Scotiabank Inverlat

INFORME TRIMESTRAL **T1 2026 |**

Información financiera

SCOTIABANK INVERLAT

Scotiabank -Indicadores Financieros[1]	T1 2025	T2 2025	T3 2025	T4 2025	T1 2026
ROE (Resultado neto acumulado 12 meses/ Capital contable promedio en 12 meses)	12.4%	12.2%	11.6%	11.1%	13.0%
ROA (Resultado neto acumulado 12 meses / Activo total promedio 12 meses)	1.2%	1.2%	1.2%	1.1%	1.4%
MIN (Margen financiero acumulado 12 meses/ Activos productivos promedio 12 meses)	3.6%	3.7%	3.8%	3.9%	4.0%
Eficiencia Operativa *(Gastos de administración acumulado 12 meses / Activo total promedio en 12 meses)*	2.0%	2.0%	2.1%	2.1%	2.2%
Índice de Morosidad *(Saldo de la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 al cierre del trimestre/Saldo de la cartera de crédito total al cierre del trimestre)*	3.9%	4.0%	4.1%	4.2%	4.1%
ICOR *(Estimaciones preventivas para riesgos crediticios / Cartera de crédito con riesgo de crédito en etapa 3)*	68.8%	69.3%	69.5%	69.4%	70.1%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo de crédito	24.8%	24.2%	24.7%	26.1%	27.0%
Capital neto / Activos sujetos a riesgo totales *(crédito, mercado y operacional)*	19.0%	18.7%	19.2%	20.4%	21.0%
Liquidez *(Activos líquidos / Pasivos líