96095	(21,957,042)
2021081803003	S	USDMXN	08/18/2021	(1,100,000)	19.96	21,956,000
2021081703075	B	USDMXN	08/19/2021	2,301	19.9922	(45,998)
2021081703082	B	USDMXN	08/19/2021	25,000,000	19.98	(499,500,000)
2021081703073	S	USDMXN	08/19/2021	(18,480,000)	19.97753	369,184,662
2021081703114	S	USDMXN	08/19/2021	(5,000,000)	19.99565	99,978,250
2021081803012	S	USDMXN	08/19/2021	(13,342,976)	19.98	266,592,666
2021041603269	B	USDMXN	08/20/2021	82,840,000	20.1896	(1,672,506,464)
2021081703541	S	USDMXN	08/20/2021	(50,000,000)	20.02	1,001,000,000
2021081803013	B	USDMXN	08/20/2021	13,342,976	19.98255	(266,626,691)
2021081803010	S	USDMXN	08/20/2021	(1,100,000)	19.9658	21,962,380
2021081903002	S	USDMXN	08/20/2021	(45,000,000)	20.145	906,525,000
2021081903004	S	USDMXN	08/20/2021	(82,976)	20.13547	1,670,767
2021072003066	S	USDMXN	08/23/2021	(30,000,000)	20.2225	606,675,000
2021072003078	S	USDMXN	08/23/2021	(15,000,000)	20.189	302,835,000
2021081903003	B	USDMXN	08/23/2021	45,000,000	20.1526	(906,867,000)
2021081903005	B	USDMXN	08/23/2021	82,976	20.1431	(1,671,400)
2021082003000	S	USDMXN	08/23/2021	(82,976)	20.26764	1,681,735
2021082003001	B	USDMXN	08/24/2021	82,976	20.2702	(1,681,947)
2021082003509	B	USDMXN	08/24/2021	35,000,000	20.43	(715,050,000)
2021082303013	S	USDMXN	08/24/2021	(35,000,000)	20.34	711,900,000
2021082303016	S	USDMXN	08/24/2021	(82,976)	20.38037	1,691,089
2021022303111	S	USDMXN	08/25/2021	(20,000,000)	20.945	418,900,000
2021082303014	B	USDMXN	08/25/2021	35,000,000	20.34258	(711,990,125)
2021082303017	B	USDMXN	08/25/2021	82,976	20.383	(1,691,307)
2021082403020	S	USDMXN	08/25/2021	(15,000,000)	20.32	304,800,000
2021082403246	S	USDMXN	08/25/2021	(50,000,000)	20.31	1,015,500,000
2021081703089	B	USDMXN	08/26/2021	50,000,000	19.9938	(999,690,000)
2021081703542	B	USDMXN	08/26/2021	50,000,000	20.0362	(1,001,810,000)
2021082403021	B	USDMXN	08/26/2021	15,000,000	20.32268	(304,840,125)
2021082403032	B	USDMXN	08/26/2021	45,000,000	20.307	(913,815,000)
2021082403247	B	USDMXN	08/26/2021	50,000,000	20.3127	(1,015,635,000)
2021082403313	S	USDMXN	08/26/2021	(25,000,000)	20.275	506,875,000
2021082403452	S	USDMXN	08/26/2021	(25,000,000)	20.269	506,725,000
2021082503020	B	USDMXN	08/26/2021	42,319,227	20.3	(859,080,316)
2021082603080	B	USDMXN	08/26/2021	2,000,000	20.3182	(40,636,399)
2021082603019	S	USDMXN	08/26/2021	(4,000,000)	20.325	81,300,000
2021080403391	B	USDMXN	08/27/2021	100,000,000	20.041	(2,004,100,000)
2021080403394	B	USDMXN	08/27/2021	50,000,000	20.039	(1,001,950,000)
2021080403503	B	USDMXN	08/27/2021	30,000,000	20.0287	(600,861,000)
2021082403033	S	USDMXN	08/27/2021	(45,000,000)	20.3097	913,936,500
2021082503320	B	USDMXN	08/27/2021	20,000,000	20.3	(406,000,000)
2021082503021	S	USDMXN	08/27/2021	(42,319,227)	20.30275	859,196,694
2021082503047	S	USDMXN	08/27/2021	(30,000,000)	20.326	609,780,000
2021082603011	S	USDMXN	08/27/2021	(82,680,773)	20.307	1,678,998,449
2021082603012	B	USDMXN	08/30/2021	82,680,773	20.31505	(1,679,664,030)
2021082603020	B	USDMXN	08/30/2021	4,000,000	20.3352	(81,340,800)
2021082603055	S	USDMXN	08/30/2021	(10,000,000)	20.335	203,350,000
2021082603058	S	USDMXN	08/30/2021	(30,000,000)	20.336	610,080,000
2021082603081	S	USDMXN	08/30/2021	(2,000,000)	20.3284	40,656,800

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021082703050	S	USDMXN	08/30/2021	(42,680,773)	20.41	871,114,569
2021062803027	B	USDMXN	08/31/2021	20,000,000	19.99995	(399,999,070)
2021082703051	B	USDMXN	08/31/2021	42,680,773	20.41255	(871,223,405)
2021082703412	B	USDMXN	08/31/2021	30,000,000	20.22	(606,600,000)
2021083003038	S	USDMXN	08/31/2021	(35,000,000)	20.168	705,880,000
2021083003041	S	USDMXN	08/31/2021	(36,061,406)	20.16	726,997,953
2021083003039	B	USDMXN	09/01/2021	35,000,000	20.17065	(705,972,750)
2021083003042	B	USDMXN	09/01/2021	36,061,406	20.1627	(727,095,319)
2021083003643	B	USDMXN	09/01/2021	10,000,000	20.135	(201,350,000)
2021083103014	S	USDMXN	09/01/2021	(80,761,406)	20.127	1,625,484,827
2021081703090	S	USDMXN	09/02/2021	(50,000,000)	20.0133	1,000,665,000
2021083103015	B	USDMXN	09/02/2021	80,761,406	20.12965	(1,625,698,844)
2021083103147	B	USDMXN	09/02/2021	5,000,000	20.0604	(100,302,000)
2021083103150	B	USDMXN	09/02/2021	5,000,000	20.0705	(100,352,500)
2021083103161	S	USDMXN	09/02/2021	(10,000,000)	20.075	200,750,000
2021083103176	S	USDMXN	09/02/2021	(7,000,000)	20.075	140,525,000
2021090103000	S	USDMXN	09/02/2021	(23,761,406)	20.033	476,012,254
2021090203173	B	USDMXN	09/02/2021	20,000,000	19.968	(399,360,000)
2021073003489	B	USDMXN	09/03/2021	20,000,000	19.957	(399,140,000)
2021090103001	B	USDMXN	09/03/2021	23,761,406	20.03565	(476,075,222)
2021090203152	B	USDMXN	09/03/2021	152,637,787	19.95	(3,045,123,859)
2021090203025	S	USDMXN	09/03/2021	(43,761,406)	19.95	873,040,058
2021090203168	S	USDMXN	09/03/2021	(152,600,000)	19.955	3,045,133,000
2021090203174	S	USDMXN	09/03/2021	(20,000,000)	19.9705	399,410,000
2021090203176	S	USDMXN	09/03/2021	(37,787)	19.96102	754,275
2021043003019	S	USDMXN	09/07/2021	(35,000,000)	20.3198	711,193,000
2021070203551	B	USDMXN	09/07/2021	15,000,000	19.912	(298,680,000)
2021082603059	B	USDMXN	09/07/2021	30,000,000	20.3575	(610,725,000)
2021090203026	B	USDMXN	09/07/2021	43,761,406	19.9607	(873,508,305)
2021090203044	B	USDMXN	09/07/2021	25,000,000	19.94	(498,500,000)
2021090203169	B	USDMXN	09/07/2021	152,600,000	19.9657	(3,046,765,820)
2021090203177	B	USDMXN	09/07/2021	37,787	19.9718	(754,683)
2021090203439	B	USDMXN	09/07/2021	30,000,000	19.9725	(599,175,000)
2021090203042	S	USDMXN	09/07/2021	(37,000,000)	19.94	737,780,000
2021090203153	S	USDMXN	09/07/2021	(152,556,042)	19.96069	3,045,123,859
2021090303012	S	USDMXN	09/07/2021	(71,761,406)	19.88	1,426,616,759
2021090703103	B	USDMXN	09/07/2021	1,850,000	19.93	(36,870,500)
2021090703110	S	USDMXN	09/07/2021	(1,850,000)	19.9292	36,869,014
2021090303013	B	USDMXN	09/08/2021	71,761,406	19.88263	(1,426,805,133)
2021090703258	B	USDMXN	09/08/2021	152,807,554	19.944	(3,047,593,859)
2021090703003	S	USDMXN	09/08/2021	(76,061,406)	19.9575	1,517,995,518
2021090703079	S	USDMXN	09/08/2021	(150,000,000)	19.955	2,993,250,000
2021090703084	S	USDMXN	09/08/2021	(2,781,732)	19.93655	55,458,133
2021090703261	S	USDMXN	09/08/2021	(25,822)	19.94327	514,981
2021030503064	S	USDMXN	09/09/2021	(10,000,000)	21.607	216,070,000
2021081703132	S	USDMXN	09/09/2021	(50,000,000)	20.0462	1,002,310,000
2021090703004	B	USDMXN	09/09/2021	76,061,406	19.96008	(1,518,191,376)
2021090703080	B	USDMXN	09/09/2021	150,000,000	19.9575	(2,993,625,000)
2021090703087	B	USDMXN	09/09/2021	2,781,732	19.9391	(55,465,229)
2021090703111	B	USDMXN	09/09/2021	1,850,000	19.9343	(36,878,455)
2021090703262	B	USDMXN	09/09/2021	25,822	19.9458	(515,046)
2021090703259	S	USDMXN	09/09/2021	(152,788,096)	19.94654	3,047,593,859
2021090803001	S	USDMXN	09/09/2021	(17,911,410)	19.896	356,365,407
2021030803356	B	USDMXN	09/10/2021	15,000,000	21.8755	(328,132,500)
2021060803281	B	USDMXN	09/10/2021	20,000,000	19.97	(399,400,000)
2021060803350	B	USDMXN	09/10/2021	30,000,000	19.97	(599,100,000)
2021090803002	B	USDMXN	09/10/2021	17,911,410	19.89855	(356,411,081)
2021090803356	B	USDMXN	09/10/2021	7,000,000	19.948	(139,636,000)
2021090803412	S	USDMXN	09/10/2021	(25,000,000)	19.931	498,275,000
2021090903008	S	USDMXN	09/10/2021	(64,911,410)	19.89	1,291,087,939

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021081103036	B	USDMXN	09/13/2021	25,000,000	20.0864	(502,160,000)
2021081103052	S	USDMXN	09/13/2021	(10,000,000)	20.0905	200,905,000
2021081103103	S	USDMXN	09/13/2021	(20,000,000)	20.0575	401,150,000
2021090703104	S	USDMXN	09/13/2021	(1,850,000)	19.9454	36,898,990
2021090703123	S	USDMXN	09/13/2021	(23,000,000)	19.94	458,620,000
2021090903009	B	USDMXN	09/13/2021	64,911,410	19.8976	(1,291,581,265)
2021090903224	B	USDMXN	09/13/2021	15,000,000	19.928	(298,920,000)
2021090903464	B	USDMXN	09/13/2021	13,000,000	19.95	(259,350,000)
2021090903428	S	USDMXN	09/13/2021	(50,000,000)	19.9385	996,925,000
2021090903462	S	USDMXN	09/13/2021	(15,000,000)	19.95	299,250,000
2021091003035	S	USDMXN	09/13/2021	(13,827,614)	19.86982	274,752,199
2021071203315	S	USDMXN	09/14/2021	(15,000,000)	20.0055	300,082,500
2021090903429	B	USDMXN	09/14/2021	50,000,000	19.94105	(997,052,500)
2021091003036	B	USDMXN	09/14/2021	13,827,614	19.8724	(274,787,871)
2021091003251	B	USDMXN	09/14/2021	15,000,000	19.865	(297,975,000)
2021091003353	S	USDMXN	09/14/2021	(10,000,000)	19.874	198,740,000
2021091303000	S	USDMXN	09/14/2021	(386,807)	19.86687	7,684,638
2021091303003	S	USDMXN	09/14/2021	(34,000,000)	19.867	675,478,000
2021091303013	S	USDMXN	09/14/2021	(16,000,000)	19.858	317,728,000
2021030803244	B	USDMXN	09/15/2021	45,000,000	21.846	(983,070,000)
2021030803059	S	USDMXN	09/15/2021	(46,790,000)	21.9035	1,024,864,765
2021051303101	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000,000)	20.428	1,021,400,000
2021052403113	B	USDMXN	09/15/2021	244,593,947	20.1229	(4,921,939,534)
2021052403141	S	USDMXN	09/15/2021	(100,000,000)	20.108	2,010,800,000
2021052403144	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000,000)	20.108	1,005,400,000
2021052403264	S	USDMXN	09/15/2021	(30,000,000)	20.1305	603,915,000
2021052403267	S	USDMXN	09/15/2021	(20,000,000)	20.1305	402,610,000
2021052403476	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000,000)	20.1343	1,006,715,000
2021052603050	B	USDMXN	09/15/2021	50,000,000	20.1578	(1,007,890,000)
2021052703293	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000,000)	20.2695	1,013,475,000
2021071203033	B	USDMXN	09/15/2021	117,352,696	20.064	(2,354,564,500)
2021071203023	S	USDMXN	09/15/2021	(25,000,000)	20.06089	501,522,178
2021071203026	S	USDMXN	09/15/2021	(25,000,000)	20.04799	501,199,803
2021071203044	S	USDMXN	09/15/2021	(25,000,000)	20.0547	501,367,500
2021071403142	B	USDMXN	09/15/2021	50,000,000	20.038	(1,001,900,000)
2021081803004	B	USDMXN	09/15/2021	1,100,000	20.0362	(22,039,820)
2021081903038	B	USDMXN	09/15/2021	30,000,000	20.207	(606,210,000)
2021081903345	S	USDMXN	09/15/2021	(30,000,000)	20.2105	606,315,000
2021082503298	S	USDMXN	09/15/2021	(30,000,000)	20.3255	609,765,000
2021082703046	S	USDMXN	09/15/2021	(25,000,000)	20.401	510,025,000
2021082703168	S	USDMXN	09/15/2021	(7,000,000)	20.405	142,835,000
2021091303001	B	USDMXN	09/15/2021	386,807	19.8694	(7,685,618)
2021091303004	B	USDMXN	09/15/2021	34,000,000	19.8695	(675,563,000)
2021091303014	B	USDMXN	09/15/2021	16,000,000	19.86055	(317,768,800)
2021091303030	S	USDMXN	09/15/2021	(10,000,000)	19.878	198,780,000
2021091303257	S	USDMXN	09/15/2021	(5,000,000)	19.874	99,370,000
2021091403023	B	USDMXN	09/15/2021	35,356,550	19.86	(702,181,083)
2021091403342	S	USDMXN	09/15/2021	(50,000,000)	19.91	995,500,000
2021051303318	B	USDMXN	09/17/2021	30,000,000	20.308	(609,240,000)
2021090703124	B	USDMXN	09/17/2021	23,000,000	19.95	(458,850,000)
2021091003030	B	USDMXN	09/17/2021	23,000,000	19.895	(457,585,000)
2021091403343	B	USDMXN	09/17/2021	50,000,000	19.91495	(995,747,500)
2021091403024	S	USDMXN	09/17/2021	(35,356,550)	19.8648	702,350,794
2021091403264	S	USDMXN	09/17/2021	(60,000,000)	19.903	1,194,180,000
2021091403504	S	USDMXN	09/17/2021	(10,000,000)	19.919	199,190,000
2021091503079	B	USDMXN	09/17/2021	15,900,000	19.91	(316,569,000)
2021091503026	S	USDMXN	09/17/2021	(16,514,561)	19.89177	328,503,892
2021091503138	S	USDMXN	09/17/2021	(15,900,000)	19.89266	316,293,259
2021081703133	B	USDMXN	09/20/2021	50,000,000	20.0775	(1,003,875,000)
2021091503027	B	USDMXN	09/20/2021	16,514,561	19.8991	(328,624,901)

External Deal Number	Type	Cross	Value	Amount 1	Rate	Amount 2
2021091503139	B	USDMXN	09/20/2021	15,900,000	19.9001	(316,411,590)
2021091503384	S	USDMXN	09/20/2021	(52,414,561)	19.872	1,041,582,156
2021091503389	S	USDMXN	09/20/2021	(30,000,000)	19.873	596,190,000
2021092003108	B	USDMXN	09/20/2021	6,000,000	20.165	(120,990,000)
2021092003222	B	USDMXN	09/20/2021	40,000,000	20.167	(806,680,000)
2021092003113	S	USDMXN	09/20/2021	(6,000,000)	20.2	121,200,000
2021092003215	S	USDMXN	09/20/2021	(50,000,000)	20.16	1,008,000,000
2021091503385	B	USDMXN	09/21/2021	52,414,561	19.87455	(1,041,715,814)
2021091503390	B	USDMXN	09/21/2021	30,000,000	19.87555	(596,266,500)
2021092003114	B	USDMXN	09/21/2021	6,000,000	20.2034	(121,220,400)
2021092003216	B	USDMXN	09/21/2021	50,000,000	20.16278	(1,008,139,000)
2021092003011	S	USDMXN	09/21/2021	(38,000,000)	20.187	767,106,000
2021092003013	S	USDMXN	09/21/2021	(44,414,561)	20.191	896,774,401
2021092003109	S	USDMXN	09/21/2021	(6,000,000)	20.1685	121,011,000
2021092003223	S	USDMXN	09/21/2021	(40,000,000)	20.1709	806,836,000
2021092103147	B	USDMXN	09/21/2021	13,000,000	20.11	(261,430,000)
2021092103153	S	USDMXN	09/21/2021	(13,000,000)	20.148	261,924,000
2021092103852	S	USDMXN	09/21/2021	(9,000,000)	20.12	181,080,000
2021061803336	B	USDMXN	09/22/2021	15,000,000	20.9316	(313,974,000)
2021061803255	S	USDMXN	09/22/2021	(50,000,000)	20.909	1,045,450,000
2021061803258	S	USDMXN	09/22/2021	(50,000,000)	20.909	1,045,450,000
2021061803296	S	USDMXN	09/22/2021	(50,000,000)	20.9315	1,046,575,000
2021091503080	S	USDMXN	09/22/2021	(15,900,000)	19.9224	316,766,160
2021092003012	B	USDMXN	09/22/2021	38,000,000	20.1896	(767,204,800)
2021092003014	B	USDMXN	09/22/2021	44,414,561	20.19363	(896,890,990)
2021092003069	B	USDMXN	09/22/2021	50,000,000	20.155	(1,007,750,000)
2021092003317	B	USDMXN	09/22/2021	20,000,000	20.158	(403,160,000)
2021092103154	B	USDMXN	09/22/2021	13,000,000	20.1514	(261,968,200)
2021092103853	B	USDMXN	09/22/2021	9,000,000	20.1227	(181,104,300)
2021092103026	S	USDMXN	09/22/2021	(1,514,561)	20.08255	30,416,253
2021092103148	S	USDMXN	09/22/2021	(13,000,000)	20.1135	261,475,500
2021092003070	S	USDMXN	09/23/2021	(50,000,000)	20.1578	1,007,890,000
2021092103027	B	USDMXN	09/23/2021	1,514,561	20.0857	(30,421,018)
2021092103694	B	USDMXN	09/23/2021	60,000,000	20.13	(1,207,800,000)
2021092103697	S	USDMXN	09/23/2021	(30,000,000)	20.13	603,900,000
2021092203013	B	USDMXN	09/23/2021	18,485,439	20.092	(371,409,459)
2021062203284	B	USDMXN	09/24/2021	30,000,000	20.694	(620,820,000)
2021092203029	B	USDMXN	09/24/2021	40,000,000	20.093	(803,720,000)
2021092203014	S	USDMXN	09/24/2021	(18,485,439)	20.095	371,464,897
2021092203022	S	USDMXN	09/24/2021	(50,000,000)	20.09	1,004,500,000
2021092303293	S	USDMXN	09/24/2021	(1,514,561)	19.99467	30,283,149
2021032403029	B	USDMXN	09/27/2021	15,000,000	21.257	(318,855,000)
2021052403068	S	USDMXN	09/27/2021	(25,000,000)	20.15095	503,773,725
2021062303243	B	USDMXN	09/27/2021	20,000,000	20.438	(408,760,000)
2021082503048	B	USDMXN	09/27/2021	30,000,000	20.4152	(612,456,000)
2021082503321	S	USDMXN	09/27/2021	(20,000,000)	20.388	407,760,000
2021092203030	S	USDMXN	09/27/2021	(40,000,000)	20.1017	804,068,000
2021092303294	B	USDMXN	09/27/2021	1,514,561	20.0035	(30,296,521)
2021092403041	B	USDMXN	09/27/2021	18,485,439	20.10528	(371,655,001)
2021092703157	S	USDMXN	09/27/2021	(5,494,536)	20.09567	110,416,375
2021062403460	B	USDMXN	09/28/2021	30,000,000	20.082	(602,460,000)
2021092403062	B	USDMXN	09/28/2021	30,000,000	20.13	(603,900,000)
2021092403042	S	USDMXN	09/28/2021	(18,485,439)	20.1081	371,707,056
2021092403064	S	USDMXN	09/28/2021	(15,000,000)	20.13	301,950,000
2021092403216	S	USDMXN	09/28/2021	(10,000,000)	20.112	201,120,000
2021092703158	B	USDMXN	09/28/2021	5,494,536	20.0986	(110,432,496)
2021092703000	S	USDMXN	09/28/2021	(16,514,561)	20.09595	331,875,744
2021092803059	S	USDMXN	09/28/2021	(13,494,536)	20.31045	274,080,150
2021092703001	B	USDMXN	09/29/2021	16,514,561	20.0988	(331,922,859)
2021092703127	S	USDMXN	09/29/2021	(20,000,000)	20.113	402,260,000
2021092803004	B	USDMXN	09/29/2021	10,863,210	20.23299	(219,795,238)
2021092803060	B	USDMXN	09/29/2021	13,494,536	20.31361	(274,122,697)
2021092903445	B	USDMXN	09/29/2021	1,800,000	20.61	(37,098,000)
2021092803291	B	USDMXN	09/30/2021	14,000,000	20.34	(284,760,000)
2021092803005	S	USDMXN	09/30/2021	(10,863,210)	20.236	219,827,908
2021092803425	S	USDMXN	09/30/2021	(15,000,000)	20.347	305,205,000
2021092903006	B	USDMXN	09/30/2021	89,949	20.39964	(1,834,922)
2021092903008	B	USDMXN	09/30/2021	21,500,000	20.404	(438,686,000)
2021092903446	S	USDMXN	09/30/2021	(1,800,000)	20.6127	37,102,860

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021071403210	USD	35,000,000	MXN	697,200,000	15-JUL-21	19.92
2021071303316	MXN	1,931,208	USD	95,000	13-JUL-21	20.33
2021071403099	MXN	1,002,725,000	USD	50,000,000	15-SEP-21	20.05
2021071403260	MXN	1,809,270	USD	90,000	09-AUG-21	20.10
2021021103208	MXN	4,740,152	USD	233,000	23-JUL-21	20.34
2021021103211	MXN	6,217,706	USD	306,000	12-JUL-21	20.32
2021082703447	USD	126,000	MXN	2,535,246	07-SEP-21	20.12
2021062103237	USD	41,512	MXN	856,179	12-JUL-21	20.63
2021041603218	MXN	604,425	USD	30,000	15-JUL-21	20.15
2021041603209	MXN	608,850	USD	30,000	15-SEP-21	20.30
2021041603212	MXN	607,425	USD	30,000	26-AUG-21	20.25
2021080203376	MXN	697	USD	35	04-AUG-21	19.90
2021070203467	MXN	11,946,600	USD	600,000	26-AUG-21	19.91
2021090703323	MXN	860,559	USD	43,000	14-SEP-21	20.01
2021080203476	EUR	2,300,000	MXN	54,280,000	03-AUG-21	23.60
2021070203419	MXN	4,971,750	USD	250,000	09-AUG-21	19.89
2021042103459	MXN	2,022,100	USD	100,000	19-AUG-21	20.22
2021061703025	USD	175,000	MXN	3,640,368	15-JUL-21	20.80
2021052703058	MXN	3,522,838	USD	175,000	30-JUL-21	20.13
2021070503093	MXN	45,213,568	USD	1,967,561	07-JUL-21	22.98
2021042103658	MXN	6,363,000	USD	315,000	22-SEP-21	20.20
2021042103661	MXN	6,363,000	USD	315,000	01-SEP-21	20.20
2021042103662	MXN	6,363,000	USD	315,000	25-AUG-21	20.20
2021042103660	MXN	6,363,000	USD	315,000	08-SEP-21	20.20
2021042103659	MXN	6,363,000	USD	315,000	15-SEP-21	20.20
2021042103663	MXN	6,363,000	USD	315,000	18-AUG-21	20.20
2021042103657	MXN	6,363,000	USD	315,000	29-SEP-21	20.20
2021080603112	MXN	400	USD	20	06-AUG-21	20.02
2021081603132	USD	100,000	MXN	1,987,700	16-AUG-21	19.88
2021081603133	USD	100,000	MXN	1,987,700	16-AUG-21	19.88
2021080603116	MXN	400	USD	20	06-AUG-21	20.02
2021080603119	MXN	400	USD	20	06-AUG-21	20.02
2021072303045	USD	837,400	MXN	16,754,448	23-JUL-21	20.01
2021052703158	MXN	3,009,600	USD	150,000	06-AUG-21	20.06
2021052703156	MXN	1,003,200	USD	50,000	06-AUG-21	20.06
2021052703157	MXN	3,009,600	USD	150,000	06-AUG-21	20.06
2021091003259	USD	146,500	MXN	2,906,267	10-SEP-21	19.84
2021041503709	MXN	4,041,900	USD	200,000	26-JUL-21	20.21
2021062503256	MXN	3,990,200	USD	200,000	03-SEP-21	19.95
2021081203429	MXN	3,983,800	USD	200,000	02-SEP-21	19.92
2021062103170	USD	230,996	MXN	4,773,987	14-JUL-21	20.67
2021081203437	MXN	3,987,600	USD	200,000	09-SEP-21	19.94
2021081203431	MXN	3,995,300	USD	200,000	23-SEP-21	19.98
2021090703322	MXN	411,035	USD	20,500	28-SEP-21	20.05
2021062503297	MXN	7,939,000	USD	400,000	22-JUL-21	19.85
2021060703303	MXN	600,825	USD	30,000	15-SEP-21	20.03
2021060703309	MXN	597,525	USD	30,000	29-JUL-21	19.92
2021060703306	MXN	599,430	USD	30,000	26-AUG-21	19.98
2021061003145	USD	54,343	MXN	1,072,724	07-JUL-21	19.74
2021060703302	MXN	601,395	USD	30,000	23-SEP-21	20.05
2021061703033	USD	175,000	MXN	3,640,368	13-AUG-21	20.80
2021012603517	MXN	1,925,578	USD	94,276	15-SEP-21	20.42
2021092003097	USD	100,000	MXN	2,010,970	20-SEP-21	20.11
2021092403117	USD	100,000	MXN	2,008,000	24-SEP-21	20.08
2021060703146	MXN	9,950,750	USD	500,000	22-JUL-21	19.90
2021060703150	MXN	9,970,750	USD	500,000	22-JUL-21	19.94
2021083003469	MXN	647,648	USD	32,000	21-SEP-21	20.24
2021021503135	MXN	3,041,880	USD	150,000	11-AUG-21	20.28
2021083003468	MXN	101,288	USD	5,000	28-SEP-21	20.26
2021021503136	MXN	4,045,820	USD	200,000	19-JUL-21	20.23

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021062403200	MXN	2,039,000	USD	100,000	27-AUG-21	20.39
2021090803223	USD	500,000	MXN	9,972,500	10-SEP-21	19.95
2021083003483	MXN	443,147	USD	21,900	22-SEP-21	20.24
2021062403201	MXN	3,058,500	USD	150,000	27-AUG-21	20.39
2021081203262	MXN	3,019,800	USD	150,000	12-AUG-21	20.13
2021021503134	MXN	4,071,480	USD	200,000	15-SEP-21	20.36
2021060703311	MXN	596,595	USD	30,000	15-JUL-21	19.89
2021060703465	MXN	598,950	USD	30,000	19-AUG-21	19.97
2021041503232	MXN	607,605	USD	30,000	05-AUG-21	20.25
2021041503233	MXN	607,095	USD	30,000	29-JUL-21	20.24
2021060703301	MXN	601,890	USD	30,000	30-SEP-21	20.06
2021041503224	MXN	610,095	USD	30,000	09-SEP-21	20.34
2021041503235	MXN	606,105	USD	30,000	15-JUL-21	20.20
2021060703305	MXN	599,910	USD	30,000	02-SEP-21	20.00
2021060703308	MXN	597,990	USD	30,000	05-AUG-21	19.93
2021072903070	MXN	6,014,640	USD	300,000	29-SEP-21	20.05
2021042103666	MXN	6,363,000	USD	315,000	28-JUL-21	20.20
2021042103667	MXN	6,363,000	USD	315,000	21-JUL-21	20.20
2021042103664	MXN	6,363,000	USD	315,000	11-AUG-21	20.20
2021042103665	MXN	6,363,000	USD	315,000	04-AUG-21	20.20
2021042103669	MXN	6,363,000	USD	315,000	07-JUL-21	20.20
2021042103668	MXN	6,363,000	USD	315,000	14-JUL-21	20.20
2021072903074	MXN	5,990,490	USD	300,000	31-AUG-21	19.97
2021092003303	USD	150,000	MXN	3,013,650	28-SEP-21	20.09
2021092003309	USD	106,000	MXN	2,129,434	27-SEP-21	20.09
2021083003659	MXN	941,466	USD	46,444	29-SEP-21	20.27
2021072203124	USD	175,000	MXN	3,533,250	30-JUL-21	20.19
2021081303092	USD	150,000	MXN	2,977,710	13-AUG-21	19.85
2021031203231	MXN	52,755,000	USD	2,500,000	03-AUG-21	21.10
2021081903180	USD	138,805	MXN	2,795,259	01-SEP-21	20.14
2021062503484	USD	58,144	MXN	1,155,603	09-JUL-21	19.88
2021072203133	USD	175,000	MXN	3,533,250	30-JUL-21	20.19
2021062103316	MXN	175,562	USD	8,473	10-AUG-21	20.72
2021092703207	USD	300,000	MXN	6,023,640	29-SEP-21	20.08
2021090303626	USD	4,300,000	MXN	85,763,500	07-SEP-21	19.95
2021081703579	MXN	821,916	USD	40,800	08-SEP-21	20.15
2021070603431	MXN	674,573	USD	33,500	11-AUG-21	20.14
2021070103155	USD	1,000,000	MXN	19,998,000	15-JUL-21	20.00
2021061103188	MXN	1,984,100	USD	100,000	20-AUG-21	19.84
2021030903081	MXN	540,750	USD	25,000	06-AUG-21	21.63
2021061103189	MXN	2,976,150	USD	150,000	20-AUG-21	19.84
2021081203521	MXN	399	USD	20	12-AUG-21	19.94
2021071903024	MXN	99,670,000	USD	5,000,000	19-JUL-21	19.93
2021083103360	USD	2,050,000	MXN	41,205,000	31-AUG-21	20.10
2021061803129	USD	500,000	MXN	10,407,500	03-SEP-21	20.82
2021083103426	USD	300,000	MXN	6,017,250	31-AUG-21	20.06
2021062803215	MXN	797,152	USD	40,000	09-AUG-21	19.93
2021062803216	MXN	796,424	USD	40,000	02-AUG-21	19.91
2021062803217	MXN	795,700	USD	40,000	26-JUL-21	19.89
2021060703604	MXN	182,882	USD	9,154	13-JUL-21	19.98
2021062203343	MXN	2,064,300	USD	100,000	20-AUG-21	20.64
2021041603207	MXN	609,945	USD	30,000	30-SEP-21	20.33
2021041603214	MXN	606,405	USD	30,000	12-AUG-21	20.21
2021041603216	MXN	605,415	USD	30,000	29-JUL-21	20.18
2021041603219	MXN	603,975	USD	30,000	08-JUL-21	20.13
2021062103317	MXN	195,061	USD	9,446	13-JUL-21	20.65
2021060103051	MXN	999,500,000	USD	50,000,000	02-AUG-21	19.99
2021020403651	MXN	39,072,513	USD	1,873,622	15-SEP-21	20.85
2021020403652	MXN	42,579,030	USD	2,041,768	18-AUG-21	20.85
2021020403653	MXN	55,004,719	USD	2,637,610	14-JUL-21	20.85

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021030903079	MXN	540,750	USD	25,000	20-AUG-21	21.63
2021091303413	USD	50,000	MXN	1,005,070	13-SEP-21	20.10
2021060203366	MXN	5,016,500	USD	250,000	05-AUG-21	20.07
2021060203367	MXN	5,012,500	USD	250,000	29-JUL-21	20.05
2021042103806	MXN	343,400	USD	17,000	08-SEP-21	20.20
2021042103808	MXN	343,400	USD	17,000	25-AUG-21	20.20
2021042103815	MXN	343,400	USD	17,000	07-JUL-21	20.20
2021042103812	MXN	343,400	USD	17,000	28-JUL-21	20.20
2021071503265	USD	365,000	MXN	7,272,625	15-JUL-21	19.93
2021042103803	MXN	343,400	USD	17,000	29-SEP-21	20.20
2021071903034	MXN	59,802,000	USD	3,000,000	19-JUL-21	19.93
2021042103813	MXN	343,400	USD	17,000	21-JUL-21	20.20
2021042103804	MXN	343,400	USD	17,000	22-SEP-21	20.20
2021042103805	MXN	343,400	USD	17,000	15-SEP-21	20.20
2021042103807	MXN	343,400	USD	17,000	01-SEP-21	20.20
2021042103814	MXN	343,400	USD	17,000	14-JUL-21	20.20
2021042103811	MXN	343,400	USD	17,000	04-AUG-21	20.20
2021042103809	MXN	343,400	USD	17,000	18-AUG-21	20.20
2021042103810	MXN	343,400	USD	17,000	11-AUG-21	20.20
2021052803619	MXN	222,680	USD	11,038	15-SEP-21	20.17
2021052803621	MXN	218,947	USD	10,853	14-JUL-21	20.17
2021052803620	MXN	219,936	USD	10,902	18-AUG-21	20.17
2021062803218	MXN	794,984	USD	40,000	19-JUL-21	19.87
2021062803219	MXN	794,276	USD	40,000	12-JUL-21	19.86
2021070103268	MXN	875,791	USD	43,550	04-AUG-21	20.11
2021062803214	MXN	797,848	USD	40,000	16-AUG-21	19.95
2021080603267	USD	97,000	MXN	1,933,404	16-AUG-21	19.93
2021071503079	MXN	923,408	USD	45,952	15-JUL-21	20.10
2021071503075	MXN	2,918,923	USD	145,256	15-JUL-21	20.10
2021062803213	MXN	798,528	USD	40,000	23-AUG-21	19.96
2021070803506	USD	126,000	MXN	2,509,668	26-JUL-21	19.92
2021080603271	USD	101,000	MXN	2,013,334	17-AUG-21	19.93
2021070803499	USD	163,000	MXN	3,245,330	22-JUL-21	19.91
2021070903460	USD	136,200	MXN	2,703,570	09-JUL-21	19.85
2021070903608	USD	100,000	MXN	1,984,000	12-JUL-21	19.84
2021070903555	USD	50,000	MXN	1,016,625	09-JUL-21	20.33
2021071603163	USD	56,292	MXN	1,117,387	02-AUG-21	19.85
2021080603277	USD	153,000	MXN	3,050,514	19-AUG-21	19.94
2021091403242	USD	50,000,000	MXN	995,000,000	15-SEP-21	19.90
2021042203359	MXN	19,852,235	USD	975,559	15-SEP-21	20.35
2021042203361	MXN	19,520,842	USD	959,274	14-JUL-21	20.35
2021042203360	MXN	19,608,162	USD	963,565	18-AUG-21	20.35
2021080603497	MXN	432,494	USD	21,400	15-SEP-21	20.21
2021060803093	MXN	20,005,500	USD	1,000,000	14-SEP-21	20.01
2021062403296	MXN	6,022,500	USD	300,000	15-JUL-21	20.08
2021071903079	USD	5,000,000	MXN	100,280,500	21-JUL-21	20.06
2021071603177	MXN	2,001,800	USD	100,000	17-SEP-21	20.02
2021082603474	MXN	320,380	USD	15,705	09-SEP-21	20.40
2021072903302	MXN	1,181,419	USD	58,792	29-JUL-21	20.10
2021071603178	MXN	2,001,800	USD	100,000	17-SEP-21	20.02
2021052403207	MXN	20,044,300	USD	1,000,000	15-JUL-21	20.04
2021052403416	MXN	4,996,460	USD	249,200	30-JUL-21	20.05
2021052403383	MXN	4,024,400	USD	200,000	06-AUG-21	20.12
2021021203509	MXN	2,302,517	USD	113,207	15-SEP-21	20.34
2021091403449	USD	500,000	MXN	9,947,500	14-SEP-21	19.90
2021061003178	USD	115,798	MXN	2,286,207	12-JUL-21	19.74
2021091503100	USD	100,000	MXN	1,990,000	15-SEP-21	19.90
2021021203511	MXN	2,270,015	USD	111,609	14-JUL-21	20.34
2021092003219	USD	300,000	MXN	6,040,260	22-SEP-21	20.13
2021092003338	USD	137,000	MXN	2,751,097	24-SEP-21	20.08

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021092003305	USD	37,000	MXN	743,367	28-SEP-21	20.09
2021082703450	USD	60,000	MXN	1,207,260	07-SEP-21	20.12
2021092003307	USD	63,000	MXN	1,265,607	27-SEP-21	20.09
2021071603450	USD	837,400	MXN	16,605,642	16-JUL-21	19.83
2021092103543	USD	22,400,596	MXN	450,700,000	23-SEP-21	20.12
2021081303438	MXN	618,041	USD	30,950	01-SEP-21	19.97
2021060203110	MXN	1,004,750	USD	50,000	06-AUG-21	20.10
2021060203112	MXN	4,019,000	USD	200,000	06-AUG-21	20.10
2021091403181	USD	250,000	MXN	4,970,500	15-SEP-21	19.88
2021060203277	MXN	5,997,431	USD	299,400	30-JUL-21	20.03
2021071503580	MXN	10,216,850	USD	500,000	19-JUL-21	20.43
2021090803389	USD	300,000	MXN	5,973,600	08-SEP-21	19.91
2021042303335	MXN	4,135,492	USD	203,772	15-SEP-21	20.29
2021042303336	MXN	4,084,653	USD	201,267	18-AUG-21	20.29
2021042303337	MXN	4,066,469	USD	200,371	14-JUL-21	20.29
2021061403336	MXN	408,180	USD	20,350	14-JUL-21	20.06
2021071903192	USD	25,000,000	MXN	500,000,000	21-JUL-21	20.00
2021062803416	USD	156,000	MXN	3,083,496	16-JUL-21	19.77
2021093003151	USD	93,750	MXN	1,921,003	30-SEP-21	20.49
2021041503533	MXN	1,016,500	USD	50,000	17-SEP-21	20.33
2021042303408	MXN	1,506,075	USD	75,000	30-JUL-21	20.08
2021060203111	MXN	2,009,500	USD	100,000	06-AUG-21	20.10
2021062803417	USD	150,000	MXN	2,964,900	16-JUL-21	19.77
2021070703360	USD	50,000	MXN	1,017,100	07-JUL-21	20.34
2021062203342	MXN	2,064,300	USD	100,000	20-AUG-21	20.64
2021042603412	MXN	2,615,080	USD	130,000	06-AUG-21	20.12
2021062203344	MXN	2,064,300	USD	100,000	20-AUG-21	20.64
2021060203276	MXN	5,994,715	USD	298,200	31-AUG-21	20.10
2021083103361	USD	141,855	MXN	2,853,419	10-SEP-21	20.12
2021091503275	MXN	692	USD	35	17-SEP-21	19.89
2021060203365	MXN	5,020,375	USD	250,000	12-AUG-21	20.08
2021071603544	MXN	9,985,000	USD	500,000	16-AUG-21	19.97
2021080603266	USD	158,000	MXN	3,149,256	16-AUG-21	19.93
2021080603272	USD	118,000	MXN	2,352,212	17-AUG-21	19.93
2021040803648	MXN	6,878,588	USD	337,500	12-JUL-21	20.38
2021080603295	USD	126,000	MXN	2,512,440	20-AUG-21	19.94
2021080203473	MXN	49,774,250	USD	2,500,000	10-AUG-21	19.91
2021080203477	MXN	54,460,550	EUR	2,300,000	24-AUG-21	23.68
2021080203409	USD	70,000	MXN	1,390,921	02-AUG-21	19.87
2021041603210	MXN	608,415	USD	30,000	09-SEP-21	20.28
2021041603213	MXN	606,915	USD	30,000	19-AUG-21	20.23
2021092003151	USD	118,000	MXN	2,370,502	27-SEP-21	20.09
2021072903071	MXN	6,008,790	USD	300,000	22-SEP-21	20.03
2021072903111	USD	249,182	MXN	4,950,000	20-AUG-21	19.87
2021080503074	MXN	1,507,350	USD	75,000	05-AUG-21	20.10
2021042303305	MXN	2,005,600	USD	100,000	23-JUL-21	20.06
2021042303306	MXN	1,002,000	USD	50,000	16-JUL-21	20.04
2021042303246	MXN	10,030,250	USD	500,000	22-JUL-21	20.06
2021092003152	USD	138,000	MXN	2,772,282	27-SEP-21	20.09
2021092003153	USD	152,000	MXN	3,053,528	27-SEP-21	20.09
2021080603331	USD	114,000	MXN	2,273,844	23-AUG-21	19.95
2021081903358	MXN	705	USD	35	20-AUG-21	20.15
2021080603246	USD	147,000	MXN	2,929,122	13-AUG-21	19.93
2021062403563	MXN	2,010,100	USD	100,000	03-SEP-21	20.10
2021081303213	MXN	5,997,690	USD	300,000	30-SEP-21	19.99
2021081303214	MXN	5,997,690	USD	300,000	23-SEP-21	19.99
2021080603273	USD	102,000	MXN	2,033,268	17-AUG-21	19.93
2021080203101	USD	89,029	MXN	1,762,951	02-AUG-21	19.80
2021051203341	MXN	1,014,520	USD	50,000	27-AUG-21	20.29
2021051203342	MXN	1,014,520	USD	50,000	20-AUG-21	20.29

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021051203343	MXN	1,014,520	USD	50,000	13-AUG-21	20.29
2021051203344	MXN	1,014,520	USD	50,000	06-AUG-21	20.29
2021051203345	MXN	1,014,520	USD	50,000	30-JUL-21	20.29
2021051203346	MXN	1,014,520	USD	50,000	23-JUL-21	20.29
2021051203347	MXN	1,014,520	USD	50,000	16-JUL-21	20.29
2021051203348	MXN	1,014,520	USD	50,000	09-JUL-21	20.29
2021042303521	MXN	2,870,664	USD	141,442	14-JUL-21	20.30
2021042303520	MXN	2,883,491	USD	142,074	18-AUG-21	20.30
2021081903421	MXN	404	USD	20	20-AUG-21	20.19
2021090103061	MXN	11,029,150	USD	550,000	09-SEP-21	20.05
2021042303519	MXN	2,919,394	USD	143,843	15-SEP-21	20.30
2021041503721	MXN	5,073,000	USD	250,000	13-AUG-21	20.29
2021081303175	MXN	3,979,600	USD	200,000	30-AUG-21	19.90
2021062403576	MXN	8,003,600	USD	400,000	05-AUG-21	20.01
2021060303564	MXN	463,284	USD	22,850	07-JUL-21	20.28
2021062403505	MXN	1,302,178	USD	65,000	19-JUL-21	20.03
2021072003205	USD	1,000,000	MXN	20,181,000	16-AUG-21	20.18
2021081903493	USD	125,000	MXN	2,511,500	03-SEP-21	20.09
2021060803477	MXN	19,873,000	USD	1,000,000	29-JUL-21	19.87
2021081903478	USD	111,000	MXN	2,228,658	27-AUG-21	20.08
2021080603330	USD	110,000	MXN	2,194,060	23-AUG-21	19.95
2021081303330	MXN	1,000,250	USD	50,000	21-SEP-21	20.01
2021060403385	MXN	1,369,158	USD	68,134	20-JUL-21	20.10
2021060403383	MXN	583,812	USD	28,983	10-AUG-21	20.14
2021091503581	MXN	397	USD	20	17-SEP-21	19.85
2021060403384	MXN	1,411,374	USD	70,123	03-AUG-21	20.13
2021060403468	USD	139,080	MXN	2,782,426	07-JUL-21	20.01
2021081903499	USD	100,000	MXN	2,026,500	30-SEP-21	20.27
2021060403668	MXN	20,230,000	USD	1,000,000	15-JUL-21	20.23
2021072003398	USD	162,000	MXN	3,247,144	02-AUG-21	20.04
2021072003387	USD	103,000	MXN	2,063,657	30-JUL-21	20.04
2021072003427	USD	106,000	MXN	2,125,289	04-AUG-21	20.05
2021012603530	MXN	1,898,392	USD	92,945	14-JUL-21	20.42
2021062503119	USD	151,477	MXN	3,000,000	08-JUL-21	19.81
2021060903284	MXN	3,976,600	USD	200,000	20-AUG-21	19.88
2021060903158	MXN	19,852,000	USD	1,000,000	26-AUG-21	19.85
2021080603316	USD	134,150	MXN	2,685,388	06-AUG-21	20.02
2021042603411	MXN	1,308,580	USD	65,000	13-AUG-21	20.13
2021080503150	MXN	399	USD	20	05-AUG-21	19.93
2021072703519	MXN	441,810	USD	21,950	01-SEP-21	20.13
2021060703148	MXN	9,945,500	USD	500,000	08-JUL-21	19.89
2021060703157	MXN	40,000,000	USD	1,997,204	27-SEP-21	20.03
2021060703312	MXN	596,145	USD	30,000	08-JUL-21	19.87
2021092303054	MXN	3,998,300	USD	200,000	23-SEP-21	19.99
2021051003486	MXN	606,570	USD	30,000	30-SEP-21	20.22
2021051003494	MXN	602,610	USD	30,000	05-AUG-21	20.09
2021051003497	MXN	601,155	USD	30,000	15-JUL-21	20.04
2021051003498	MXN	600,675	USD	30,000	08-JUL-21	20.02
2021092103770	MXN	3,744,952	USD	184,000	21-SEP-21	20.35
2021060803094	MXN	3,997,800	USD	200,000	07-SEP-21	19.99
2021041503725	MXN	5,085,750	USD	250,000	03-SEP-21	20.34
2021082003082	MXN	7,034,456	USD	344,000	20-AUG-21	20.45
2021041503722	MXN	5,068,750	USD	250,000	06-AUG-21	20.28
2021060703147	MXN	9,943,000	USD	500,000	15-JUL-21	19.89
2021060703151	MXN	9,973,000	USD	500,000	15-JUL-21	19.95
2021060803396	MXN	3,509,153	USD	175,000	30-JUL-21	20.05
2021060803520	MXN	19,874,000	USD	1,000,000	12-AUG-21	19.87
2021060703705	MXN	3,358,343	USD	167,115	31-AUG-21	20.10
2021060703304	MXN	600,390	USD	30,000	09-SEP-21	20.01
2021060703307	MXN	598,455	USD	30,000	12-AUG-21	19.95

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021060703310	MXN	597,060	USD	30,000	22-JUL-21	19.90
2021092303066	MXN	5,052,500	USD	250,000	23-SEP-21	20.21
2021071603179	MXN	2,001,800	USD	100,000	17-SEP-21	20.02
2021071603180	MXN	4,003,600	USD	200,000	17-SEP-21	20.02
2021070903182	MXN	2,018,210	USD	100,000	16-AUG-21	20.18
2021071603209	MXN	2,011,940	USD	100,000	16-AUG-21	20.12
2021061503170	MXN	1,012,700	USD	50,000	03-AUG-21	20.25
2021060803476	MXN	19,868,000	USD	1,000,000	05-AUG-21	19.87
2021021203510	MXN	2,297,778	USD	112,974	18-AUG-21	20.34
2021030303360	MXN	430,653	USD	20,127	14-JUL-21	21.40
2021030303359	MXN	436,003	USD	20,377	18-AUG-21	21.40
2021092803245	MXN	6,022,350	USD	300,000	28-SEP-21	20.07
2021092803161	USD	100,000	MXN	2,025,000	28-SEP-21	20.25
2021092803479	MXN	2,002,240	USD	100,000	28-SEP-21	20.02
2021022203008	USD	300,000	MXN	6,315,660	27-SEP-21	21.05
2021022203036	USD	50,000	MXN	1,054,000	28-JUL-21	21.08
2021022203039	USD	50,000	MXN	1,061,000	28-SEP-21	21.22
2021022203038	USD	50,000	MXN	1,056,425	19-AUG-21	21.13
2021080203411	USD	100,000	MXN	1,987,030	02-AUG-21	19.87
2021061603152	USD	200,929	MXN	4,044,910	19-JUL-21	20.13
2021072103375	MXN	404	USD	20	22-JUL-21	20.19
2021072103377	MXN	404	USD	20	22-JUL-21	20.19
2021062403562	MXN	2,010,100	USD	100,000	03-SEP-21	20.10
2021080203472	USD	2,500,000	MXN	49,725,000	03-AUG-21	19.89
2021031603549	MXN	4,826,665	USD	230,000	17-AUG-21	20.99
2021031703433	MXN	90,063,500	USD	4,300,000	07-SEP-21	20.95
2021062903339	MXN	513,944	USD	25,750	04-AUG-21	19.96
2021062903438	MXN	466,183	USD	23,350	04-AUG-21	19.97
2021093003260	USD	67,735	MXN	1,385,480	30-SEP-21	20.45
2021041503719	MXN	5,081,500	USD	250,000	27-AUG-21	20.33
2021062803212	MXN	799,208	USD	40,000	30-AUG-21	19.98
2021062803409	USD	120,825	MXN	2,396,207	12-JUL-21	19.83
2021062803240	USD	121,627	MXN	2,411,993	09-JUL-21	19.83
2021062803415	USD	183,000	MXN	3,618,551	19-JUL-21	19.77
2021031803613	MXN	92,000,000	USD	4,422,652	20-AUG-21	20.80
2021072203439	MXN	402	USD	20	23-JUL-21	20.09
2021062903681	MXN	1,469,508	USD	73,529	10-AUG-21	19.99
2021032403088	MXN	1,847,008	USD	87,195	14-JUL-21	21.18
2021062903669	USD	297,823	MXN	5,913,275	21-JUL-21	19.86
2021062903679	MXN	728,711	USD	36,338	07-SEP-21	20.05
2021081603286	USD	50,000	MXN	1,020,000	16-AUG-21	20.40
2021032403087	MXN	1,713,389	USD	80,887	18-AUG-21	21.18
2021081603240	MXN	547,821	USD	27,350	08-SEP-21	20.03
2021092303269	USD	2,498,126	MXN	50,000,000	27-SEP-21	20.02
2021072303267	MXN	712,884	USD	35,300	25-AUG-21	20.20
2021092203105	MXN	697	USD	35	24-SEP-21	20.04
2021093003411	MXN	2,112,047	USD	99,800	30-SEP-21	21.16
2021041503744	MXN	5,098,250	USD	250,000	24-SEP-21	20.39
2021061703582	MXN	423,989	USD	20,600	21-JUL-21	20.58
2021061703479	MXN	1,154,854	USD	56,200	21-JUL-21	20.55
2021061703028	USD	125,000	MXN	2,600,263	30-JUL-21	20.80
2021061703036	USD	125,000	MXN	2,600,263	30-AUG-21	20.80
2021061703040	USD	175,000	MXN	3,640,368	15-SEP-21	20.80
2021061703042	USD	125,000	MXN	2,600,263	30-SEP-21	20.80
2021072703088	MXN	1,592,390	USD	76,000	27-JUL-21	20.95
2021071903396	USD	56,242	MXN	1,127,932	02-AUG-21	20.06
2021081703458	MXN	422,180	USD	20,900	29-SEP-21	20.20
2021092203183	USD	400,000	MXN	8,068,400	22-SEP-21	20.17
2021070903479	MXN	793,960	USD	39,700	11-AUG-21	20.00
2021070803231	MXN	10,208,650	USD	500,000	12-JUL-21	20.42

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021071603220	MXN	397	USD	20	16-JUL-21	19.84
2021070903461	USD	995,000	MXN	19,750,750	09-JUL-21	19.85
2021071503021	USD	240,370	MXN	4,798,987	03-AUG-21	19.97
2021040603249	MXN	618,030	USD	30,000	09-SEP-21	20.60
2021040603252	MXN	616,530	USD	30,000	19-AUG-21	20.55
2021040603256	MXN	614,535	USD	30,000	22-JUL-21	20.48
2021040603258	MXN	613,530	USD	30,000	08-JUL-21	20.45
2021082303313	MXN	549,044	USD	26,942	10-SEP-21	20.38
2021040603246	MXN	619,530	USD	30,000	30-SEP-21	20.65
2021040603247	MXN	619,035	USD	30,000	23-SEP-21	20.63
2021040603759	MXN	34,807,500	USD	1,700,000	03-AUG-21	20.48
2021071603289	USD	224,937	MXN	4,472,413	09-AUG-21	19.88
2021040603426	MXN	1,359,953	USD	66,406	27-AUG-21	20.48
2021072103422	MXN	487,335	USD	23,950	25-AUG-21	20.35
2021072103371	MXN	404	USD	20	22-JUL-21	20.19
2021072003388	USD	163,000	MXN	3,265,314	29-JUL-21	20.03
2021040903239	MXN	6,348,070	USD	311,000	30-JUL-21	20.41
2021072003390	USD	126,000	MXN	2,523,415	27-JUL-21	20.03
2021040603429	MXN	1,639,181	USD	80,435	16-JUL-21	20.38
2021040603250	MXN	617,535	USD	30,000	02-SEP-21	20.58
2021040603428	MXN	13,597,359	USD	666,668	23-JUL-21	20.40
2021040603253	MXN	616,035	USD	30,000	12-AUG-21	20.53
2021040603257	MXN	614,025	USD	30,000	15-JUL-21	20.47
2021072703517	USD	50,000	MXN	1,017,600	27-JUL-21	20.35
2021061103187	MXN	1,984,100	USD	100,000	20-AUG-21	19.84
2021061103190	MXN	2,976,150	USD	150,000	20-AUG-21	19.84
2021072203442	MXN	10,216,850	USD	500,000	26-JUL-21	20.43
2021040603754	MXN	20,555,000	USD	1,000,000	07-SEP-21	20.56
2021040603758	MXN	6,142,500	USD	300,000	03-AUG-21	20.48
2021072803153	MXN	6,042,000	USD	300,000	30-SEP-21	20.14
2021041603485	MXN	502,830,000	USD	25,000,000	21-JUL-21	20.11
2021090103455	MXN	6,010,800	USD	300,000	21-SEP-21	20.04
2021061703742	USD	50,000	MXN	1,025,650	02-SEP-21	20.51
2021092903197	USD	93,750	MXN	1,917,188	30-SEP-21	20.45
2021092903226	MXN	1,995,440	USD	100,000	29-SEP-21	19.95
2021061803419	USD	7,224	MXN	150,000	23-JUL-21	20.76
2021061603483	USD	125,000	MXN	2,560,113	30-JUL-21	20.48
2021061603487	USD	175,000	MXN	3,584,158	13-AUG-21	20.48
2021061603488	USD	125,000	MXN	2,560,113	30-AUG-21	20.48
2021061603489	USD	175,000	MXN	3,584,158	15-SEP-21	20.48
2021092903581	MXN	1,428,894	USD	67,500	29-SEP-21	21.17
2021061603468	USD	175,000	MXN	3,584,158	15-JUL-21	20.48
2021061603577	USD	36,000	MXN	729,540	30-JUL-21	20.27
2021041503745	MXN	5,094,000	USD	250,000	17-SEP-21	20.38
2021081703321	MXN	5,985,000	USD	300,000	17-AUG-21	19.95
2021081803278	MXN	697	USD	35	20-AUG-21	20.02
2021081803284	MXN	346,563	USD	17,200	21-SEP-21	20.15
2021042703591	MXN	5,964,524	USD	291,012	15-SEP-21	20.50
2021042703592	MXN	5,891,190	USD	287,434	18-AUG-21	20.50
2021042703593	MXN	5,864,955	USD	286,154	14-JUL-21	20.50
2021061603492	USD	125,000	MXN	2,560,113	30-SEP-21	20.48
2021093003494	USD	100,000	MXN	2,056,190	30-SEP-21	20.56
2021092903520	USD	2,050,000	MXN	42,074,200	30-SEP-21	20.52
2021072603353	USD	60,151	MXN	1,204,642	10-AUG-21	20.03
2021072603364	USD	200,000	MXN	4,000,000	26-JUL-21	20.00
2021060903159	MXN	19,856,000	USD	1,000,000	19-AUG-21	19.86
2021060903109	MXN	5,914,350	USD	300,000	12-JUL-21	19.71
2021072603539	MXN	401,169	USD	19,850	31-AUG-21	20.21
2021040603254	MXN	615,540	USD	30,000	05-AUG-21	20.52
2021040603255	MXN	615,030	USD	30,000	29-JUL-21	20.50

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021062903678	MXN	1,707,650	USD	85,000	21-SEP-21	20.09
2021062903680	MXN	705,219	USD	35,227	24-AUG-21	20.02
2021061803643	USD	150,000	MXN	3,124,650	30-SEP-21	20.83
2021040603248	MXN	618,465	USD	30,000	15-SEP-21	20.62
2021040603251	MXN	617,025	USD	30,000	26-AUG-21	20.57
2021022503764	MXN	21,233,000	USD	1,000,000	07-JUL-21	21.23
2021062503212	MXN	6,958,700	USD	350,000	28-JUL-21	19.88
2021062503255	MXN	1,995,100	USD	100,000	03-SEP-21	19.95
2021062503257	MXN	1,995,100	USD	100,000	03-SEP-21	19.95
2021062503284	MXN	9,938,500	USD	500,000	12-AUG-21	19.88
2021062503285	MXN	9,939,500	USD	500,000	05-AUG-21	19.88
2021062503242	MXN	3,009,600	USD	150,000	30-SEP-21	20.06
2021091503556	USD	100,000	MXN	1,982,500	15-SEP-21	19.83
2021060903562	MXN	1,255,468	USD	63,200	14-JUL-21	19.87
2021072703086	MXN	1,676,200	USD	80,000	27-JUL-21	20.95
2021022603342	MXN	6,446,730	USD	300,000	27-SEP-21	21.49
2021092903225	MXN	3,487,628	USD	175,000	29-SEP-21	19.93
2021061503171	MXN	1,011,125	USD	50,000	20-JUL-21	20.22
2021030503577	MXN	21,756,000	USD	1,000,000	20-AUG-21	21.76
2021062303226	MXN	4,089,000	USD	200,000	27-AUG-21	20.45
2021062403199	MXN	2,039,000	USD	100,000	27-AUG-21	20.39
2021062403202	MXN	3,058,500	USD	150,000	27-AUG-21	20.39
2021072703115	USD	149,963	MXN	3,000,000	18-AUG-21	20.01
2021062303224	MXN	3,066,750	USD	150,000	27-AUG-21	20.45
2021062303225	MXN	3,066,750	USD	150,000	27-AUG-21	20.45
2021062403434	MXN	5,974,650	USD	300,000	28-JUL-21	19.92
2021062403294	MXN	6,027,450	USD	300,000	22-JUL-21	20.09
2021062403300	MXN	421,031	USD	20,900	28-JUL-21	20.15
2021062403565	MXN	3,015,150	USD	150,000	03-SEP-21	20.10
2021062503254	MXN	1,995,100	USD	100,000	03-SEP-21	19.95
2021062503282	MXN	9,937,250	USD	500,000	26-AUG-21	19.87
2021062503283	MXN	9,938,000	USD	500,000	19-AUG-21	19.88
2021062503299	MXN	7,946,600	USD	400,000	29-JUL-21	19.87
2021062403564	MXN	3,015,150	USD	150,000	03-SEP-21	20.10
2021062503169	USD	227,944	MXN	4,522,413	23-JUL-21	19.84
2021062503129	USD	73,895	MXN	1,463,866	09-JUL-21	19.81
2021062503292	MXN	7,924,800	USD	400,000	08-JUL-21	19.81
2021061503512	MXN	876,494	USD	43,350	14-JUL-21	20.22
2021063003350	USD	113,004	MXN	2,261,207	06-AUG-21	20.01
2021063003357	MXN	1,135,400	USD	56,000	20-SEP-21	20.28
2021030303358	MXN	437,736	USD	20,458	15-SEP-21	21.40
2021070203554	MXN	999,150	USD	50,000	15-SEP-21	19.98
2021071503028	USD	1,300,000	MXN	25,906,400	15-JUL-21	19.93
2021070703269	USD	750,000	MXN	14,966,250	07-JUL-21	19.96
2021070703329	MXN	420,613	USD	20,900	11-AUG-21	20.13
2021070703319	USD	100,000	MXN	1,992,000	07-JUL-21	19.92
2021070703072	USD	250,000	MXN	5,010,250	08-JUL-21	20.04
2021061803496	USD	212,500	MXN	4,421,169	02-AUG-21	20.81
2021061803495	USD	357,500	MXN	7,464,958	01-SEP-21	20.88
2021062503025	MXN	4,956,500	USD	250,000	23-JUL-21	19.83
2021062503026	MXN	7,928,400	USD	400,000	21-JUL-21	19.82
2021062503027	MXN	5,944,500	USD	300,000	19-JUL-21	19.82
2021030903078	MXN	540,750	USD	25,000	27-AUG-21	21.63
2021030903080	MXN	540,750	USD	25,000	13-AUG-21	21.63
2021070703422	MXN	1,910,240	USD	94,000	07-JUL-21	20.32
2021070703516	MXN	40,090,000	USD	2,000,000	17-AUG-21	20.05
2021070803101	MXN	697	USD	35	09-JUL-21	20.03
2021070703511	MXN	401,195	USD	19,950	11-AUG-21	20.11
2021070803473	USD	130,000	MXN	2,587,520	19-JUL-21	19.90
2021070803484	USD	91,000	MXN	1,811,446	20-JUL-21	19.91

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021070703362	USD	50,000	MXN	1,000,150	07-JUL-21	20.00
2021063003358	MXN	1,135,400	USD	56,000	13-SEP-21	20.28
2021070803507	USD	164,000	MXN	3,266,552	26-JUL-21	19.92
2021070803412	USD	353,345	MXN	7,085,980	04-AUG-21	20.05
2021070803472	USD	183,000	MXN	3,642,798	20-JUL-21	19.91
2021031203232	MXN	42,204,000	USD	2,000,000	03-AUG-21	21.10
2021031203233	MXN	42,204,000	USD	2,000,000	03-AUG-21	21.10
2021070803498	USD	124,000	MXN	2,469,088	23-JUL-21	19.91
2021070903183	MXN	2,018,210	USD	100,000	15-SEP-21	20.18
2021063003156	USD	150,565	MXN	3,000,000	26-JUL-21	19.93
2021063003164	USD	219,488	MXN	4,380,331	02-AUG-21	19.96
2021031603548	MXN	4,826,665	USD	230,000	17-AUG-21	20.99
2021071203180	USD	306,000	MXN	6,061,248	12-JUL-21	19.81
2021071203252	MXN	9,954,250	USD	500,000	05-AUG-21	19.91
2021063003162	USD	150,557	MXN	3,000,000	27-JUL-21	19.93
2021063003166	USD	150,176	MXN	3,000,000	03-AUG-21	19.98
2021070203426	MXN	4,960,250	USD	250,000	21-JUL-21	19.84
2021070203465	MXN	11,915,400	USD	600,000	05-AUG-21	19.86
2021063003356	MXN	1,135,400	USD	56,000	27-SEP-21	20.28
2021070203555	MXN	995,050	USD	50,000	13-AUG-21	19.90
2021070203556	MXN	991,500	USD	50,000	15-JUL-21	19.83
2021072803154	MXN	6,036,300	USD	300,000	23-SEP-21	20.12
2021070203519	MXN	54,175,350	EUR	2,300,000	03-AUG-21	23.55
2021072803150	MXN	694	USD	35	30-JUL-21	19.94
2021070203466	MXN	11,937,000	USD	600,000	19-AUG-21	19.90
2021032403086	MXN	1,373,812	USD	64,856	15-SEP-21	21.18
2021072803309	MXN	1,999,800	USD	100,000	28-JUL-21	20.00
2021070903697	MXN	396,722	USD	19,850	11-AUG-21	19.99
2021072003059	USD	151,285	MXN	3,051,727	09-AUG-21	20.17
2021012603518	MXN	1,921,615	USD	94,082	18-AUG-21	20.42
2021040603427	MXN	6,722,463	USD	328,518	20-AUG-21	20.46
2021072203434	MXN	699	USD	35	23-JUL-21	20.09
2021072903167	USD	29,882	MXN	594,207	18-AUG-21	19.89
2021072903072	MXN	6,005,160	USD	300,000	15-SEP-21	20.02
2021072903073	MXN	5,997,060	USD	300,000	08-SEP-21	19.99
2021072903336	MXN	190,735	USD	9,570	26-AUG-21	19.93
2021072903452	USD	93,750	MXN	1,859,250	30-JUL-21	19.83
2021072903453	USD	93,750	MXN	1,859,250	30-JUL-21	19.83
2021072903590	MXN	1,996,730	USD	100,000	30-AUG-21	19.97
2021072903591	MXN	2,995,095	USD	150,000	30-AUG-21	19.97
2021073003119	MXN	9,998,500	USD	500,000	28-SEP-21	20.00
2021073003120	MXN	12,347,300	USD	620,000	24-AUG-21	19.92
2021072903791	MXN	2,995,095	USD	150,000	30-AUG-21	19.97
2021091503575	MXN	397	USD	20	17-SEP-21	19.85
2021090103574	USD	300,000	MXN	6,000,600	09-SEP-21	20.00
2021080903263	MXN	1,010,200	USD	50,000	14-SEP-21	20.20
2021080903264	MXN	1,008,350	USD	50,000	31-AUG-21	20.17
2021043003488	MXN	5,320,164	USD	259,381	15-SEP-21	20.51
2021073003481	MXN	604,849	USD	30,250	25-AUG-21	20.00
2021081903489	USD	126,000	MXN	2,530,836	31-AUG-21	20.09
2021091503577	MXN	397	USD	20	17-SEP-21	19.85
2021081903492	USD	112,000	MXN	2,250,304	03-SEP-21	20.09
2021081903427	MXN	404	USD	20	20-AUG-21	20.20
2021081903430	MXN	404	USD	20	20-AUG-21	20.20
2021081903485	USD	104,000	MXN	2,088,736	30-AUG-21	20.08
2021081303329	MXN	1,001,200	USD	50,000	28-SEP-21	20.02
2021080603498	MXN	599,643	USD	29,700	08-SEP-21	20.19
2021072903372	USD	303,890	MXN	6,047,410	19-AUG-21	19.90
2021072903589	MXN	1,996,730	USD	100,000	30-AUG-21	19.97
2021072903638	USD	2,950,000	MXN	58,542,750	30-JUL-21	19.85

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021072903460	MXN	5,979,900	USD	300,000	01-SEP-21	19.93
2021072903400	MXN	47,000,000	USD	2,358,136	30-AUG-21	19.93
2021081903486	USD	112,000	MXN	2,249,408	30-AUG-21	20.08
2021082003178	USD	100,000	MXN	2,046,700	14-SEP-21	20.47
2021081903578	MXN	662,367	USD	32,600	22-SEP-21	20.32
2021081903479	USD	123,000	MXN	2,469,594	27-AUG-21	20.08
2021081903432	MXN	404	USD	20	20-AUG-21	20.20
2021082003449	MXN	5,984,280	USD	300,000	20-AUG-21	19.95
2021082403287	MXN	736,902	USD	36,000	28-SEP-21	20.47
2021051003490	MXN	604,545	USD	30,000	02-SEP-21	20.15
2021051003491	MXN	604,065	USD	30,000	26-AUG-21	20.14
2021051003492	MXN	603,585	USD	30,000	19-AUG-21	20.12
2021051003496	MXN	601,635	USD	30,000	22-JUL-21	20.05
2021050603574	MXN	1,311,388	USD	63,938	14-JUL-21	20.51
2021082403169	MXN	3,023,700	USD	150,000	24-AUG-21	20.16
2021050603547	MXN	4,060,000	USD	200,000	22-JUL-21	20.30
2021082403288	MXN	308,787	USD	15,100	21-SEP-21	20.45
2021082603129	MXN	2,996,550	USD	150,000	26-AUG-21	19.98
2021071203253	MXN	9,972,000	USD	500,000	19-AUG-21	19.94
2021012703738	MXN	587,934	USD	28,447	15-SEP-21	20.67
2021012703750	MXN	206,218	USD	9,956	15-SEP-21	20.71
2021071203255	MXN	9,981,000	USD	500,000	26-AUG-21	19.96
2021082603177	MXN	12,283,500	USD	600,000	27-SEP-21	20.47
2021051003527	MXN	928,806	USD	46,042	03-AUG-21	20.17
2021051003488	MXN	605,475	USD	30,000	15-SEP-21	20.18
2021051003495	MXN	602,175	USD	30,000	29-JUL-21	20.07
2021082403191	USD	50,000,000	MXN	1,016,000,000	25-AUG-21	20.32
2021082403249	MXN	3,503,378	USD	175,000	24-AUG-21	20.02
2021082403455	MXN	850,239	USD	41,750	29-SEP-21	20.37
2021071303172	MXN	10,208,650	USD	500,000	15-JUL-21	20.42
2021051103042	MXN	604,470	USD	30,000	15-SEP-21	20.15
2021051103043	MXN	604,020	USD	30,000	09-SEP-21	20.13
2021051103047	MXN	602,055	USD	30,000	12-AUG-21	20.07
2021051103051	MXN	600,120	USD	30,000	15-JUL-21	20.00
2021012703770	MXN	508,018	USD	24,557	15-SEP-21	20.69
2021012703772	MXN	660,442	USD	31,925	14-JUL-21	20.69
2021082403231	MXN	406	USD	20	24-AUG-21	20.32
2021071303248	MXN	1,209,060	USD	60,000	07-SEP-21	20.15
2021012703739	MXN	898,735	USD	43,485	18-AUG-21	20.67
2021082603317	MXN	2,005,140	USD	100,000	26-AUG-21	20.05
2021012703751	MXN	268,626	USD	12,969	18-AUG-21	20.71
2021012703752	MXN	268,066	USD	12,942	14-JUL-21	20.71
2021082703246	USD	20,754	MXN	419,368	03-SEP-21	20.21
2021082503374	MXN	1,362,804	USD	68,286	25-AUG-21	19.96
2021051103040	MXN	605,550	USD	30,000	30-SEP-21	20.19
2021051103044	MXN	603,540	USD	30,000	02-SEP-21	20.12
2021051103049	MXN	601,080	USD	30,000	29-JUL-21	20.04
2021051003487	MXN	606,045	USD	30,000	23-SEP-21	20.20
2021051003489	MXN	605,040	USD	30,000	09-SEP-21	20.17
2021051003493	MXN	603,105	USD	30,000	12-AUG-21	20.10
2021051103041	MXN	605,040	USD	30,000	23-SEP-21	20.17
2021051103045	MXN	603,030	USD	30,000	26-AUG-21	20.10
2021051103046	MXN	602,550	USD	30,000	19-AUG-21	20.09
2021051103050	MXN	600,600	USD	30,000	22-JUL-21	20.02
2021012703771	MXN	661,787	USD	31,990	18-AUG-21	20.69
2021012703742	MXN	863,290	USD	41,770	14-JUL-21	20.67
2021071303249	MXN	1,798,682	USD	89,500	17-AUG-21	20.10
2021082603316	MXN	2,008,340	USD	100,000	26-AUG-21	20.08
2021071403261	MXN	662,838	USD	33,000	02-AUG-21	20.09
2021071403041	MXN	694	USD	35	16-JUL-21	19.93

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021071403068	USD	264,901	MXN	5,286,093	06-AUG-21	19.96
2021071403098	USD	50,000,000	MXN	995,000,000	16-JUL-21	19.90
2021051103048	MXN	601,575	USD	30,000	05-AUG-21	20.05
2021051103052	MXN	599,655	USD	30,000	08-JUL-21	19.99
2021073003471	MXN	717,260	USD	36,000	30-JUL-21	19.92
2021070203315	MXN	4,984,750	USD	250,000	06-AUG-21	19.94
2021073003400	MXN	522,175	USD	26,165	02-SEP-21	19.96
2021073003446	MXN	522,175	USD	26,165	09-SEP-21	19.96
2021073003138	MXN	14,930,700	USD	750,000	26-AUG-21	19.91
2021073003137	MXN	14,916,975	USD	750,000	19-AUG-21	19.89
2021073003123	MXN	397	USD	20	30-JUL-21	19.85
2021072003333	USD	11,000	MXN	222,178	26-AUG-21	20.20
2021073003401	MXN	261,093	USD	13,083	26-AUG-21	19.96
2021040803128	MXN	5,130,750	USD	250,000	23-JUL-21	20.52
2021040803066	MXN	1,024,920	USD	50,000	10-SEP-21	20.50
2021040803069	MXN	614,610	USD	30,000	23-SEP-21	20.49
2021040803073	MXN	612,645	USD	30,000	26-AUG-21	20.42
2021040803077	MXN	610,665	USD	30,000	29-JUL-21	20.36
2021040803647	MXN	6,341,652	USD	310,500	29-JUL-21	20.42
2021040803088	MXN	5,126,500	USD	250,000	16-JUL-21	20.51
2021072003208	USD	200,000	MXN	4,025,000	22-JUL-21	20.13
2021072203462	MXN	1,701,932	USD	84,100	25-AUG-21	20.24
2021072003426	USD	163,000	MXN	3,268,606	05-AUG-21	20.05
2021072003389	USD	106,000	MXN	2,123,169	28-JUL-21	20.03
2021072003418	USD	136,000	MXN	2,726,392	03-AUG-21	20.05
2021082503219	USD	68,286	MXN	1,382,792	25-AUG-21	20.25
2021072303461	USD	3,000,000	MXN	60,066,000	27-JUL-21	20.02
2021072103031	USD	135,447	MXN	2,742,798	10-AUG-21	20.25
2021072303462	MXN	60,261,900	USD	3,000,000	17-AUG-21	20.09
2021072103108	MXN	8,030,400	USD	400,000	21-JUL-21	20.08
2021040803126	MXN	5,134,750	USD	250,000	30-JUL-21	20.54
2021040803065	MXN	1,024,920	USD	50,000	17-SEP-21	20.50
2021040803068	MXN	615,105	USD	30,000	30-SEP-21	20.50
2021040803075	MXN	611,685	USD	30,000	12-AUG-21	20.39
2021040803076	MXN	611,190	USD	30,000	05-AUG-21	20.37
2021072103143	MXN	71,970,220	USD	3,565,000	21-JUL-21	20.19
2021082503373	MXN	2,129,723	USD	106,714	25-AUG-21	19.96
2021041503228	MXN	609,615	USD	30,000	02-SEP-21	20.32
2021041503535	MXN	1,016,500	USD	50,000	03-SEP-21	20.33
2021041503236	MXN	605,625	USD	30,000	08-JUL-21	20.19
2021082503385	MXN	706	USD	35	27-AUG-21	20.29
2021041903265	MXN	1,005,875,000	USD	50,000,000	25-AUG-21	20.12
2021073003575	MXN	39,433,617	USD	1,973,852	20-AUG-21	19.98
2021073003645	MXN	587,847	USD	29,051	15-SEP-21	20.24
2021041903133	MXN	1,001,850	USD	50,000	16-JUL-21	20.04
2021082603031	MXN	407	USD	20	27-AUG-21	20.35
2021082603035	MXN	407	USD	20	27-AUG-21	20.35
2021082603043	MXN	407	USD	20	30-AUG-21	20.36
2021082603045	MXN	407	USD	20	30-AUG-21	20.36
2021082603282	USD	500,000	MXN	10,170,000	26-AUG-21	20.34
2021082603047	MXN	407	USD	20	30-AUG-21	20.36
2021041503534	MXN	1,016,500	USD	50,000	10-SEP-21	20.33
2021041503226	MXN	611,115	USD	30,000	23-SEP-21	20.37
2021041503229	MXN	609,105	USD	30,000	26-AUG-21	20.30
2021041503230	MXN	608,595	USD	30,000	19-AUG-21	20.29
2021041503231	MXN	608,100	USD	30,000	12-AUG-21	20.27
2021072003399	USD	161,000	MXN	3,227,100	02-AUG-21	20.04
2021040803064	MXN	1,024,920	USD	50,000	24-SEP-21	20.50
2021040803071	MXN	613,620	USD	30,000	09-SEP-21	20.45
2021072003416	USD	135,000	MXN	2,705,954	02-AUG-21	20.04

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021040803072	MXN	613,125	USD	30,000	02-SEP-21	20.44
2021040803079	MXN	609,675	USD	30,000	15-JUL-21	20.32
2021040803080	MXN	609,195	USD	30,000	08-JUL-21	20.31
2021040803089	MXN	5,122,500	USD	250,000	09-JUL-21	20.49
2021041903597	MXN	606,225	USD	30,000	30-SEP-21	20.21
2021041903602	MXN	603,780	USD	30,000	26-AUG-21	20.13
2021041903603	MXN	603,285	USD	30,000	19-AUG-21	20.11
2021041903608	MXN	600,855	USD	30,000	15-JUL-21	20.03
2021041903600	MXN	604,755	USD	30,000	09-SEP-21	20.16
2021041903601	MXN	604,260	USD	30,000	02-SEP-21	20.14
2021041903605	MXN	602,325	USD	30,000	05-AUG-21	20.08
2021041903800	MXN	600,390	USD	30,000	08-JUL-21	20.01
2021040803067	MXN	1,024,920	USD	50,000	03-SEP-21	20.50
2021040803070	MXN	614,040	USD	30,000	15-SEP-21	20.47
2021040803074	MXN	612,135	USD	30,000	19-AUG-21	20.40
2021040803078	MXN	610,185	USD	30,000	22-JUL-21	20.34
2021082603049	MXN	407	USD	20	30-AUG-21	20.35
2021082603033	MXN	407	USD	20	27-AUG-21	20.35
2021082603037	MXN	407	USD	20	27-AUG-21	20.36
2021081003549	MXN	2,905,344	USD	144,000	18-AUG-21	20.18
2021041903599	MXN	605,175	USD	30,000	15-SEP-21	20.17
2021041903606	MXN	601,815	USD	30,000	29-JUL-21	20.06
2021081003406	MXN	5,034,250	USD	250,000	02-SEP-21	20.14
2021081003407	MXN	5,039,000	USD	250,000	09-SEP-21	20.16
2021081103055	MXN	20,370,000	USD	1,000,000	16-AUG-21	20.37
2021042003434	MXN	7,836,016	USD	389,000	30-JUL-21	20.14
2021042003621	MXN	1,008,835	USD	50,000	09-JUL-21	20.18
2021080403454	MXN	1,005,475	USD	50,000	14-SEP-21	20.11
2021081003411	MXN	5,048,750	USD	250,000	23-SEP-21	20.20
2021080403334	MXN	696	USD	35	06-AUG-21	19.99
2021042003645	MXN	1,014,550	USD	50,000	19-AUG-21	20.29
2021042103322	MXN	2,020,600	USD	100,000	26-AUG-21	20.21
2021042103323	MXN	1,009,910	USD	50,000	24-AUG-21	20.20
2021042103324	MXN	2,018,820	USD	100,000	19-AUG-21	20.19
2021042103325	MXN	1,009,055	USD	50,000	17-AUG-21	20.18
2021042103326	MXN	2,017,120	USD	100,000	12-AUG-21	20.17
2021042103327	MXN	1,008,195	USD	50,000	10-AUG-21	20.16
2021041903598	MXN	605,745	USD	30,000	23-SEP-21	20.19
2021041903604	MXN	602,790	USD	30,000	12-AUG-21	20.09
2021041903607	MXN	601,335	USD	30,000	22-JUL-21	20.04
2021080403238	USD	500,000	MXN	9,986,500	04-AUG-21	19.97
2021080403369	MXN	4,236,430,000	CAD	264,760,327	26-AUG-21	16.00
2021080403347	MXN	42,673,929	USD	1,850,665	05-AUG-21	23.06
2021080403453	MXN	301,928	USD	15,000	21-SEP-21	20.13
2021080403311	MXN	408,678	USD	20,243	15-SEP-21	20.19
2021080403312	MXN	532,373	USD	26,370	18-AUG-21	20.19
2021042003642	MXN	1,019,300	USD	50,000	28-SEP-21	20.39
2021042003643	MXN	1,018,650	USD	50,000	23-SEP-21	20.37
2021042003646	MXN	1,011,950	USD	50,000	28-JUL-21	20.24
2021042003647	MXN	1,011,250	USD	50,000	22-JUL-21	20.23
2021042003617	MXN	2,019,040	USD	100,000	15-JUL-21	20.19
2021042003618	MXN	2,017,440	USD	100,000	08-JUL-21	20.17
2021042003619	MXN	1,010,435	USD	50,000	23-JUL-21	20.21
2021080503381	MXN	3,715,448	USD	185,000	30-SEP-21	20.08
2021041503740	MXN	5,089,875	USD	250,000	10-SEP-21	20.36
2021080603265	USD	120,000	MXN	2,391,840	16-AUG-21	19.93
2021080603091	MXN	400	USD	20	06-AUG-21	19.98
2021041503532	MXN	1,016,500	USD	50,000	24-SEP-21	20.33
2021080603073	MXN	2,514,375	USD	125,000	06-AUG-21	20.12
2021041503225	MXN	611,625	USD	30,000	30-SEP-21	20.39

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021041503227	MXN	610,530	USD	30,000	15-SEP-21	20.35
2021041503234	MXN	606,585	USD	30,000	22-JUL-21	20.22
2021080603245	USD	121,000	MXN	2,411,046	13-AUG-21	19.93
2021080603114	MXN	400	USD	20	06-AUG-21	20.02
2021041503720	MXN	5,077,500	USD	250,000	20-AUG-21	20.31
2021082703426	USD	93,750	MXN	1,894,219	31-AUG-21	20.21
2021082603460	MXN	20,399,500	USD	1,000,000	30-AUG-21	20.40
2021082703371	USD	50,000	MXN	1,008,645	31-AUG-21	20.17
2021082603528	USD	9,682,493	MXN	197,000,000	30-AUG-21	20.35
2021080403504	MXN	1,029,394	USD	51,150	08-SEP-21	20.13
2021042003616	MXN	1,010,315	USD	50,000	22-JUL-21	20.21
2021042003620	MXN	1,009,630	USD	50,000	16-JUL-21	20.19
2021042003644	MXN	1,015,400	USD	50,000	26-AUG-21	20.31
2021042103328	MXN	1,007,705	USD	50,000	06-AUG-21	20.15
2021042103460	MXN	4,031,000	USD	200,000	22-JUL-21	20.16
2021082703483	USD	113,000	MXN	2,275,029	13-SEP-21	20.13
2021082703422	USD	93,750	MXN	1,894,219	31-AUG-21	20.21
2021082703452	USD	105,000	MXN	2,112,705	07-SEP-21	20.12
2021082703445	USD	110,000	MXN	2,213,310	07-SEP-21	20.12
2021082703497	USD	106,000	MXN	2,134,098	13-SEP-21	20.13
2021082703478	USD	125,000	MXN	2,516,625	13-SEP-21	20.13
2021041603208	MXN	609,435	USD	30,000	23-SEP-21	20.31
2021041603211	MXN	607,935	USD	30,000	02-SEP-21	20.26
2021041603215	MXN	605,925	USD	30,000	05-AUG-21	20.20
2021041603217	MXN	604,905	USD	30,000	22-JUL-21	20.16
2021041603347	MXN	147,000,000	USD	7,248,699	29-SEP-21	20.28
2021081003274	MXN	3,062,496	USD	146,000	10-AUG-21	20.98
2021081103225	MXN	20,227,000	USD	1,000,000	11-AUG-21	20.23
2021081103288	MXN	694	USD	35	13-AUG-21	19.95
2021082003345	USD	22,430	MXN	457,733	01-SEP-21	20.41
2021082003353	USD	220,286	MXN	4,500,000	07-SEP-21	20.43
2021081103113	MXN	61,084,500	USD	3,000,000	11-AUG-21	20.36
2021082703454	USD	112,000	MXN	2,253,552	07-SEP-21	20.12
2021082703457	USD	127,000	MXN	2,555,875	09-SEP-21	20.13
2021083103460	MXN	197,902	USD	9,840	09-SEP-21	20.11
2021090303627	MXN	85,866,700	USD	4,300,000	14-SEP-21	19.97
2021082603473	MXN	320,380	USD	15,705	15-SEP-21	20.40
2021082603488	USD	65,356	MXN	1,330,328	03-SEP-21	20.36
2021040703160	MXN	2,056,090	USD	100,000	17-SEP-21	20.56
2021040703161	MXN	2,058,610	USD	100,000	28-SEP-21	20.59
2021040703162	MXN	2,057,700	USD	100,000	24-SEP-21	20.58
2021040703166	MXN	2,053,790	USD	100,000	07-SEP-21	20.54
2021040703164	MXN	2,055,410	USD	100,000	14-SEP-21	20.55
2021040703165	MXN	2,054,490	USD	100,000	10-SEP-21	20.54
2021040703163	MXN	2,057,020	USD	100,000	21-SEP-21	20.57
2021040703167	MXN	3,695,112	USD	180,000	03-SEP-21	20.53
2021090103544	USD	2,800,000	MXN	55,860,000	01-SEP-21	19.95
2021090203302	MXN	699	USD	35	03-SEP-21	19.98
2021090203172	MXN	623,937	USD	31,000	20-SEP-21	20.13
2021043003489	MXN	5,309,252	USD	258,849	18-AUG-21	20.51
2021081903031	USD	100,000	MXN	2,005,000	19-AUG-21	20.05
2021090203364	MXN	400	USD	20	03-SEP-21	19.99
2021050603572	MXN	1,333,641	USD	65,023	15-SEP-21	20.51
2021050703042	MXN	1,911,028	USD	93,750	30-SEP-21	20.38
2021090203362	MXN	400	USD	20	03-SEP-21	19.99
2021090203477	USD	70,000	MXN	1,394,834	02-SEP-21	19.93
2021090203430	USD	50,000	MXN	1,022,600	02-SEP-21	20.45
2021043003490	MXN	5,245,073	USD	255,720	14-JUL-21	20.51
2021043003494	MXN	710,494	USD	34,800	30-JUL-21	20.42
2021090103136	MXN	1,000,600	USD	50,000	02-SEP-21	20.01

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021082703469	USD	114,000	MXN	2,294,478	10-SEP-21	20.13
2021082703480	USD	63,000	MXN	1,268,379	13-SEP-21	20.13
2021090103230	USD	100,000	MXN	1,992,110	01-SEP-21	19.92
2021050603545	MXN	2,030,000	USD	100,000	22-JUL-21	20.30
2021050503298	MXN	1,940,550	USD	93,750	31-AUG-21	20.70
2021050603573	MXN	1,317,254	USD	64,224	18-AUG-21	20.51
2021050603546	MXN	4,060,000	USD	200,000	22-JUL-21	20.30
2021090303253	MXN	9,952,850	USD	500,000	03-SEP-21	19.91
2021051703362	MXN	2,002,640	USD	100,000	13-AUG-21	20.03
2021051703364	MXN	1,999,500	USD	100,000	29-JUL-21	20.00
2021051703365	MXN	1,998,480	USD	100,000	26-JUL-21	19.98
2021051703366	MXN	1,997,210	USD	100,000	19-JUL-21	19.97
2021051703367	MXN	1,995,260	USD	100,000	12-JUL-21	19.95
2021090203145	MXN	20,226,000	USD	1,000,000	02-SEP-21	20.23
2021090203171	MXN	1,269,198	USD	63,000	27-SEP-21	20.15
2021050503297	MXN	1,940,550	USD	93,750	30-JUL-21	20.70
2021050503299	MXN	1,940,550	USD	93,750	30-SEP-21	20.70
2021050703040	MXN	1,911,028	USD	93,750	30-JUL-21	20.38
2021050703041	MXN	1,911,028	USD	93,750	31-AUG-21	20.38
2021051803038	MXN	601,650	USD	30,000	23-SEP-21	20.06
2021051803039	MXN	601,080	USD	30,000	15-SEP-21	20.04
2021051803042	MXN	599,640	USD	30,000	26-AUG-21	19.99
2021051803043	MXN	599,130	USD	30,000	19-AUG-21	19.97
2021051803046	MXN	597,660	USD	30,000	29-JUL-21	19.92
2021051803047	MXN	597,150	USD	30,000	22-JUL-21	19.91
2021051803048	MXN	596,670	USD	30,000	15-JUL-21	19.89
2021090903133	MXN	694	USD	35	10-SEP-21	19.94
2021051703564	MXN	1,305,525	USD	65,000	17-SEP-21	20.09
2021051703565	MXN	1,304,420	USD	65,000	10-SEP-21	20.07
2021051703130	MXN	14,946,600	USD	750,000	07-JUL-21	19.93
2021090203366	MXN	400	USD	20	03-SEP-21	19.98
2021090203368	MXN	400	USD	20	03-SEP-21	19.98
2021051703359	MXN	2,007,560	USD	100,000	31-AUG-21	20.08
2021051803037	MXN	602,190	USD	30,000	30-SEP-21	20.07
2021051803040	MXN	600,630	USD	30,000	09-SEP-21	20.02
2021051803044	MXN	598,650	USD	30,000	12-AUG-21	19.96
2021051703563	MXN	1,306,630	USD	65,000	24-SEP-21	20.10
2021051703566	MXN	1,303,315	USD	65,000	03-SEP-21	20.05
2021051803245	MXN	7,967,200	USD	400,000	22-JUL-21	19.92
2021051803246	MXN	7,954,000	USD	400,000	08-JUL-21	19.89
2021051803257	MXN	604,110	USD	30,000	30-SEP-21	20.14
2021051803259	MXN	603,000	USD	30,000	15-SEP-21	20.10
2021051803260	MXN	602,550	USD	30,000	09-SEP-21	20.09
2021051803263	MXN	601,050	USD	30,000	19-AUG-21	20.04
2021051803264	MXN	600,570	USD	30,000	12-AUG-21	20.02
2021051803266	MXN	599,580	USD	30,000	29-JUL-21	19.99
2021090303101	MXN	5,398,650	USD	270,000	28-SEP-21	20.00
2021090303593	MXN	39,461,048	USD	1,704,765	07-SEP-21	23.15
2021090903353	MXN	1,995,300	USD	100,000	14-SEP-21	19.95
2021051803258	MXN	603,570	USD	30,000	23-SEP-21	20.12
2021051803265	MXN	600,060	USD	30,000	05-AUG-21	20.00
2021051803268	MXN	598,590	USD	30,000	15-JUL-21	19.95
2021051803269	MXN	598,095	USD	30,000	08-JUL-21	19.94
2021090303257	MXN	4,780,920	USD	240,000	15-SEP-21	19.92
2021051803364	MXN	9,929,250	USD	500,000	08-JUL-21	19.86
2021090303271	MXN	9,977,000	USD	500,000	24-SEP-21	19.95
2021051703360	MXN	2,005,270	USD	100,000	24-AUG-21	20.05
2021051703361	MXN	2,004,470	USD	100,000	19-AUG-21	20.04
2021051703363	MXN	2,001,020	USD	100,000	06-AUG-21	20.01
2021090903245	USD	80,139	EUR	67,760	13-SEP-21	1.18

External Deal Number	CCY Bought	AMT Bought	CCY Sold	AMT Sold	Value	Rate
2021091003304	MXN	11,940,000	USD	600,000	27-SEP-21	19.90
2021090903565	USD	50,000	MXN	1,004,650	09-SEP-21	20.09
2021091003327	MXN	1,993,700	USD	100,000	28-SEP-21	19.94
2021091003328	MXN	1,992,780	USD	100,000	24-SEP-21	19.93
2021051803244	MXN	7,973,600	USD	400,000	29-JUL-21	19.93
2021051803041	MXN	600,150	USD	30,000	02-SEP-21	20.01
2021051803045	MXN	598,140	USD	30,000	05-AUG-21	19.94
2021051803049	MXN	596,175	USD	30,000	08-JUL-21	19.87
2021051803261	MXN	602,070	USD	30,000	02-SEP-21	20.07
2021051803262	MXN	601,560	USD	30,000	26-AUG-21	20.05
2021051803267	MXN	599,070	USD	30,000	22-JUL-21	19.97
2021091703529	USD	50,000	MXN	1,006,275	17-SEP-21	20.13
2021091703601	USD	2,500,000	MXN	50,050,000	21-SEP-21	20.02
2021091703603	USD	500,000	MXN	10,010,000	21-SEP-21	20.02
2021090903352	MXN	1,997,000	USD	100,000	20-SEP-21	19.97
2021090903510	USD	50,000	MXN	1,005,050	09-SEP-21	20.10
2021052403206	MXN	20,044,300	USD	1,000,000	16-AUG-21	20.04
2021052403384	MXN	4,024,400	USD	200,000	06-AUG-21	20.12
2021052403385	MXN	4,024,400	USD	200,000	06-AUG-21	20.12
2021052103235	MXN	4,033,200	USD	200,000	09-AUG-21	20.17
2021052103234	MXN	4,034,600	USD	200,000	12-AUG-21	20.17
2021052103474	MXN	2,011,813	USD	99,339	15-SEP-21	20.25
2021052403523	MXN	4,994,280	USD	248,200	31-AUG-21	20.12
2021052403386	MXN	4,024,400	USD	200,000	06-AUG-21	20.12
2021052103233	MXN	3,027,450	USD	150,000	16-AUG-21	20.18
2021052103475	MXN	1,987,086	USD	98,118	18-AUG-21	20.25
2021052103476	MXN	1,978,236	USD	97,681	14-JUL-21	20.25
2021052103236	MXN	5,037,500	USD	250,000	02-AUG-21	20.15

Liquidados anticipadamente

TransID	Trans ProductID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
C56053	CC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	20,000,000	USD	17,950,099	EUR	
C56228	CC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	17,950,099	EUR	20,000,000	USD	
C68629	CC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	20,000,000	USD	17,950,099	EUR	
C68630	CC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	17,950,099	EUR	20,000,000	USD	
E60985	Eq Option	15/11/2022	Buy	U	MXN					66,320,000
E61017	Eq Option	15/11/2022	Buy	U	MXN					66,320,000
E61018	Eq Option	15/11/2022	Sell	U	MXN					66,320,000
E61019	Eq Option	15/11/2022	Sell	U	MXN					66,320,000
E66582	Eq Option	08/05/2023	Buy	U	MXN					795,610,000
E66583	Eq Option	08/05/2023	Sell	U	MXN					795,610,000
E66584	Eq Option	08/05/2023	Sell	U	MXN					795,610,000
E66585	Eq Option	08/05/2023	Buy	U	MXN					795,610,000
E66660	Eq Option	21/03/2023	Buy	U	MXN					651,591,000
E66661	Eq Option	21/03/2023	Buy	U	MXN					651,591,000
E66662	Eq Option	21/03/2023	Sell	U	MXN					651,591,000
E66663	Eq Option	21/03/2023	Sell	U	MXN					651,591,000
E70072	Eq Option	24/04/2024	Buy	U	MXN					494,850,000
E70077	Eq Option	24/04/2024	Sell	U	MXN					494,850,000
E70078	Eq Option	24/04/2024	Sell	U	MXN					494,850,000
E70079	Eq Option	24/04/2024	Buy	U	MXN					494,850,000
E70142	Eq Option	16/11/2021	Buy	U	MXN					51,410,000
E70143	Eq Option	16/11/2021	Sell	U	MXN					51,410,000
E70144	Eq Option	16/11/2021	Sell	U	MXN					51,410,000
E70145	Eq Option	16/11/2021	Buy	U	MXN					51,410,000
MNF379	Term Deposit	17/09/2021	Buy	U	MXN	650,000,000	MXN	650,000,000	MXN	
MNT302	Term Deposit	30/10/2025	Buy	U	USD	38,467,468	USD	38,467,468	USD	
P17019	Cap	15/02/2024	Buy	U	USD					2,500,000
P17020	Cap	15/02/2024	Sell	U	USD					2,500,000
P17021	Floor	15/02/2024	Sell	U	USD					2,500,000
P17022	Floor	15/02/2024	Buy	U	USD					2,500,000
P17057	Cap	15/02/2024	Buy	U	USD					3,000,000
P17058	Cap	15/02/2024	Sell	U	USD					3,000,000
SDR909	SC Swap	19/01/2023	Buy	U	USD	5,443,678	USD	5,443,678	USD	
SDR910	SC Swap	19/01/2023	Buy	U	USD	5,443,678	USD	5,443,678	USD	
SDR988	SC Swap	13/03/2023	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDR990	SC Swap	13/03/2023	Buy	U	MXN	1,000,000,000	MXN	1,000,000,000	MXN	
SDS190	SC Swap	10/12/2024	Buy	U	USD	75,000,000	USD	75,000,000	USD	
SDS515	SC Swap	27/10/2026	Buy	U	USD	3,270,919	USD	3,270,919	USD	
SDS520	SC Swap	22/05/2023	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDS522	SC Swap	27/10/2026	Buy	U	USD	3,270,919	USD	3,270,919	USD	
SDS526	SC Swap	30/11/2023	Buy	U	MXN	10,009,998	MXN	10,009,998	MXN	
SDS530	SC Swap	26/09/2024	Buy	U	MXN	800,000,000	MXN	800,000,000	MXN	
SDS531	SC Swap	22/05/2023	Buy	U	MXN	20,000,000	MXN	20,000,000	MXN	
SDS541	SC Swap	30/11/2023	Buy	U	MXN	10,009,998	MXN	10,009,998	MXN	
SDS874	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	9,876,429	MXN	9,876,429	MXN	
SDS886	SC Swap	19/12/2024	Buy	U	MXN	9,876,429	MXN	9,876,429	MXN	
SDS975	SC Swap	02/05/2022	Buy	U	MXN	4,169,195	MXN	4,169,195	MXN	
SDT096	SC Swap	15/02/2024	Buy	U	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SDT108	SC Swap	15/02/2024	Buy	U	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SDT569	SC Swap	10/12/2024	Buy	U	USD	75,000,000	USD	75,000,000	USD	
SDT628	SC Swap	04/08/2023	Buy	U	MXN	99,644,789	MXN	99,644,789	MXN	
SDT633	SC Swap	04/08/2023	Buy	U	MXN	99,644,789	MXN	99,644,789	MXN	
SDU357	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	10,000,000	USD	10,000,000	USD	
SDU366	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD	
SDU832	SC Swap	25/07/2021	Buy	U	USD	5,816,081	USD	5,816,081	USD	
SDV235	SC Swap	25/01/2028	Buy	U	USD	5,000,000	USD	5,000,000	USD	

TransID	Trans ProductID	Maturity Date	Buy Sell Flag	Trans Status	Base CurID	PaySide Notional	PaySide CurID	RcvSide Notional	RcvSide CurID	Option Notional
SDV239	SC Swap	25/01/2028	Buy	U	USD	5,000,000	USD	5,000,000	USD	
SDV449	SC Swap	25/07/2021	Buy	U	USD	5,816,081	USD	5,816,081	USD	
SDV542	SC Swap	27/04/2022	Buy	U	MXN	8,000,000	MXN	8,000,000	MXN	
SDV937	SC Swap	27/04/2024	Buy	U	USD	4,131,249	USD	4,131,249	USD	
SDV976	SC Swap	27/04/2024	Buy	U	USD	4,131,249	USD	4,131,249	USD	
SDW151	SC Swap	25/01/2028	Buy	U	USD	2,000,000	USD	2,000,000	USD	
SDW493	SC Swap	25/01/2028	Buy	U	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SDW496	SC Swap	25/01/2028	Buy	U	USD	3,000,000	USD	3,000,000	USD	
SDW526	SC Swap	27/11/2022	Buy	U	MXN	4,085,983	MXN	4,085,983	MXN	
SDW534	SC Swap	27/11/2022	Buy	U	MXN	4,085,983	MXN	4,085,983	MXN	
SDW762	SC Swap	22/06/2028	Buy	U	USD	2,500,000	USD	2,500,000	USD	
SDW768	SC Swap	22/06/2028	Buy	U	USD	2,500,000	USD	2,500,000	USD	
SDW977	SC Swap	17/09/2021	Buy	U	MXN	650,000,000	MXN	650,000,000	MXN	
SDW980	SC Swap	17/09/2021	Buy	U	MXN	650,000,000	MXN	650,000,000	MXN	
SDW984	SC Swap	17/09/2021	Buy	U	MXN	650,000,000	MXN	650,000,000	MXN	
SDX432	SC Swap	13/05/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SDX963	SC Swap	30/09/2026	Buy	U	USD	8,800,000	USD	8,800,000	USD	
SDX972	SC Swap	30/09/2026	Buy	U	USD	8,800,000	USD	8,800,000	USD	
SDY411	SC Swap	30/09/2026	Buy	U	USD	8,400,585	USD	8,400,585	USD	
SDY412	SC Swap	30/09/2026	Buy	U	USD	8,400,585	USD	8,400,585	USD	
SDZ029	SC Swap	29/05/2031	Buy	U	MXN	26,500,000	MXN	26,500,000	MXN	
SEA110	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	USD	38,467,468	USD	38,467,468	USD	
SEA112	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	USD	38,467,468	USD	38,467,468	USD	
SEA121	SC Swap	30/10/2025	Buy	U	USD	38,467,468	USD	38,467,468	USD	
SEB785	SC Swap	19/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEB786	SC Swap	19/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEB788	SC Swap	19/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEB790	SC Swap	19/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEC144	SC Swap	25/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEC145	SC Swap	25/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEC512	SC Swap	26/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEC513	SC Swap	26/06/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SED710	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	25,000,000	USD	25,000,000	USD	
SED712	SC Swap	11/09/2025	Buy	U	USD	10,000,000	USD	10,000,000	USD	
SED999	SC Swap	08/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE006	SC Swap	08/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE166	SC Swap	09/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE167	SC Swap	09/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE624	SC Swap	11/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE625	SC Swap	11/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE673	SC Swap	11/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEE704	SC Swap	11/07/2031	Buy	U	MXN	28,000,000	MXN	28,000,000	MXN	
SEJ599	SC Swap	31/07/2031	Buy	U	MXN	14,000,000	MXN	14,000,000	MXN	
SEJ600	SC Swap	31/07/2031	Buy	U	MXN	14,000,000	MXN	14,000,000	MXN	
SEJ601	SC Swap	27/01/2022	Buy	U	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SEJ602	SC Swap	27/01/2022	Buy	U	MXN	90,000,000	MXN	90,000,000	MXN	
SEJ773	SC Swap	04/08/2031	Buy	U	MXN	11,000,000	MXN	11,000,000	MXN	
SEJ774	SC Swap	04/08/2031	Buy	U	MXN	11,000,000	MXN	11,000,000	MXN	
SEO628	SC Swap	08/02/2022	Buy	U	MXN	440,000,000	MXN	440,000,000	MXN	
SEO629	SC Swap	08/02/2022	Buy	U	MXN	440,000,000	MXN	440,000,000	MXN	
SEP927	SC Swap	31/03/2023	Buy	U	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEP958	SC Swap	31/03/2023	Buy	U	USD	1,000,000	USD	1,000,000	USD	
SEQ140	SC Swap	01/09/2023	Buy	U	MXN	52,000,000	MXN	52,000,000	MXN	
SEQ141	SC Swap	01/09/2023	Buy	U	MXN	52,000,000	MXN	52,000,000	MXN	
SEQ142	SC Swap	28/08/2026	Buy	U	MXN	23,000,000	MXN	23,000,000	MXN	
SEQ143	SC Swap	28/08/2026	Buy	U	MXN	23,000,000	MXN	23,000,000	MXN	

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 2021 se tienen los siguientes saldos:

Cifras expresadas en pesos

CONTRAPARTE	Moneda	Colateral Recibido	Colateral Enviado
CLIENTE 1	USD	-	(12,242,314)
CLIENTE 2	MXN	53,300,000	(42,500,000)
CLIENTE 3	MXN	225,000,000.00	(162,000,000)
CLIENTE 4	MXN	42,500,000.00	(17,100,000)
CLIENTE 5	MXN	199,200,000.00	(102,500,000)
CLIENTE 6	MXN	606,168,552.19	(417,300,000)
CLIENTE 7	USD	31,270,000.00	(17,820,000)
CLIENTE 8	USD	5,500,000	(10,740,000)
CLIENTE 9	USD	74,100,000	(63,800,000)
CLIENTE 10	USD	2,380,000	(4,220,000)
CLIENTE 11	USD	33,480,000	(18,900,000)
CLIENTE 12	USD	300,000	0
CLIENTE 13	USD	4,430,000	(3,950,000)
TOTAL		1,277,628,552	(873,072,314)

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

Cifras expresadas en pesos

Deal	Fecha de evento	Contraparte/ Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento	Producto
2021061603502	01/07/2021	Cliente 1	MXN	3,546,576	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2077987	01/07/2021	Cliente 2	MXN	806,000	NO FONDEO SU CUENTA	FX Options (Vanilla)
2021062803219	12/07/2021	Cliente 3	MXN	794,276	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
2021062803218	19/07/2021	Cliente 4	MXN	794,984	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
SDY576	20/07/2021	Cliente 5	MXN	383,644	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SdT815	20/07/2021	Cliente 6	MXN	48,183	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
E69463	22/07/2021	Cliente 7	MXN	1,159,950	NO ENVIO LOS FONDOS	Equity Options
SAK055	28/07/2021	Cliente 8	MXN	1,306,731	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/07/2021	Cliente 9	MXN	1,482,378	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2021072003399	02/08/2021	Cliente 10	USD	161,000	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
SAK055	30/08/2021	Cliente 11	MXN	1,431,514	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	30/08/2021	Cliente 12	MXN	1,578,051	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SDS278	30/08/2021	Cliente 13	MXN	102,371	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SdT314	30/08/2021	Cliente 14	MXN	106,565	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SDS173	30/08/2021	Cliente 15	MXN	23,062	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
2020090103316	01/09/2021	Cliente 16	MXN	7,951,720	NO FONDEO SU CUENTA	Forwards FX
E60985	08/09/2021	Cliente 17	MXN	904,400	NO ENVIO LOS FONDOS	Equity Options
SDV942	23/09/2021	Cliente 18	MXN	88,966	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SAK055	28/09/2021	Cliente 19	MXN	1,176,725	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SX6539	29/09/2021	Cliente 20	MXN	1,370,930	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
SDY022	30/09/2021	Cliente 21	MXN	27,479	NO FONDEO SU CUENTA	Interest Rate Swap
C67382	30/09/2021	Cliente 22	MXN	1,342,345,295	NO ENVIO LOS FONDOS	Cross Currency Swaps

Características de los Instrumentos Financieros Derivados a la fecha del Reporte

Tabla 1: Resumen de los Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o contrato	Cobertura o Negociación	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores dados en garantía
				VP Trim Anterior	VP Trim Actual	VP Trim Anterior	VP Trim Actual	0 A 1 AÑO	1 A 5 AÑOS	5 A 10 AÑOS	
Forwards	NEGO	2,427,116,157	Compra	Divisas	Divisas	107,259,521,266	98,838,713,789	2,066,600,880	360,515,276	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	2,399,318,112	Venta	Divisas	Divisas	(107,105,614,774)	(98,867,152,285)	2,077,225,023	322,093,089	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	445,631,000	Compra	Acción	Acción	66,093,581	26,786,867	-	445,631,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	(110,766,000)	Venta	Acción	Acción	(55,847,572)	(16,851,573)	-	(110,766,000)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,413,902,430	Compra	Divisas	Divisas	106,862,289	89,502,278	3,807,131,162	606,771,268	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	4,413,902,430	Venta	Divisas	Divisas	(105,555,873)	(87,442,912)	3,807,131,162	606,771,268	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,574,876,000	Compra	Índice	Índice	244,990,958	242,738,815	152,600,000	2,422,276,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Índice	Índice	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	28,750,214,063	Compra	Tasas	Tasas	167,713,877	206,930,451	-	23,708,745,588	5,041,468,475	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	28,456,446,377	Venta	Tasas	Tasas	(164,385,288)	(199,885,835)	-	23,602,241,354	4,854,205,023	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	483,382,000	Compra	Acción NE	Acción NE	53,449,469	46,595,355	-	483,382,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	253,691,000	Venta	Acción NE	Acción NE	(63,695,478)	(56,530,649)	-	253,691,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Índice NE	Índice NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,574,876,000	Venta	Índice NE	Índice NE	(244,990,958)	(242,738,815)	152,600,000	2,422,276,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	78,845,934	Compra	Divisas NE	Divisas NE	1,590,363	1,459,164	-	78,845,934	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	78,845,934	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(2,896,778)	(3,518,550)	-	78,845,934	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Compra	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	-	Venta	Tasas NE	Tasas NE	-	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	8,694,168,641	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(80,792,695)	(60,635,105)	-	5,240,500,004	3,453,668,637	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(5,800,471)	CCIRS	LIBOR USD / TASA DE INTERES	LIBOR USD / TASA DE INTERES	(5,235,286)	(7,677,707)	-	(5,800,471)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	48,429,508,857	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	(248,907,185)	211,039,364	300,000,000	31,518,765,625	16,610,743,233	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	(2,414,009)	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD	FIJA EUR / LIBOR USD	(5,642,330)	(4,159,280)	-	(2,414,009)	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	37,510,500	CCIRS	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	FIJA EUR / LIBOR USD / FIJA MXN	56,090,150	101,551,958	-	37,510,500	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	19,887,664,788	CCIRS / IRS	FIJA USD / LIBOR USD	FIJA USD / LIBOR USD	(985,620,809)	(976,027,574)	-	5,813,401,281	14,074,263,508	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	331,952,414,869	CCIRS / IRS	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	FIJA MXN /TASA DE INTERES TIIE MXN	940,076,292	3,758,240,164	99,463,409,097	96,503,731,268	135,985,274,503	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	24,701,743,056	CCIRS / IRS	LIBOR USD / FIJA USD	LIBOR USD / FIJA USD	1,070,908,623	295,351,088	(45,986,844)	9,138,201,773	15,609,528,127	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	325,024,863,358	CCIRS / IRS	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	TASA DE INTERES TIIE MXN / FIJA	(1,509,999,005)	(3,553,443,513)	94,388,422,493	83,989,217,887	146,647,222,978	LINEA DE CREDITO

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
100000000000			A C T I V O	649,670,611,704	666,454,354,140
110000000000			DISPONIBILIDADES	29,527,084,190	35,939,342,758
115000000000			CUENTAS DE MARGEN (DERIVADOS)	713,036,557	2,603,798,317
120000000000			INVERSIONES EN VALORES	129,583,993,127	132,213,676,698
	120100000000		Títulos para negociar	60,598,853,608	68,099,295,278
	120200000000		Títulos disponibles para la venta	63,877,655,292	59,079,120,549
	120300000000		Títulos conservados a vencimiento	5,107,484,227	5,035,260,871
120800000000			DEUDORES POR REPORTE (SALDO DEUDOR)	17,550,877,720	28,335,888,285
120700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	0	0
121400000000			DERIVADOS	20,481,215,659	23,124,160,965
	121406000000		Con fines de negociación	15,796,254,246	18,874,092,875
	121407000000		Con fines de cobertura	4,684,961,413	4,250,068,090
121700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE ACTIVOS FINANCIEROS	29,158,433	684,482,188
128000000000			TOTAL DE CARTERA DE CRÉDITO NETO	401,616,131,157	407,413,788,651
129000000000			CARTERA DE CRÉDITO NETA	401,616,131,157	407,413,788,651
129500000000			Cartera de crédito	418,341,591,821	423,354,343,348
130000000000			CARTERA DE CRÉDITO VIGENTE	401,686,224,950	412,269,358,603
	130100000000		Créditos comerciales	210,636,282,063	226,107,420,450
		130107010000	Actividad empresarial o comercial	176,478,925,000	180,786,493,424
		130107020000	Entidades financieras	22,119,447,349	31,618,581,469
		130107030000	Entidades gubernamentales	12,037,909,714	13,702,345,557
	131100000000		Créditos de consumo	34,864,987,506	41,904,355,745
	132100000000		Créditos a la vivienda	156,184,955,381	144,257,582,408
		132107010000	Media y residencial	149,923,522,555	138,934,387,366
		132107020000	De interés social	5,216,671	8,405,693
		132107030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	6,256,216,155	5,314,789,349
		132107040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
	133100000000		Créditos otorgados en calidad de agente del Gobierno Federal	0	0
135000000000			CARTERA DE CRÉDITO VENCIDA	16,655,366,871	11,084,984,745
	135051000000		Créditos comerciales	7,918,022,440	5,081,432,596
		135051010000	Actividad empresarial o comercial	7,870,565,969	4,999,917,333
		135051020000	Entidades financieras	47,456,471	81,515,263
		135051030000	Entidades gubernamentales	0	0
	135061000000		Créditos de consumo	1,577,521,743	1,224,345,491
	135071000000		Créditos a la vivienda	7,159,822,688	4,779,206,658
		135071010000	Media y residencial	7,001,222,936	4,712,778,908
		135071020000	De interés social	14,657,235	20,633,395
		135071030000	Créditos adquiridos al INFONAVIT o el FOVISSSTE	143,942,517	45,794,355
		135071040000	Remodelación o mejoramiento con garantía otorgada por la Banca de Desarrollo o fideicomisos públicos	0	0
139000000000			ESTIMACIÓN PREVENTIVA PARA RIESGOS CREDITICIOS	-16,725,460,664	-15,940,554,697
139700000000			Derechos de cobro (neto)	0	0
	139798000000		DERECHOS DE COBRO ADQUIRIDOS	0	0
	139799000000		ESTIMACIÓN POR IRRECUPERABILIDAD O DIFÍCIL COBRO	0	0
179700000000			BENEFICIOS POR RECIBIR EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
140000000000			Otras cuentas por cobrar	30,087,222,868	20,604,376,327
150000000000			Bienes adjudicados	113,581,027	241,489,526
160000000000			Propiedades, mobiliario y equipo	4,075,894,660	3,302,451,667
170000000000			INVERSIONES PERMANENTES	51,967,385	51,439,297
179500000000			ACTIVOS DE LARGA DURACIÓN DISPONIBLES PARA LA VENTA	18,353,454	21,650,131
180000000000			Impuestos y ptu diferidos (a favor)	8,420,555,159	6,128,722,494
190000000000			OTROS ACTIVOS	7,401,540,308	5,789,086,836
	190300000000		Cargos diferidos, pagos anticipados e intangibles	7,401,540,308	5,789,067,131
	191600000000		Otros activos a corto y largo plazo	0	19,705
200000000000			P A S I V O	585,615,533,931	611,786,150,448
210000000000			CAPTACIÓN TRADICIONAL	407,752,654,817	407,167,197,517
	210100000000		Depósitos de exigibilidad inmediata	212,445,834,582	189,258,320,401
	211100000000		Depósitos a plazo	164,316,633,953	181,270,911,209
		211101000000	Del público en general	162,311,295,607	154,040,516,077
		211102000000	Mercado de dinero	2,005,338,346	27,230,395,132
		211103000000	Fondos especiales	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	CIERRE PERIODO ACTUAL IMPORTE	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR IMPORTE
	212500000000		Títulos de crédito emitidos	30,142,463,533	36,030,368,920
	216100000000		Cuenta global de captación sin movimientos	847,722,749	607,596,987
230000000000			PRÉSTAMOS INTERBANCARIOS Y DE OTROS ORGANISMOS	50,255,131,392	65,675,414,050
	230100000000		De exigibilidad inmediata	0	0
	230200000000		De corto plazo	18,927,774,130	23,851,409,575
	230300000000		De largo plazo	31,327,357,262	41,824,004,475
203000000000			VALORES ASIGNADOS POR LIQUIDAR	14,832,117,553	10,989,056,425
220800000000			ACREEDORES POR REPORTE	50,449,818,003	46,965,594,933
220700000000			PRÉSTAMO DE VALORES	54,257	13,710
220900000000			COLATERALES VENDIDOS O DADOS EN GARANTÍA	1,870,156,434	587,737,307
	220901000000		Reportos	0	0
	220902000000		Préstamo de valores	1,870,156,434	587,737,307
	220903000000		Derivados	0	0
	220990000000		Otros colaterales vendidos	0	0
221400000000			DERIVADOS	20,602,097,003	25,392,994,853
	221406000000		Con fines de negociación	16,055,425,582	18,752,289,795
	221407000000		Con fines de cobertura	4,546,671,421	6,640,705,058
221700000000			AJUSTES DE VALUACIÓN POR COBERTURA DE PASIVOS FINANCIEROS	9,004,307	14,262,822
221900000000			OBLIGACIONES EN OPERACIONES DE BURSATILIZACIÓN	0	0
225000000000			Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	0	0
240000000000			OTRAS CUENTAS POR PAGAR	29,220,533,983	44,219,663,118
	240200000000		Impuestos a la utilidad por pagar	864,056,637	1,219,779,953
	240800000000		Participación de los trabajadores en las utilidades por pagar	438,856,710	0
	240300000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital pendientes de formalizar por su órgano de gobierno	0	0
	240900000000		Acreedores por liquidación de operaciones	8,427,874,338	30,806,955,509
	241000000000		Acreedores por cuentas de margen	0	0
	241300000000		Acreedores por colaterales recibidos en efectivo	637,135,742	1,371,456,480
	240100000000		Acreedores diversos y otras cuentas por pagar	18,852,610,556	10,821,471,176
270000000000			OBLIGACIONES SUBORDINADAS EN CIRCULACIÓN	9,096,341,472	9,093,676,837
280000000000			Impuestos y ptu diferidos (a cargo)	0	0
290000000000			CRÉDITOS DIFERIDOS Y COBROS ANTICIPADOS	1,527,624,710	1,680,538,876
400000000000			CAPITAL CONTABLE	64,055,077,773	54,668,203,692
450000000000			Participación controladora	64,053,983,371	54,667,991,167
410000000000			CAPITAL CONTRIBUIDO	11,575,052,037	10,876,764,482
	410100000000		Capital social	10,457,688,673	10,404,165,369
	410700000000		Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su órgano de gobierno	0	0
	410400000000		Prima en venta de acciones	1,117,363,364	472,599,113
	411100000000		Obligaciones subordinadas en circulación	0	0
420000000000			CAPITAL GANADO	52,478,931,334	43,791,226,685
	420100000000		Reservas de capital	7,059,716,497	6,757,848,750
	420300000000		Resultado de ejercicios anteriores	39,156,377,597	36,427,621,378
	420500000000		Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-70,701,797	477,980,484
	421500000000		Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	178,186,169	-1,021,371,876
	421700000000		Efecto acumulado por conversión	0	0
	422300000000		Remediones por beneficios definidos a los empleados	-931,368,386	-787,771,543
	420900000000		Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0
	421100000000		Resultado neto	7,086,721,254	1,936,919,492
430000000000			PARTICIPACIÓN NO CONTROLADORA	1,094,402	212,525
	431000000000		Resultado neto correspondiente a la participación no controladora	879,765	8,959
	439000000000		Otra participación no controladora	214,637	203,566
700000000000			CUENTAS DE ORDEN	2,966,416,307,563	2,858,128,842,116
710000000000			Avales otorgados	0	0
790000000000			Activos y pasivos contingentes	0	0
730000000000			Compromisos crediticios	278,154,795,738	274,944,059,448
740000000000			Bienes en fideicomiso o mandato	417,613,272,933	377,739,798,384
	740100000000		Fideicomisos	388,553,480,621	348,627,341,299
	740200000000		Mandatos	29,059,792,312	29,112,457,085
770300000000			Agente financiero del Gobierno Federal	0	0
750000000000			Bienes en custodia o en administración	663,842,687,658	598,896,474,687
773100000000			Colaterales recibidos por la entidad	28,173,420,297	56,239,194,468

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

BALANCE GENERAL DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

Impresión Final

(PESOS)

				CIERRE PERIODO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	SUB-SUBCUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
773200000000			Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	1,870,156,434	2,547,743,524
760000000000			Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros	126,334,925,118	134,249,223,638
771000000000			Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito vencida	873,259,445	596,181,241
780000000000			Otras cuentas de registro	1,449,553,789,940	1,412,916,166,726

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03**

AÑO: **2021**

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

ESTADO DE RESULTADOS DE INSTITUCIONES DE CRÉDITO

CONSOLIDADO

DEL 1 DE ENERO AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	TRIMESTRE AÑO ACTUAL	TRIMESTRE AÑO ANTERIOR
		IMPORTE	IMPORTE
510000000000	Ingresos por intereses	32,808,675,141	37,067,149,564
610000000000	Gastos por intereses	14,428,334,281	18,303,578,000
520000000000	Resultado por posición monetaria neto (margen financiero)	0	0
670100000000	MARGEN FINANCIERO	18,380,340,860	18,763,571,564
620000000000	Estimación preventiva para riesgos crediticios	3,380,775,707	8,010,592,529
670200000000	MARGEN FINANCIERO AJUSTADO POR RIESGOS CREDITICIOS	14,999,565,153	10,752,979,035
530000000000	Comisiones y tarifas cobradas	4,214,937,503	3,563,583,870
630000000000	Comisiones y tarifas pagadas	626,459,004	742,629,680
540000000000	Resultado por intermediación	976,150,551	1,825,551,237
505000000000	Otros ingresos (egresos) de la operación	1,482,346,742	1,139,643,216
590000000000	Subsidios	0	0
640000000000	Gastos de administración y promoción	11,890,850,350	13,960,217,419
670400000000	RESULTADO DE LA OPERACIÓN	9,155,690,595	2,578,910,259
570000000000	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	881,900	1,011,758
672500000000	RESULTADO ANTES DE IMPUESTOS A LA UTILIDAD	9,156,572,495	2,579,922,017
660000000000	Impuestos a la utilidad causados	1,464,021,997	1,906,651,535
560000000000	Impuestos a la utilidad diferidos	-604,949,479	1,263,657,969
670700000000	RESULTADO ANTES DE OPERACIONES DISCONTINUADAS	7,087,601,019	1,936,928,451
580000000000	Operaciones discontinuadas	0	0
671100000000	RESULTADO NETO	7,087,601,019	1,936,928,451
670900000000	Participación controladora	7,086,721,254	1,936,919,492
671300000000	Participación no controladora	879,765	8,959

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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 2021 Y 2020

CONSOLIDADO

(PESOS)

Impresión Final

CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	AÑO ACTUAL IMPORTE	AÑO ANTERIOR IMPORTE
820103500000		Resultado neto	7,087,601,019	1,936,928,451
820103600000		Ajustes por partidas que no implican flujo de efectivo:	5,683,522,070	9,792,001,558
	820103600100	Pérdidas por deterioro o efecto por reversión del deterioro asociados a actividades de inversión	-42,236,231	52,184,593
	820103600200	Depreciaciones de propiedades, mobiliario y equipo	366,889,519	372,116,159
	820103600300	Amortizaciones de activo intangibles	396,207,957	292,028,186
	820103600400	Provisiones	1,137,228,150	8,474,884,518
	820103600500	Impuestos a la utilidad causados y diferidos	2,068,971,476	642,993,566
	820103600600	Participación en el resultado de subsidiarias no consolidadas, asociadas y negocios conjuntos	-881,900	-1,011,758
	820103600700	Operaciones discontinuadas	0	0
	820103609000	Otros	1,757,343,099	-41,193,706
		Actividades de operación		
	820103010000	Cambio en cuentas de margen	2,016,995,490	-1,587,119,375
	820103020000	Cambio en inversiones en valores	7,861,567,677	-35,737,229,873
	820103030000	Cambio en deudores por reporto	10,307,973,614	-25,761,448,937
	820103040000	Cambio en préstamo de valores (activo)	0	0
	820103050000	Cambio en derivados (activo)	3,918,806,784	-9,436,680,198
	820103060000	Cambio de cartera de crédito (neto)	-6,854,077,963	-13,299,275,206
	820103070000	Cambio en derechos de cobro adquiridos (neto)	0	0
	820103080000	Cambio en beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	0	0
	820103090000	Cambio en bienes adjudicados (neto)	79,687,689	-129,068,962
	820103100000	Cambio en otros activos operativos (neto)	-13,678,708,773	-822,987,849
	820103110000	Cambio en captación tradicional	3,015,694,059	42,296,113,172
	820103120000	Cambio en préstamos interbancarios y de otros organismos	-16,356,848,094	10,033,250,332
	820103130000	Cambio en acreedores por reporto	7,558,490,091	-2,169,369,349
	820103140000	Cambio en préstamo de valores (pasivo)	38,334	13,710
	820103150000	Cambio en colaterales vendidos o dados en garantía	1,347,372,804	587,737,307
	820103160000	Cambio en derivados (pasivo)	-6,261,096,575	10,434,553,993
	820103170000	Cambio en obligaciones en operaciones de bursatilización	0	0
	820103180000	Cambio en obligaciones subordinadas con características de pasivo	44,755,825	47,850,682
	820103190000	Cambio en otros pasivos operativos	-1,877,046,331	13,686,266,772
	820103200000	Cambio en instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de operación)	0	0
	820103230000	Cobros de impuestos a la utilidad (devoluciones)	0	0
	820103240000	Pagos de impuestos a la utilidad	-2,034,081,888	-1,495,083,175
	820103900000	Otros	0	0
820103000000		Flujos netos de efectivo de actividades de operación	-10,910,477,257	-13,352,476,956
		Actividades de inversión		
	820104010000	Cobros por disposición de propiedades, mobiliario y equipo	4,810,157	0
	820104020000	Pagos por adquisición de propiedades, mobiliario y equipo	-430,856,080	-265,978,066
	820104030000	Cobros por disposición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	0	0
	820104040000	Pagos por adquisición de subsidiarias, asociadas y acuerdos con control conjunto	-1,060	0
	820104050000	Cobros por disposición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104060000	Pagos por adquisición de otras inversiones permanentes	0	0
	820104070000	Cobros de dividendos en efectivo	666,698	1,044,492
	820104080000	Pagos por adquisición de activos intangibles	-1,862,743,962	-115,663,045
	820104090000	Cobros por disposición de activos de larga duración disponibles para la venta	0	0
	820104100000	Cobros por disposición de otros activos de larga duración	0	0
	820104110000	Pagos por adquisición de otros activos de larga duración	0	0
	820104120000	Cobros asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104130000	Pagos asociados a instrumentos de cobertura (de partidas cubiertas relacionadas con actividades de inversión)	0	0
	820104900000	Otros	0	0
820104000000		Flujos netos de efectivo de actividades de inversión	-2,288,124,247	-380,596,619
		Actividades de financiamiento		
	820105010000	Cobros por emisión de acciones	0	0
	820105020000	Pagos por reembolsos de capital social	0	0
	820105030000	Pagos de dividendos en efectivo	0	0
	820105040000	Pagos asociados a la recompra de acciones propias	0	0
	820105050000	Cobros por la emisión de obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105060000	Pagos asociados a obligaciones subordinadas con características de capital	0	0
	820105900000	Otros	0	0
820105000000		Flujos netos de efectivo de actividades de financiamiento	0	0

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

**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 2021 Y 2020

**CONSOLIDADO
Impresión Final**

(PESOS)

			AÑO ACTUAL	AÑO ANTERIOR
CUENTA	SUB-CUENTA	CUENTA / SUBCUENTA	IMPORTE	IMPORTE
820100000000		Incremento o disminución neta de efectivo y equivalentes de efectivo	-427,478,415	-2,004,143,566
820400000000		Efectos por cambios en el valor del efectivo y equivalentes de efectivo	0	0
820200000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al inicio del periodo	29,954,562,605	37,943,486,324
820000000000		Efectivo y equivalentes de efectivo al final del periodo	29,527,084,190	35,939,342,758

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

ESTADO DE VARIACIONES EN EL CAPITAL CONTABLE DE INSTITUCIONES DE

AL 30 DE SEPTIEMBRE DE 2021 Y 2020

CRÉDITO

(PESOS)

CONSOLIDADO

Impresión Final

Concepto	Participación controladora	Capital contribuido				Capital Ganado								Participación no controladora	Capital contable
		Capital social	Aportaciones para futuros aumentos de capital formalizadas por su Órgano de Gobierno	Prima en venta de acciones	Obligaciones subordinadas en circulación	Reservas de capital	Resultado de ejercicios anteriores	Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	Efecto Acumulado por conversión	Remediones por beneficios definidos a los empleados	Resultado por tenencia de activos no monetarios	Resultado neto		
Saldo al inicio del periodo	55,321,125,241	10,404,165,369	0	472,599,113	0	6,757,848,750	36,432,175,039	416,755,619	-1,161,122,172	0	-1,019,973,949	0	3,018,677,472	214,637	55,321,339,878
MOVIMIENTOS INHERENTES A LAS DECISIONES DE LOS PROPIETARIOS															
Suscripción de acciones	698,287,555	53,523,304	0	644,764,251	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	698,287,555
Capitalización de utilidades	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Constitución de reservas	0	0	0	0	0	301,867,747	0	0	0	0	0	0	-301,867,747	0	0
Traspaso del resultado neto a resultado de ejercicios anteriores	0	0	0	0	0	0	2,716,809,725	0	0	0	0	0	-2,716,809,725	0	0
Pago de dividendos	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Total por movimientos inherentes a las decisiones de los propietarios	698,287,555	53,523,304	0	644,764,251	0	301,867,747	2,716,809,725	0	0	0	0	0	-3,018,677,472	0	698,287,555
MOVIMIENTOS INHERENTES AL RECONOCIMIENTO DE LA UTILIDAD INTEGRAL															
-Resultado neto	7,086,721,254	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	7,086,721,254	879,765	7,087,601,019
-Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta	-487,457,416	0	0	0	0	0	0	-487,457,416	0	0	0	0	0	0	-487,457,416
-Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo.	1,339,308,341	0	0	0	0	0	0	0	1,339,308,341	0	0	0	0	0	1,339,308,341
-Efecto acumulado por conversión	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Remediones por beneficios definidos a los empleados	88,605,563	0	0	0	0	0	0	0	0	0	88,605,563	0	0	0	88,605,563
-Resultado por tenencia de activos no monetarios	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Otros	7,392,833	0	0	0	0	0	7,392,833	0	0	0	0	0	0	0	7,392,833
Total de movimientos inherentes al reconocimiento de la utilidad integral	8,034,570,575	0	0	0	0	0	7,392,833	-487,457,416	1,339,308,341	0	88,605,563	0	7,086,721,254	879,765	8,035,450,340
Saldo al final del periodo	64,053,983,371	10,457,688,673	0	1,117,363,364	0	7,059,716,497	39,156,377,597	-70,701,797	178,186,169	0	-931,368,386	0	7,086,721,254	1,094,402	64,055,077,773

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 1 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

(1) Autorización y bases de presentación-

Autorización

El 19 de Octubre de 2021, Adrián Otero Rosiles (Director General de Scotiabank Inverlat, S. A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat), Carlos Marcelo Brina (Director General Adjunto de Finanzas), Jorge Córdova Estrada (Director General Adjunto Auditoría Grupo) y H. Valerio Bustos Quiroz (Director Contabilidad Grupo) autorizaron la emisión de los estados financieros consolidados adjuntos y sus notas.

Los estados financieros consolidados del Banco incluyen los de las subsidiarias en las que ejerce control: la Inmobiliaria, Scotia Servicios y Scotia Derivados. Los saldos y operaciones importantes con estas compañías se han eliminado en la preparación de los estados financieros consolidados.

La consolidación se efectuó con base en los estados financieros auditados de las compañías subsidiarias al 31 de diciembre de 2020 y 2019.

Los accionistas y la Comisión Nacional Bancaria y de Valores (la Comisión Bancaria) tienen facultades para modificar los estados financieros consolidados después de su emisión. Los estados financieros consolidados de 2021 adjuntos, se someterán a la aprobación de la próxima Asamblea de Accionistas.

Bases de presentación

a) Declaración de cumplimiento

Los estados financieros consolidados adjuntos se prepararon de conformidad con la legislación bancaria y de acuerdo con los criterios de contabilidad para las instituciones de crédito en México, establecidos por la Comisión Bancaria (los Criterios Contables), quien tiene a su cargo la inspección y vigilancia de las instituciones de crédito, así como la revisión de su información financiera.

Los Criterios Contables señalan que a falta de criterio contable expreso de la Comisión Bancaria para las instituciones de crédito, y en un contexto más amplio de las Normas de Información Financiera (NIF) emitidas por el Consejo Mexicano de Normas de Información Financiera, A. C. (CINIF), se observará el proceso de supletoriedad establecido en la NIF A-8 y, sólo en caso de que las Normas Internacionales de Información Financiera (NIIF) a que se refiere la NIF A-8 no den solución al reconocimiento contable, se podrá optar por una norma supletoria que pertenezca a cualquier otro esquema normativo, siempre que cumpla con todos los requisitos señalados en la mencionada NIF, debiéndose aplicar la supletoriedad en el siguiente orden: los principios de contabilidad generalmente aceptados en los Estados Unidos de América (US GAAP) y después cualquier norma de contabilidad que forme parte de un conjunto de normas formal y reconocido, siempre y cuando no contravengan los criterios de la Comisión Bancaria.

b) Uso de juicios y estimaciones

La preparación de los estados financieros consolidados requiere que la Administración efectúe estimaciones y suposiciones que afectan los importes registrados de activos y pasivos y la revelación de activos y pasivos contingentes a la fecha de los estados financieros consolidados, así como los importes registrados de ingresos y gastos

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 2 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

durante el ejercicio. Los resultados reales pueden diferir de estas estimaciones y suposiciones.

Juicios

La información sobre juicios realizados en la aplicación de políticas contables que tienen el efecto más importante sobre los importes reconocidos en los estados financieros consolidados se describe en las notas a los estados financieros consolidados que se mencionan más adelante.

Supuestos e incertidumbres en las estimaciones

La información sobre supuestos e incertidumbres de estimación que tienen un riesgo significativo de resultar en un ajuste material a los importes en los libros de activos y pasivos en el siguiente año se incluye en las siguientes notas a los estados financieros consolidados:

-Valuación de instrumentos financieros derivados: supuestos claves para determinar el valor de mercado, sobre todo aquellos derivados complejos o sin un mercado activo;

-Determinación de la estimación preventiva para riesgos crediticios: supuestos e insumos utilizados en su determinación;

-Deterioro de inmuebles, mobiliario y equipo: Pruebas de deterioro del valor de activos fijos, incluyendo los supuestos claves para determinación del importe recuperable de dichos activos;

-Medición de obligaciones por beneficios definidos: supuestos actuariales claves;

-Reconocimiento de activos por impuestos diferidos: disponibilidad de utilidades futuras gravables y la materialización de los impuestos diferidos.

c) Moneda funcional y de informe

Los estados financieros consolidados antes mencionados se presentan en moneda de informe peso mexicano, que es igual a la moneda de registro y a su moneda funcional.

Para propósitos de revelación en las notas a los estados financieros consolidados, cuando se hace referencia a pesos o "\$", se trata de millones de pesos mexicanos, y cuando se hace referencia a dólares o "USD", se trata de millones de dólares de los Estados Unidos de América.

d) Reconocimiento de activos y pasivos por instrumentos financieros

Los estados financieros consolidados adjuntos reconocen los activos y pasivos provenientes de operaciones de compraventa de divisas, inversiones en valores, reportos y derivados en la fecha en que la operación es concertada, independientemente de su fecha de liquidación.

(2) Resumen de las principales políticas contables-

Las políticas contables que se muestran en la preparación de los estados financieros consolidados que se presentan a continuación, han sido aplicadas consistentemente por el Banco, excepto por los Criterios Contables especiales aplicados en el año.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 3 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

(a) Reconocimiento de los efectos de la inflación-

Los estados financieros consolidados adjuntos incluyen el reconocimiento de la inflación con base en Unidades de Inversión (UDI) hasta el 31 de diciembre de 2007, de acuerdo con los Criterios Contables aplicables.

Los ejercicios terminados el 31 de diciembre de 2020 y 2019, son considerados como entorno económico no inflacionario (inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores menor que el 26%), conforme a lo establecido en la NIF B-10 "Efectos de la inflación"; consecuentemente no se reconocen los efectos de la inflación en la información financiera del Banco. En caso de que se vuelva a estar en un entorno inflacionario, se deberán registrar de manera retrospectiva los efectos acumulados de la inflación no reconocidos en los periodos en los que el entorno fue calificado como no inflacionario. El porcentaje de inflación acumulada de los tres ejercicios anuales anteriores se muestra a continuación:

Inflación	31 de diciembre de	UDIDel	año	Acumulada
-----------	--------------------	--------	-----	-----------

2020	6.6055973.23%	11.31%
------	---------------	--------

2019	6.3990182.77%	15.03%
------	---------------	--------

2018	6.2266314.92%	15.71%
------	---------------	--------

(b) Bases de consolidación-

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

Las subsidiarias consolidadas con el Banco al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se detallan a continuación:

Subsidiaria	Participación	Ubicación	Actividad
Inmobiliaria	99.99%	Ciudad de México	Administración de activo fijo
Scotia Servicios	99.99%	Ciudad de México	Apoya la administración del negocio adquirente de tarjeta de crédito
Scotia Derivados	99.99%	Ciudad de México	Operador de contratos de futuros y opciones en Mexder

(c) Disponibilidades-

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 4 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(d) Cuentas de margen-

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 5 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

parciales o totales que la cámara de compensación deposita o retira y por las aportaciones adicionales o retiros efectuados por el Banco.

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

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

(e) Inversiones en valores-

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

Títulos para negociar-

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

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

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

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

Títulos disponibles para la venta-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 6 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

Son aquellos cuya intención no está orientada a obtener ganancias derivadas de las diferencias en precios en el corto plazo ni se tiene la intención o capacidad de mantenerlos hasta su vencimiento. El reconocimiento inicial y la valuación posterior se llevan a cabo de igual manera que los títulos para negociar, excepto que el efecto de valuación, se reconoce en el capital contable en el rubro de "Resultado por valuación de títulos disponibles para la venta", el cual se ajusta por el efecto de impuestos diferidos. El efecto por valuación se cancela para reconocerlo en resultados al momento de la venta en el rubro de "Resultado por intermediación".

La valuación de los instrumentos de esta categoría designados como partida cubierta por derivados de cobertura a valor razonable, es reconocida en el rubro de "Resultado por intermediación".

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

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

Títulos conservados al vencimiento-

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

Deterioro del valor de un título-

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 7 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

Al 31 de diciembre de 2020 y 2019, la Administración del Banco no ha identificado que exista evidencia objetiva del deterioro de algún título.

Operaciones fecha valor-

Los títulos adquiridos que se pacte liquidar en fecha posterior hasta un plazo máximo de cuatro días hábiles siguientes a la concertación de la operación de compraventa, se reconocen como títulos restringidos, en tanto que, los títulos vendidos se reconocen como títulos por entregar disminuyendo las inversiones en valores. La contrapartida deberá ser una cuenta liquidadora, acreedora o deudora, según corresponda. Cuando el monto de títulos por entregar excede el saldo de títulos en posición propia de la misma naturaleza (gubernamentales, bancarios, accionarios y otros títulos de deuda), se presenta en el pasivo dentro del rubro de "Valores asignados por liquidar".

Reclasificación entre categorías-

Los Criterios Contables permiten efectuar reclasificaciones de la categoría de títulos conservados al vencimiento hacia títulos disponibles para la venta, siempre y cuando no se tenga la intención o capacidad de mantenerlos hasta el vencimiento. El resultado por valuación correspondiente a la fecha de reclasificación se reconoce en el capital contable. En caso de reclasificaciones hacia la categoría de títulos conservados a vencimiento, o de títulos para negociar hacia disponibles para la venta, se podría efectuar únicamente con autorización expresa de la Comisión Bancaria. Asimismo, en caso de ventas de títulos conservados a vencimiento deberá informarse a la Comisión Bancaria. Durante los años terminados el 31 de diciembre de 2020 y 2019, el Banco no llevó a cabo transferencias entre categorías, ni ventas de títulos conservados a vencimiento.

(f) Préstamo de valores-

En la fecha de contratación de las operaciones de préstamo de valores actuando el Banco como prestamista, en lo que se refiere a los valores objeto del préstamo, se reclasifican como restringidos en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores"; mientras que actuando como prestatario se reconocen en cuentas de orden en el rubro de "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

El importe del premio devengado actuando el Banco como prestamista o prestatario se reconoce en los resultados consolidados del ejercicio, a través del método de interés efectivo durante la vigencia de la operación en el rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", respectivamente, contra el rubro de "Préstamo de valores" dentro del activo o pasivo, según corresponda.

En el caso de que el Banco, previo al vencimiento de la operación de préstamo de valores, venda el colateral recibido como prestamista o el valor objeto de la operación como prestatario, reconoce la entrada de los recursos procedentes de la venta, así como la obligación de restituir dicho colateral al prestatario o el valor objeto de la operación al prestamista dentro del rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", dicha obligación es medida inicialmente al precio pactado y posteriormente se valúa a valor razonable, el efecto por valuación se presenta en resultados dentro del rubro de "Resultado por intermediación".

La diferencia entre el precio recibido y el valor razonable del valor objeto de la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 8 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

operación o de los colaterales recibidos, que en su caso exista en el momento de vender, se presenta en el rubro de "Resultado por intermediación".

(g) Operaciones de reporto-

En la fecha de contratación de la operación de reporto, el Banco actuando como reportada reconoce la entrada del efectivo o bien una cuenta liquidadora deudora, así como una cuenta por pagar; mientras que actuando como reportadora reconoce la salida de disponibilidades o bien una cuenta liquidadora acreedora, así como una cuenta por cobrar. Tanto la cuenta por pagar como la cuenta por cobrar son medidas inicialmente al precio pactado, lo cual representa la obligación de restituir o el derecho a recuperar el efectivo, respectivamente.

A lo largo de la vigencia del reporto la cuenta por cobrar y por pagar se valúan a su costo amortizado, mediante el reconocimiento del interés por reporto en los resultados del ejercicio conforme se devengue, de acuerdo al método de interés efectivo; dicho interés se reconoce dentro del rubro de "Ingresos por intereses" o "Gastos por intereses", según corresponda. La cuenta por cobrar y por pagar, así como los intereses devengados se presentan en el rubro de "Deudores por reporto" y "Acreedores por reporto", respectivamente.

El Banco actuando como reportadora reconoce el colateral recibido en cuentas de orden en el rubro "Colaterales recibidos por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes". Los activos financieros otorgados como colateral, actuando el Banco como reportada se reclasifican en el balance general consolidado dentro del rubro de "Inversiones en valores", presentándolos como restringidos.

En caso de que el Banco, actuando como reportadora venda el colateral o lo otorgue en garantía, reconoce los recursos procedentes de la transacción, así como una cuenta por pagar por la obligación de restituir el colateral a la reportada, la cual se valúa, para el caso de venta a su valor razonable o, en caso de que sea dado en garantía en otra operación de reporto, a su costo amortizado. Dicha cuenta por pagar se compensa con la cuenta por cobrar que es reconocida cuando el Banco actuando como reportadora se convierte a su vez en reportada y, se presenta el saldo deudor o acreedor en el rubro de "Deudores por reporto" o en el rubro de "Colaterales vendidos o dados en garantía", según corresponda.

Adicionalmente, el colateral recibido, entregado o vendido se reconoce en cuentas de orden dentro del rubro de "Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad", siguiendo para su valuación los lineamientos del criterio B-9 "Custodia y administración de bienes".

(h) Derivados-

Las operaciones con instrumentos financieros derivados comprenden aquellas con fines de negociación y de cobertura; los derivados sin consideración de su intencionalidad se reconocen a valor razonable.

El efecto por valuación de los derivados con fines de negociación se presenta en el balance general consolidado y en el estado consolidado de resultados dentro de los rubros "Derivados", en el activo o pasivo, según corresponda, y "Resultado por intermediación", respectivamente. El efecto por el riesgo de crédito (contraparte) de los derivados, debe determinarse de acuerdo a la metodología del área de riesgos, y debe reconocerse en los resultados en el periodo en que ocurra contra la cuenta complementaria.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 9/ 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

La porción efectiva del resultado por valuación de las coberturas designadas como de flujo de efectivo se reconoce en el capital contable dentro del rubro "Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo", en tanto que la porción inefectiva del cambio en el valor razonable se reconoce de manera inmediata en resultados dentro del rubro "Resultado por intermediación" y la contracuenta con dicho efecto se presenta en el balance general consolidado dentro del rubro de "Derivados". La ganancia o pérdida asociada a la cobertura de la transacción pronosticada que haya sido reconocida en el capital contable, se reclasifica al estado consolidado de resultados dentro del mismo rubro donde se presenta el resultado por valuación de la partida cubierta atribuible al riesgo cubierto, en el mismo periodo durante el cual los flujos de efectivo pronosticados cubiertos afecten los resultados del ejercicio.

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

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

Derivados implícitos y estructurados

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

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

El valor razonable del componente derivado se registra dentro de los rubros de "Derivados" y "Resultado por intermediación, neto". Los intereses devengados se reconocen en el rubro de "Gastos por intereses".

Colaterales otorgados y recibidos en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos-

El colateral es una garantía constituida para asegurar el pago de las contraprestaciones pactadas en contratos con instrumentos financieros derivados en operaciones no realizadas en mercados o bolsas reconocidos.

El otorgamiento de colaterales entregados en efectivo en operaciones de derivados no realizadas en mercados o bolsas reconocidos se registran como una cuenta por cobrar que

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 10 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto", mientras que los colaterales recibidos en efectivo se registran en el rubro de "Acreedores por colaterales recibidos en efectivo".

Los colaterales entregados en títulos se registran como títulos restringidos por garantías, y los colaterales recibidos en títulos por operaciones de derivados se registran en cuentas de orden.

(i) Compensación de cuentas liquidadoras-

Los montos por cobrar o por pagar provenientes de inversiones en valores, operaciones de reporto y/o de operaciones con derivados que lleguen a su vencimiento y que a la fecha no hayan sido liquidados se registran en cuentas liquidadoras, incluyendo los montos por cobrar o por pagar que resulten de operaciones de compraventa de divisas en las que no se pacte liquidación inmediata o en las de fecha valor mismo día.

Los saldos de las cuentas liquidadoras deudoras y acreedoras son compensados siempre y cuando se tenga el derecho contractual de compensar los importes reconocidos y la intención de liquidar la cantidad neta, o de realizar el activo y cancelar el pasivo, simultáneamente.

Las cuentas liquidadoras se presentan en el rubro de "Otras cuentas por cobrar, neto" o "Acreedores por liquidación de operaciones", según corresponda.

(j) Cartera de crédito-

Representa el saldo de la disposición total o parcial de las líneas de crédito otorgadas a los acreditados más los intereses devengados no cobrados, menos los intereses cobrados por anticipado. La estimación preventiva para riesgos crediticios se presenta deduciendo los saldos de la cartera de crédito.

Las líneas de crédito no dispuestas se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios". El monto que es dispuesto por el acreditado se considerará dentro de la cartera de crédito conforme a la categoría de cartera que le corresponda.

Al momento de su contratación, las operaciones con cartas de crédito se registran en cuentas de orden, en el rubro de "Compromisos crediticios", las cuales, al ser ejercidas por el cliente o por su contraparte se traspasan a la cartera de créditos.

Los créditos otorgados en garantía, se reconocen como créditos restringidos.

Cartera INFONAVIT-

La cartera en prórroga se integra por todos aquellos créditos a la vivienda originados por el Instituto del Fondo Nacional de la Vivienda para los Trabajadores (INFONAVIT) adquiridos por las entidades, y que en términos de la Ley del INFONAVIT, cuenten con alguna prórroga vigente en el pago de la amortización por concepto de capital e intereses ordinarios, al concluir la prórroga la cartera recibirá el tratamiento que le corresponda de: Régimen Ordinario de Amortización (ROA) o Régimen Especial de Amortización (REA). Lo anterior, siempre y cuando la entidad esté contractualmente obligada a respetar dicha prórroga en los mismos términos del organismo de referencia. REA es la modalidad de pago de los créditos cuyos derechos fueron adquiridos por el Banco al INFONAVIT, prevista por las "Reglas para el otorgamiento de créditos a los trabajadores derechohabientes del INFONAVIT" emitidas por el Consejo de Administración del INFONAVIT, las cuales señalan la metodología para la realización de los pagos de tales créditos.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 11/ 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Créditos e intereses vencidos-

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

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

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

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

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

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

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

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

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

3. Para el caso de cartera en prórroga y créditos a la vivienda, cuando las amortizaciones no hayan sido liquidadas en su totalidad en los términos pactados originalmente y presenten 90 o más días de vencidos:

a) los pagos correspondientes a los créditos que el Banco haya adquirido al INFONAVIT o el Fondo de la Vivienda del Instituto de Seguridad y Servicios Sociales de los Trabajadores del Estado (FOVISSSTE), conforme a la modalidad de pago correspondiente (REA o ROA), así como

b) los créditos otorgados a personas físicas destinados a la remodelación o mejoramiento de la vivienda sin propósito de especulación comercial que estén respaldados por el ahorro de la subcuenta de vivienda del acreditado.

El traspaso al rubro de "Cartera de crédito vencida" de los créditos a que se refiere el numeral 3 del párrafo anterior se sujetará al plazo excepcional de 180 o más días de incumplimiento a partir de la fecha en la que:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 12 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

a) los recursos del crédito sean dispuestos para el fin con que fueron otorgados;
b) el acreditado dé inicio a una nueva relación laboral por la que tenga un nuevo patrón, o
c) el Banco haya recibido el pago parcial de la amortización correspondiente. La excepción contenida en el presente inciso será aplicable siempre y cuando se trate de créditos bajo el esquema ROA, y cada uno de los pagos realizados durante dicho periodo representen, al menos, el 5% de la amortización pactada.

Las excepciones contenidas en los incisos a), b) y c) anteriores, no serán excluyentes entre sí.

Cuando un crédito es traspasado a cartera vencida, se suspende la acumulación de intereses devengados y se lleva el registro de los mismos en cuentas de orden. Asimismo, se suspende la amortización en resultados del ejercicio de los ingresos financieros devengados. Cuando dichos intereses son cobrados se reconocen directamente en resultados en el rubro de "Ingresos por intereses". El reconocimiento en resultados de los ingresos por intereses se reanuda cuando la cartera deja de considerarse como vencida.

Por los intereses devengados no cobrados correspondientes a créditos considerados como cartera vencida, se constituye una estimación por el equivalente al total de éstos al momento del traspaso del crédito como cartera vencida. Para los créditos vencidos en los que en su reestructuración se acuerde la capitalización de los intereses devengados no cobrados registrados previamente en cuentas de orden, se constituye una estimación por el total de dichos intereses. La estimación se cancela cuando se cuenta con evidencia de pago sostenido.

El traspaso de créditos de cartera vencida a vigente se realiza cuando los acreditados liquidan la totalidad de los saldos pendientes de pago (principal e intereses, entre otros), excepto los créditos reestructurados o renovados, que se traspasan a cartera vigente cuando éstos cumplen oportunamente con el pago sostenido.

Pago sostenido

Se considera que existe pago sostenido cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago sin retraso por el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición.

En los casos de los créditos que el Banco adquiriera al INFONAVIT, en los que esté obligada a respetar los términos que los organismos de referencia contrataron con los acreditados, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado haya cubierto sin retraso el monto total exigible de principal e intereses, como mínimo de una amortización en los créditos bajo el esquema de ROA y tres amortizaciones para los créditos bajo el esquema de REA.

En los créditos con pagos periódicos de principal e intereses cuyas amortizaciones sean menores o iguales a 60 días en los que se modifique la periodicidad del pago a periodos menores derivado de la aplicación de una reestructura, se considera que existe pago sostenido del crédito, cuando el acreditado presenta cumplimiento de pago de amortizaciones equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema original del crédito.

En el caso de los créditos consolidados, si dos o más créditos originan la

reclasificación al rubro de "Cartera de crédito vencida", para determinar las tres amortizaciones consecutivas requeridas para la existencia de pago sostenido, se deberá considerar el esquema original de pagos del crédito cuyas amortizaciones equivalga al plazo más extenso.

Tratándose de créditos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de si el pago de intereses es periódico o al vencimiento, se considera que existe pago sostenido del crédito cuando, ocurra alguno de los siguientes supuestos:

a) el acreditado haya cubierto al menos el 20% del monto original del crédito al momento de la reestructura o renovación, o bien,

b) se hubiere cubierto el importe de los intereses devengados conforme al esquema de pagos por reestructuración o renovación correspondientes a un plazo de 90 días.

El pago anticipado de las amortizaciones de créditos reestructurados o renovados (amortizaciones de créditos reestructurados o renovados que se paguen sin haber transcurrido los días naturales equivalentes a tres amortizaciones consecutivas del esquema de pagos del crédito, o en caso de créditos con amortizaciones que cubran periodos mayores a 60 días naturales, el pago de una exhibición), distintos de aquellos con pago único de principal al vencimiento, con independencia de los intereses se paguen periódicamente o al vencimiento, no se considera pago sostenido.

En cualquier caso, para que el Banco demuestre que existe pago sostenido, además de asegurarse que el acreditado cumpla con los lineamientos de pago sostenido indicados en los párrafos anteriores, debe tener a disposición de la Comisión Bancaria evidencia que justifique que el acreditado cuenta con capacidad de pago en el momento que se lleve a cabo la reestructura o renovación para responder a las nuevas condiciones del crédito. La evidencia mínima que deberá obtener lo que se señala a continuación:

- i. probabilidad de incumplimiento intrínseca al acreditado,
- ii. las garantías otorgadas al crédito reestructurado o renovado,
- iii. la prelación de pago frente a otros acreedores y,
- iv. la liquidez del acreditado ante la nueva estructura financiera del financiamiento.

Reestructuras y renovaciones

Un crédito se considera reestructurado cuando el acreditado solicita al Banco cualquiera de las siguientes situaciones:

1) Ampliación de garantías que amparan el crédito de que se trate, o bien,

2) Modificaciones a las condiciones originales del crédito o al esquema de pagos, entre las que se encuentran:

a) Cambio de la tasa de interés establecida para el plazo remanente del crédito;

b) Cambio de moneda o unidad de cuenta (por ejemplo, VSM o UDI);

c) Concesión de un plazo de espera respecto del cumplimiento de las obligaciones de pago conforme a los términos originales del crédito, excepto por los que forman parte de los programas de apoyo COVID, o

d) Prórroga del plazo del crédito.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 14 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

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

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

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

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

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

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

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

- i) Garantías: únicamente cuando impliquen la ampliación o sustitución de garantías por otras de mejor calidad.
- ii) Tasa de interés: cuando se mejore la tasa de interés pactada.
- iii) Moneda: siempre y cuando se aplique la tasa correspondiente a la nueva moneda.
- iv) Fecha de pago: solo en el caso de que el cambio no implique exceder o modificar la periodicidad de los pagos. En ningún caso el cambio en la fecha de pago deberá permitir la omisión de pago en periodo alguno.

Las reestructuras o renovaciones de créditos de cartera se efectúan en apego a lo establecido en las "Disposiciones de carácter general aplicables a las instituciones de crédito" y la viabilidad de las mismas es analizada de forma particular.

El Banco evalúa periódicamente si un crédito vencido debe permanecer en el balance general consolidado, o bien, ser castigado, siempre y cuando estén provisionados al 100%. Dicho castigo se realiza cancelando el saldo insoluto del crédito contra la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 15/ 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

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

Comisiones

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

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

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

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

Las comisiones y tarifas distintas a las cobradas por el otorgamiento del crédito, se reconocerán contra los resultados de ejercicio en el rubro de comisiones y tarifas cobradas, en la fecha en que se devenguen. En el caso de que una parte o la totalidad de la contraprestación recibida por el cobro de la comisión o tarifa correspondiente se reciban anticipadamente al devengamiento del ingreso relativo, dicho anticipo deberá reconocerse como un pasivo.

Costos y gastos relacionados al otorgamiento inicial del crédito

Los costos y gastos relacionados con el otorgamiento del crédito se reconocen como un cargo diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos por intereses", durante el plazo promedio de la vida de los créditos, excepto para las que se originen por créditos revolventes, las cuales son amortizadas

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 16/ 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

en un periodo de 12 meses contra el rubro del gasto que le corresponda de acuerdo a su naturaleza.

Para efectos del párrafo anterior, se entenderán como costos o gastos asociados con el otorgamiento del crédito, únicamente a aquellos que sean incrementales y relacionados directamente con actividades realizadas por las entidades para otorgar el crédito, por ejemplo la evaluación crediticia del deudor, evaluación y reconocimiento de las garantías, negociaciones para los términos del crédito, preparación y proceso de la documentación del crédito y cierre o cancelación de la transacción, incluyendo la proporción de la compensación a empleados directamente relacionada con el tiempo invertido en el desarrollo de esas actividades.

Adquisición de cartera de crédito

En la fecha de adquisición de la cartera se deberá reconocer el valor contractual de la cartera adquirida en el rubro de cartera de crédito, conforme al tipo de cartera que el originador hubiere clasificado; la diferencia que se origine respecto del precio de adquisición se registrará como se muestran en la siguiente hoja.

a) cuando el precio de adquisición sea menor al valor contractual de la misma, en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", hasta por el importe de la estimación preventiva para riesgos crediticios que, en su caso, se constituya conforme a lo indicado en el párrafo siguiente y el excedente como un crédito diferido, el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

b) cuando el precio de adquisición de la cartera sea mayor a su valor contractual, como un cargo diferido el cual se amortizará conforme se realicen los cobros respectivos, de acuerdo a la proporción que estos representen del valor contractual del crédito;

c) cuando provenga de la adquisición de créditos revolventes, se llevará dicha diferencia directamente a los resultados del ejercicio en la fecha de adquisición.

Criterios Contables Especiales (CCE), derivado de la contingencia sanitaria por COVID-19

Mediante oficios número P-285/2020 y 026/2020 de fecha 26 de marzo y 15 de abril de 2020, respectivamente, la Comisión Bancaria determinó emitir con carácter temporal, los CCE aplicables a los programas de apoyo otorgados por el Banco. Posteriormente, mediante oficio número P-325/2020 de fecha 23 de junio de 2020, la Comisión Bancaria indicó lo siguiente:

- Los CCE serán aplicados de manera general a los clientes que se hayan visto afectados y cuyos créditos estuvieran clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo 2020.
- El plazo para realizar los trámites de reestructuración o renovación deberán concluir a más tardar el 31 de julio de 2020.

Los programas de apoyo consisten en otorgar a los acreditados un diferimiento parcial o total de pagos de capital y/o intereses hasta por 4 meses y con posibilidad de extenderlo a 2 meses adicionales, otorgando un periodo de gracia total hasta de 6 meses. Será de 18 meses tratándose de créditos otorgados a los sectores primarios agrícola, ganadero, forestal y pesquero; y a los sectores industrial, comercial y servicios que estén integrados los citados sectores primarios.

Lo anterior será aplicable a los siguientes tipos de crédito y para clientes que se encuentren clasificados contablemente como vigentes al 31 de marzo de 2020:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 17 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Para los CCE no se consideran como reestructuras y/o renovaciones y serán consideradas como cartera vigente los siguientes:

1. Créditos con "pago único de principal al vencimiento y pagos periódicos de intereses, así como los créditos con pago único de principal e intereses al vencimiento", que sean reestructurados o renovados, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 79 del Criterio Contable B-6 "Cartera de Crédito" (el "Criterio Contable B-6") contenido en el Anexo 33 de la Circular única de Bancos, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

2. Para créditos con "pagos periódicos de principal e intereses", que se reestructuren o renueven, podrán considerarse como vigentes al momento en que se lleve a cabo dicho acto, sin que sea aplicable lo que establecen los párrafos 82 y 84 del Criterio Contable B-6, siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

3. Los créditos que desde su inicio se estipule su carácter revolvente, que se reestructuren o renueven, no se considerarán como cartera vencida en términos de lo establecido en el párrafo 80 y 81 del Criterio Contable B-6. Esto siempre y cuando, los acreditados estén clasificados contablemente como cartera vigente al 31 de marzo de 2020, acorde al párrafo 12 del Criterio Contable B-6.

En relación con los créditos citados en los numerales anteriores, estos no se considerarán como reestructurados conforme lo que establece el párrafo 40 del Criterio Contable B-6.

4. En caso de incluir quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sobre el saldo del crédito para apoyar a los acreditados, el Banco podrá diferir la constitución de Estimaciones Preventivas de Riesgos Crediticios, cuando el importe de quitas, condonaciones, bonificaciones o descuentos sea mayor que dichas estimaciones, se constituirá una reserva por la diferencia en un período que no exceda el ejercicio de 2020.

Mediante oficio número 141-5/2263/2020 de fecha 2 de septiembre de 2020, la Comisión Bancaria extendió el plazo hasta el 30 de septiembre de 2020 para que el Banco pudiera aplicar los planes de reestructura o renovación para aquellos clientes ya inscritos en el programa de apoyo al 31 de julio de 2020, y que requieren dos meses adicionales de diferimiento para que de esta forma cuenten con los 6 meses de diferimiento al amparo de los CCE, establecidos en los oficios de fechas 26 de marzo, 15 de abril y 23 de junio de 2020.

(k) Estimación preventiva para riesgos crediticios-

Se mantiene una estimación para riesgos crediticios, la cual, a juicio de la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 18 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

administración del Banco, es suficiente para cubrir cualquier pérdida que pudiera surgir tanto de los préstamos incluidos en su cartera de créditos, como otros riesgos crediticios de avales y compromisos irrevocables de conceder préstamos.

Cartera comercial - Las estimaciones para la cartera comercial se basan en la evaluación individual del riesgo crediticio de los acreditados y su clasificación, en apego a las "Disposiciones de carácter general aplicables a la metodología de calificación de la cartera crediticia de las instituciones de crédito" (las "Disposiciones"), establecidas por la Comisión Bancaria. La cartera crediticia estará sujeta a calificación, sin incluir aquellos créditos con garantía otorgada por Entidades de la Administración Pública Federal bajo control presupuestario directo, empresas productivas del Estado o aquellas señaladas en la fracción VI del artículo 112 de las Disposiciones, en los cuales el porcentaje de reserva será igual a 0.5%.

Las Disposiciones utilizan una metodología en la cual se clasifica a la cartera en diferentes grupos: en entidades federativas y municipios, proyectos de inversión con fuente de pago propia, fiduciarios que actúen al amparo de fideicomisos, entidades financieras y personas morales y físicas con actividad empresarial no incluidas en los grupos anteriores, a su vez, este último grupo deberá dividirse en dos subgrupos: personas morales y físicas con actividad empresarial con ingresos o ventas netas anuales mayores a 14 millones de UDIS y menores a 14 millones de UDIS. Para efectos de la calificación de proyectos con fuente de pago propia establece que la calificación se calculará mediante al análisis del riesgo del proyecto de inversión de acuerdo a su etapa de construcción u operación y mediante el sobrecosto de obra y los flujos de efectivo del proyecto. Para los demás grupos se establece una metodología de pérdida esperada por riesgo de crédito, considerando la probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Para la cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales iguales o mayores a 14 millones de UDIS, el Banco utiliza la metodología descrita en el Anexo 22 de las Disposiciones de la Comisión Bancaria.

La cartera de crédito con personas morales y físicas con actividad empresarial, con ingresos o ventas netas anuales menores a 14 millones de UDIS es calificada mediante la aplicación de la metodología descrita en el Anexo 21 de las Disposiciones, y para el caso de créditos con entidades financieras se utiliza la metodología descrita en el Anexo 20 de las mismas, en donde establece el concepto de probabilidad de incumplimiento, severidad de la pérdida y exposición al incumplimiento.

Las estimaciones realizadas al 31 de diciembre de 2020 y 2019 se determinaron conforme al grado de riesgo y los porcentajes de estimación preventiva siguientes:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.90%
A20.9011.50%
B11.5012.00%
B22.0012.50%
B32.5015.00%
C15.00110.00%
C210.00115.50%

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 19/ 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

D15.50145.00%
EMayor a 45.00%

Cartera hipotecaria incluyendo la originada y adquirida al INFONAVIT-

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

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

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se muestran a continuación:

Rangos de porcentaje de
Grado de riesgo estimación preventiva

A10.0000.50%
A20.5010.75%
B10.7511.00%
B21.0011.50%
B31.5012.00%
C12.0015.00%
C25.00110.00%
D10.00140.00%
E40.001100.00%

Cartera de consumo-

Para determinar la reserva de la cartera de consumo, ésta es separada en dos grupos: a) tarjeta de crédito (a partir del 1 de octubre de 2019) y otros créditos revolventes, y b) créditos no revolventes descritas en los Artículos 91 y 92 de las Disposiciones. Las reservas preventivas de tarjeta de crédito y otros créditos revolventes se calculan considerando una base de crédito por crédito, utilizando las cifras correspondientes al último período de pago conocido y considerando factores tales como: i) saldo a pagar, ii) pago realizado, iii) límite de crédito, iv) pago mínimo exigido, v) impago, vi) monto a pagar al Banco, vii) monto a pagar reportado en las sociedades de información crediticia, así como viii) antigüedad del acreditado en el Banco.

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 20 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los grados de riesgo y porcentajes de estimación al 31 de diciembre de 2020 y 2019, se muestran a continuación:

Rango de porcentaje de estimación preventiva

Tarjeta de crédito

y otros créditos

Grado de riesgo No revolventes / revolventes

A10.002.0% / 0.003.00%

A22.013.0% / 3.015.00%

B13.014.0% / 5.016.50%

B24.015.0% / 6.518.00%

B35.016.0% / 8.0110.00%

C16.018.0% / 10.0115.00%

C28.0115.0% / 15.0135.00%

D15.0135.0% / 35.0175.00%

E35.01100.0% / Mayores a 75.01%

Cartera emproblemada - El Banco para propósitos de las revelaciones en los estados financieros consolidados, considera emproblemados aquellos créditos comerciales respecto de los cuales determina que existe una probabilidad considerable de que no se podrían recuperar en su totalidad, sin excluir las mejoras en los grados de riesgo derivadas de la parte del crédito cubierto por garantías, así como créditos que aún y cuando se encuentren vigentes provengan de una negociación en la cual se autorizó una condonación, quita o bonificación al final del plazo pactado, o son a cargo de personas a las cuales se les ha clasificado como clientela indeseable.

Reservas adicionales identificadas - Son establecidas para aquellos créditos que, en la opinión de la administración, podrían verse emproblemados en el futuro dada la situación del cliente, la industria o la economía. Además, incluye estimaciones para partidas como intereses ordinarios devengados no cobrados y otras partidas cuya realización se estima podrían resultar en una pérdida para el Banco, así como reservas mantenidas por regulación normativa.

Castigos- El Banco tiene políticas de castigos para créditos de consumo e hipotecarios, de acuerdo a plazos establecidos (6 y 35 meses, respectivamente) que determinan la imposibilidad práctica de recuperación; los castigos cancelan el saldo del crédito contra la estimación preventiva previamente constituida. Cuando el crédito a castigar excede el saldo de su estimación asociada, antes de efectuar el castigo, dicha estimación se incrementa hasta por el monto de la diferencia. Cualquier recuperación derivada de los créditos previamente castigados, se reconoce en los resultados del ejercicio dentro del rubro de estimación preventiva para riesgos crediticios.

(l) Programa de lealtad de tarjetas de crédito-

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

(m) Otras cuentas por cobrar-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 21 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

Los derechos de cobro y las cuentas por cobrar relativas a deudores identificados cuyo vencimiento se pacte desde su origen a un plazo mayor a 90 días naturales, son evaluados por la Administración del Banco para determinar su valor de recuperación estimado, y en su caso constituir las reservas correspondientes. Los saldos de las demás partidas deudoras se reservan con cargo a los resultados del ejercicio a los 90 días siguientes a su registro inicial cuando correspondan a saldos identificados y a los 60 días si corresponden a saldos no identificados, independientemente de su posibilidad de recuperación, con excepción de los relativos a saldos por recuperar de impuestos e impuesto al valor agregado acreditable.

Tratándose de cuentas liquidadoras, en los casos en que el monto por cobrar no se realice a los 90 días naturales siguientes a partir de la fecha en que se haya registrado en cuentas liquidadoras, se registra como adeudo vencido y se constituye una estimación por irrecuperabilidad o difícil cobro por el importe total del mismo.

Los sobregiros en las cuentas de cheques de los clientes, que no cuenten con una línea de crédito para tales efectos, se clasificarán como adeudos vencidos y las instituciones deberán constituir simultáneamente a dicha clasificación una estimación por el importe total de dicho sobregiro, en el momento en que se presente tal evento.

(n) Bienes adjudicados o recibidos como dación en pago-

Los bienes adquiridos mediante adjudicación judicial se registran en la fecha en que cause ejecutoria el auto aprobatorio del remate mediante el cual se decretó la adjudicación.

Los bienes recibidos en dación en pago se registran en la fecha en que se firmó la escritura de dación, o en la que se haya dado formalidad a la transmisión de la propiedad del bien.

El reconocimiento contable de un bien adjudicado considera el valor del bien (costo o valor razonable deducido de los costos y gastos estrictamente indispensables que se eroguen en su adjudicación, el que sea menor) así como el valor neto del activo que da origen a la adjudicación. Cuando el valor neto del activo que dio origen a la adjudicación es superior al valor del bien adjudicado, la pérdida se reconoce en los resultados del ejercicio, en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto"; en caso contrario, el valor del bien adjudicado se ajusta al valor neto del activo.

El valor del activo que dio origen a la misma y la estimación preventiva que se tenga constituida a esa fecha, se dan de baja del balance general consolidado.

Los bienes adjudicados prometidos en venta se reconocen como restringidos a valor en libros, los cobros que se reciben a cuenta del bien se registran como un pasivo; en la fecha de enajenación se reconoce en resultados la utilidad o pérdida generada dentro del rubro "Otros ingresos de la operación, neto".

Los bienes adjudicados se valúan de acuerdo al tipo de bien de que se trate, registrando dicha valuación (bajas de valor) contra resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El Banco constituye provisiones adicionales que reconocen los indicios de deterioro por las potenciales pérdidas de valor por el paso del tiempo en los bienes adjudicados, contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto", las cuales se determinan multiplicando el porcentaje de reserva que corresponda por el valor de los bienes adjudicados, con base en las disposiciones por tenencia de bienes adjudicados o recibidos en dación de pago

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 22 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

de la Comisión Bancaria, conforme se muestra a continuación:

Porcentaje de reserva
Bienes muebles,
Meses transcurridos a partir de laderechos de cobro e
adjudicación o dación en pagoBienes inmueblesinversiones en valores

Hasta 6 0%0%
Más de 6 y hasta 12 10%10%
Más de 12 y hasta 18 20%20%
Más de 18 y hasta 24 45%45%
Más de 24 y hasta 30 60%60%
Más de 30 y hasta 36 100%100%
Más de 36 y hasta 42 100%100%
Más de 42 y hasta 48 100%100%
Más de 48 y hasta 54 100%100%
Más de 54 y hasta 60 100%100%
Más de 60 100%100%

(o) Inmuebles, mobiliario y equipo-

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

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

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

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

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

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

a) El órgano del Banco que aprueba esta actividad se ha comprometido en un plan de venta.

b) Los activos se encuentran disponibles para su venta inmediata, en sus condiciones actuales, sujeto exclusivamente a los términos usuales y habituales para la venta de esos activos y su venta sea altamente probable.

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 23 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

c) Las acciones para localizar al comprador y otras actividades para terminar el plan se encuentran iniciadas. Si no se tiene localizado el comprador, al menos se ha identificado el mercado potencial.

d) Se espera que el plan de venta se cumpla en un plazo menor a un año. Este requisito no se cumple en los casos en que el Banco celebre acuerdos de venta que son en esencia opciones de compra y contratos de venta con arrendamiento en vía de regreso. Una ampliación del periodo de un año para completar la venta no impide que el activo sea clasificado como mantenido para la venta, si el retraso es causado por hechos o circunstancias fuera del control del Banco y existen evidencias suficientes de que el Banco se mantiene comprometida con un plan para vender el activo.

e) Se cuenta con una estimación adecuada de los precios por recibir a cambio del activo o grupo de activos.

f) No es probable que haya cambios significativos al plan de venta o éste sea cancelado.

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

(q) Inversiones permanentes-

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

(r) Otros activos-

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

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

(s) Impuestos a la utilidad-

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

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

Los impuestos a la utilidad diferidos se registran de acuerdo con el método de activos y pasivos, que compara los valores contables y fiscales de los mismos. Se reconocen impuestos a la utilidad (activos y pasivos) por las consecuencias fiscales futuras

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 24 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

atribuibles a las diferencias temporales entre los valores reflejados en los estados financieros de los activos y pasivos existentes y sus bases fiscales relativas y por pérdidas fiscales por amortizar. Los activos y pasivos por impuestos a la utilidad se calculan utilizando las tasas establecidas en la ley correspondiente, que se aplicarán a la utilidad gravable en los años en que se estima que se revertirán las diferencias temporales. El efecto de cambios en las tasas fiscales sobre los impuestos a la utilidad se reconoce en los resultados del período en que se aprueban dichos cambios.

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

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 "Otros Resultados Integrales" (ORI) o directamente en un rubro del capital contable.

(t)Arrendamientos capitalizables-

Las operaciones de arrendamiento capitalizable se registran como un activo y una obligación correlativa por el equivalente al valor menor entre el valor presente de los pagos mínimos y el valor de mercado del activo arrendado. La diferencia entre el valor nominal de los pagos mínimos y la obligación mencionada anteriormente, se registra durante el periodo de arrendamiento en los resultados del ejercicio dentro del rubro de "Otros ingresos de la operación, neto". El activo se deprecia de la misma manera que los otros activos que se tienen en propiedad cuando se tiene la certeza de que al término del contrato se transferirá la propiedad del activo arrendado, caso contrario se deprecia durante la duración del contrato.

(u)Captación tradicional-

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

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

(v)Provisiones-

El Banco reconoce con base en estimaciones de la administración, provisiones por aquellas obligaciones presentes en las que es probable la transferencia de activos o la

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 25 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

prestación de servicios y surge como consecuencia de eventos pasados.

(w) Préstamos interbancarios y de otros organismos-

En este rubro se registran los préstamos de exigibilidad inmediata, de corto plazo y de largo plazo de bancos nacionales y extranjeros, préstamos obtenidos a través de subastas de crédito con el Banco Central y el financiamiento por fondos de fomento; asimismo, este rubro incluye préstamos por cartera descontada que proviene de los recursos proporcionados por los bancos especializados en financiar actividades económicas, productivas o de desarrollo. Los intereses se reconocen en resultados conforme se devengan dentro del rubro de "Gastos por intereses".

(x) Beneficios a los empleados-

Beneficios directos a corto plazo

Los beneficios a los empleados directos a corto plazo se reconocen en los resultados del período en que se devengan los servicios prestados, se reconoce un pasivo por el importe que se espera pagar si el Banco tiene una obligación legal o asumida de pagar esta cantidad como resultado de los servicios pasados proporcionados y la obligación se puede estimar de forma razonable.

Plan de contribución definida

El Banco tiene reconocido un plan de contribución definida para pensiones en el cual los montos aportados se reconocían directamente como gastos en el estado consolidado de resultados, dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

Plan de beneficios definidos

El Banco solo mantiene un plan de beneficio definido para pensiones del personal jubilado, así como las obligaciones relativas a los planes para los beneficios médicos posteriores al retiro, vales de despensa y el seguro de vida de jubilados.

Para los planes de pensiones y otros beneficios post-retiro se han constituido fideicomisos irrevocables en los que se administran los activos de los fondos de jubilados, excepto para las indemnizaciones.

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

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

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 26 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Las remediciones generadas resultantes de diferencias entre las hipótesis actuariales proyectadas y reales al final del período, se reconocen en el período en que se incurren como parte de la utilidad integral dentro del capital contable y posteriormente se recicla a los resultados del período, tomando como base la vida laboral remanente promedio del personal jubilado.

(y) Obligaciones subordinadas-

Las obligaciones subordinadas se reconocen a su valor contractual y los intereses se reconocen conforme se devengan en los resultados del ejercicio dentro del rubro "Gastos por intereses".

(z) Reconocimiento de ingresos-

Los intereses generados por los préstamos otorgados, incluyendo los interbancarios pactados a un plazo menor o igual a tres días hábiles, se reconocen en resultados conforme se devengan. Los intereses sobre cartera de crédito vencida, se reconocen en resultados hasta el momento en que efectivamente se cobran.

Los cobros anticipados por concepto de intereses y las comisiones por originación del crédito se registran dentro del rubro de "Créditos diferidos y cobros anticipados" y se aplican a los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses" y "Comisiones y tarifas cobradas" respectivamente, conforme se devenguen o en el plazo del crédito, según aplique.

Las comisiones derivadas de los servicios de custodia o administración de bienes, así como comisiones por servicios relacionados a operaciones derivadas se reconocen en los resultados cuando se proporciona el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas".

Las comisiones por operaciones fiduciarias se reconocen en resultados conforme se devenga el servicio en el rubro de "Comisiones y tarifas cobradas". En el momento en que el adeudo de dichas comisiones presente 90 o más días naturales de incumplimiento de pago, se suspende la acumulación de dichos ingresos devengados y se lleva el control de éstos en cuentas de orden; en caso de que dichos ingresos devengados sean cobrados, se reconocen directamente en los resultados del ejercicio.

Las comisiones por reestructuraciones o renovaciones de créditos se registran como un crédito diferido, el cual se amortiza contra los resultados del ejercicio en el rubro de "Ingresos por intereses", bajo el método de línea recta durante el nuevo plazo del crédito.

(aa) Transacciones en moneda extranjera-

Las transacciones en moneda extranjera se reconocen al tipo de cambio vigente en las fechas de su celebración, para efectos de presentación de los estados financieros consolidados. En el caso de divisas distintas al dólar se convierten de la moneda

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 27 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

respectiva a dólares, conforme lo establecen las Disposiciones aplicables a las instituciones de crédito, y la equivalencia del dólar con la moneda nacional se convierte al tipo de cambio para solventar obligaciones denominadas en moneda extranjera pagaderas en la República Mexicana, determinado por el Banco Central.

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

(ab) Aportaciones al Instituto para la Protección al Ahorro Bancario (IPAB)-

La Ley de Protección al Ahorro Bancario, entre otros preceptos, establece la creación del IPAB, que es un sistema de protección al ahorro bancario a favor de las personas que realicen cualquiera de los depósitos garantizados, y regular los apoyos financieros que se otorguen a las instituciones de banca múltiple para el cumplimiento de este objetivo.

De acuerdo a dicha Ley, el IPAB garantiza los depósitos bancarios de los ahorradores hasta 400 mil UDIS por persona, física o moral, y por institución bancaria. Las aportaciones al IPAB se reconocen en resultados del ejercicio dentro del rubro de "Gastos de administración y promoción".

(ac) Cuentas de orden-

Las cuentas de orden corresponden principalmente a los bienes en custodia o de administración y operaciones de fideicomisos.

Los valores propiedad de clientes que se tienen en custodia, garantía y administración, se reconocen en las cuentas de orden respectivas de acuerdo con los Criterios Contables establecidos por la Comisión Bancaria, representando así el monto máximo esperado por el que estaría obligado el Banco a responder ante sus clientes.

Los montos de los bienes en custodia o en administración se presentan en el rubro "Bienes en custodia o en administración", en tanto que las operaciones de fideicomiso se presentan en el rubro de "Bienes en fideicomiso o mandato".

(ad) Contingencias-

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

(4) Cambios contables-

NIF aplicables en 2021:

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 28 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

Venta de créditos de cartera hipotecaria

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

Cambios en las Disposiciones de la Comisión Bancaria

El 4 de diciembre de 2020 la Comisión Bancaria emitió resolución sobre la entrada en vigor de la Resolución publicada en el DOF el 13 de marzo de 2020, referente a las NIF emitidas por el CINIF, referidas en el párrafo 3 del Criterio A-2 "Aplicación de normas particulares" del Anexo 33, entrarán en vigor el 1 de enero de 2022.

La Administración del Grupo Financiero se encuentra en proceso de determinar los efectos de adopción a estas modificaciones a los criterios contables aplicables a instituciones de crédito.

El pasado 23 de septiembre de 2021, la Comisión Bancaria publicó una resolución modificatoria a la resolución del pasado 13 de marzo de 2020, la cual establece que las entidades, durante el ejercicio de 2022, en la determinación del costo amortizado a que se refiere el Criterio Contable B-6 Cartera de Crédito (el "Criterio Contable B-6"), podrán seguir utilizando en el reconocimiento de los intereses devengados de su cartera de crédito, la tasa de interés contractual, así como el método de línea recta para el reconocimiento de las comisiones cobradas y los costos de transacción conforme lo indicado en el actual Criterio Contable B-6, vigente hasta el 31 de diciembre de 2021; debiendo revelar, en los estados financieros trimestrales y anuales de dicho ejercicio, tal circunstancia. Para ello, deberán notificarlo por escrito a la Vicepresidencia de la Comisión Nacional Bancaria y de Valores encargada de su supervisión, antes del 31 de diciembre de 2021, explicando detalladamente los motivos por los cuales no se encontrarán en condiciones de aplicar la referida tasa de interés efectiva, durante el ejercicio de 2022, además de señalar el programa a que se sujetarán para su implementación.

Las instituciones de crédito en el reconocimiento y revelación de los efectos por la aplicación inicial del método de interés efectivo y la tasa de interés efectiva que realicen en el ejercicio de 2023, deberán apegarse a lo establecido en la Norma de Información Financiera B-1 "Cambios contables y correcciones de errores", aplicable a las instituciones de crédito en virtud de lo establecido en el criterio A-2 "Aplicación de normas particulares".

El Grupo Financiero se encuentra analizando y estableciendo acciones sobre estas modificaciones a los criterios de contabilidad aplicables a las instituciones de crédito

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

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

NIF C-2 "Inversión en instrumentos financieros"- Permite la opción de reconocer inversiones en ciertos instrumentos negociables de capital que no se negocian en el corto plazo, para ser valuadas a través del ORI. Esta mejora entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021, permitiéndose su aplicación anticipada para el ejercicio 2020. Los cambios contables que surjan deben reconocerse de conformidad con lo que establece la NIF B-1 Cambios contables y correcciones de errores.

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

- Especifica que las cuentas por cobrar que se basan en un contrato representan un instrumento financiero, en tanto que algunas de las otras cuentas por cobrar, generadas por una disposición legal o fiscal, pueden tener ciertas características de un instrumento financiero, tal como generar intereses, pero no son en sí instrumentos financieros.
- Establece que la estimación para incobrabilidad por cuentas por cobrar debe reconocerse desde el momento en que se devenga el ingreso, con base en las pérdidas crediticias esperadas presentando la estimación en un rubro de gastos, por separado cuando sea significativa en el estado de resultado integral.
- Establece que, desde el reconocimiento inicial, debe considerarse el valor del dinero en el tiempo, por lo que si el efecto del valor presente de la cuenta por cobrar es importante en atención a su plazo, debe ajustarse considerando dicho valor presente.
- Requiere una conciliación entre el saldo inicial y el final de la estimación para incobrabilidad por cada período presentado.

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

- Se disminuye su alcance al reubicar el tema relativo al tratamiento contable de pasivos financieros en la NIF C-19 "Instrumentos financieros por pagar".
- Se modifica la definición de "pasivo" eliminando el calificativo de "virtualmente ineludible" e incluyendo el término "probable".

NIF C-15 "Deterioro en el valor de activos de larga duración"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien el 1 de enero de 2022 y permite su adopción anticipada. Deja sin efecto al Boletín C-15, "Deterioro" en el valor de los activos de larga duración y su disposición. Los cambios contables por su aplicación inicial deben reconocerse con base en el método prospectivo. Los principales cambios que presenta son:

- Adiciona nuevos ejemplos de indicios para evaluar si existe deterioro, y los separa en fuentes externas de información, fuentes internas de información y aplicables a las inversiones en subsidiarias, asociadas o negocios conjuntos.
 - Cambia el requerimiento de uso de un precio neto de venta por el de valor razonable, menos los costos de disposición para llevar a cabo las pruebas de deterioro;
 - Establece la opción del uso de estimaciones de los flujos de efectivo futuros y de una tasa de descuento, en términos reales;
 - Incorpora normas para el tratamiento de flujos de efectivo futuros en moneda extranjera en la determinación del monto recuperable;
 - Modifica la NIF C-8, Activos intangibles, para indicar que la asignación del crédito mercantil debe hacerse a nivel de una unidad generadora de efectivo (UGE) que se espere será beneficiada por la sinergia de la adquisición de negocios;
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 30 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

-
- Incorpora el reconocimiento del deterioro del crédito mercantil en dos pasos: i. primero, comparando el valor en libros de la UGE incluido el crédito mercantil con su monto recuperable, y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro; y ii. segundo, afectando esta pérdida en primera instancia al crédito mercantil, incluso hasta dejarlo en cero, para después, si existiera un exceso de pérdida por asignar, distribuirlo a prorrata entre los demás activos de larga duración que formen parte de la UGE;
 - Elimina el cálculo del deterioro a través del valor a perpetuidad en los activos intangibles de vida útil indefinida, modificando la prueba de deterioro.
 - Establece la determinación del deterioro de los activos corporativos como sigue: i. primero, se asignan a la UGE a la que pertenece de manera razonable y consistente, ii. segundo, se compara el valor en libros de la UGE, incluidos los activos corporativos, con su monto recuperable y si este último fuese menor se genera una pérdida por deterioro, la cual se distribuye a prorrata entre todos los activos de larga duración que formen parte de la UGE, incluidos los activos corporativos,
 - Modifica las revelaciones en consecuencia a los cambios antes descritos.

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

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

- Establece que las pérdidas por deterioro de un IFC deben reconocerse cuando al haberse incrementado el riesgo de crédito se concluye que una parte de los flujos de efectivo futuros del IFC no se recuperará.
- Propone que se reconozca la pérdida esperada con base en la experiencia histórica que tenga la entidad de pérdidas crediticias, las condiciones actuales y los pronósticos razonables y sustentables de los diferentes eventos futuros cuantificables que pudieran afectar el importe de los flujos de efectivo futuros de los IFC.
- En el caso de los IFC que devengan intereses, establece determinar cuánto y cuándo se estima recuperar del monto del IFC, pues el monto recuperable debe estar a su valor presente.

NIF C-17 "Propiedades de inversión"- Entra en vigor para los ejercicios que inicien a partir del 1o. de enero de 2021 permitiendo su aplicación anticipada. Elimina la supletoriedad de la Norma Internacional de Contabilidad (NIC) 40 "Propiedades de inversión". Asimismo, deroga la Circular 55, "Aplicación supletoria de la NIC 40". Los efectos de su adopción deben reconocerse de forma retrospectiva. Los principales cambios son: 1) se ajusta la definición de propiedades de inversión para establecer que estos activos se tienen por un inversionista bajo un modelo de negocios cuyo objetivo principal es ganar por la apreciación de su valor (apreciación del capital) en el mediano plazo mediante su venta; 2) permite valorar las propiedades de inversión a su costo de adquisición o a su valor razonable.

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

- Se establece la posibilidad de valorar, subsecuentemente a su reconocimiento inicial, ciertos pasivos financieros a su valor razonable, cuando se cumplen ciertas condiciones.
 - Valorar los pasivos a largo plazo a su valor presente en su reconocimiento inicial.
 - Al reestructurar un pasivo, sin que se modifiquen sustancialmente los flujos de
-

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: SCOTIAB

TRIMESTRE: 03 AÑO: 2021

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

NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA

PAGINA 31 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

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

- Incorpora lo establecido en la IFRIC 19 "Extinción de Pasivos Financieros con Instrumentos de Capital", tema que no estaba incluido en la normativa existente.
- El efecto de extinguir un pasivo financiero debe presentarse como un resultado financiero en el estado de resultado integral.
- Introduce los conceptos de costo amortizado para valuar los pasivos financieros y el de método de interés efectivo, basado en la tasa de interés efectiva.

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

- La clasificación de los instrumentos financieros en el activo. Se descarta el concepto de intención de adquisición y tenencia de éstos para determinar su clasificación. En su lugar, se adopta el concepto de modelo de negocios de la administración, ya sea para obtener un rendimiento contractual, generar un rendimiento contractual y vender para cumplir ciertos objetivos estratégicos o para generar ganancias por su compra y venta, para clasificarlos de acuerdo con el modelo correspondiente.
- El efecto de valuación de las inversiones en instrumentos financieros se enfoca también al modelo de negocios.
- No se permite la reclasificación de los instrumentos financieros entre las clases de instrumentos financieros para cobrar principal e interés (IFCPI), la de instrumentos financieros para cobrar y vender (IFCV) y la de instrumentos financieros negociables, a menos de que cambie el modelo de negocios de la entidad.
- No se separa el instrumento derivado implícito que modifique los flujos de principal e interés del instrumento financiero por cobrar anfitrión, sino que todo el IFCPI se valorará a su valor razonable, como si fuera un instrumento financiero negociable.

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

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

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

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

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

La norma contable introduce un único modelo de reconocimiento de los arrendamientos por el arrendatario y requiere que éste reconozca los activos y pasivos de todos los

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 32 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

arrendamientos con una duración superior a 12 meses, a menos que el activo subyacente sea de bajo valor. Se requiere que reconozca un activo por derecho de uso que representa su derecho a usar el activo subyacente arrendado y un pasivo por arrendamiento que representa su obligación para hacer pagos por arrendamiento.

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

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

Cabe mencionar que estos cambios entrarán en vigor el 1 de enero de 2022. El Grupo está en proceso de evaluación del impacto de las mismas.

Venta de créditos de cartera hipotecaria

Con fecha 23 de julio de 2021, el Banco celebró un contrato de cesión onerosa de derechos de crédito, derechos litigiosos y adjudicatarios de dos portafolios de cartera hipotecaria con una compañía no relacionada. La cartera del primer portafolio a la fecha de la cesión la cartera estaba clasificada como cartera vencida, el valor en libros a la fecha de la cesión era de \$168, el monto recibido por la transacción fue de \$85 millones, generando una pérdida de \$83 millones, que se registró en el estado de resultados en el rubro de "Otros gastos de la operación, neto".

El segundo portafolio a la fecha de la cesión la cartera estaba clasificada como cartera castigada, con un valor nominal de \$364 millones; el monto recibido por la transacción fue de \$69 millones, generando una utilidad de \$69 millones, que se registró en el estado de resultados en el rubro de "Estimación preventiva para riesgos crediticios".

Compra de cartera comercial

Durante el mes enero de 2021, el Banco celebró contratos de adquisición de cartera comercial a descuento con una institución financiera no relacionada, a la fecha de la compra la cartera estaba clasificada como cartera vigente, el valor en libros a la fecha de la compra era de \$874. El monto pagado por la transacción fue de \$865, generando una utilidad de \$9. La utilidad generada se registró en el estado consolidado de resultados en el rubro de "Otros ingresos de la operación, neto" por \$5 y "Créditos diferidos y cobros anticipados" por \$4 que se amortizara conforme se realicen los cobros de dicha cartera adquirida.

Préstamo Bancario

Con fecha 19 de enero de 2021, el Banco firmó un contrato de apertura de crédito simple

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

CLAVE DE COTIZACIÓN: **SCOTIAB**

TRIMESTRE: **03** AÑO: **2021**

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

**NOTAS COMPLEMENTARIAS A LA INFORMACIÓN
FINANCIERA**

PAGINA 33 / 33

CONSOLIDADO

Impresión Final

garantizado con activos elegibles fideicomitidos en fideicomiso de garantía con Banco de México por \$1,100, a una tasa promedio de la tasa interbancaria y a un plazo de 720 días.

"ver archivo completo en pdf"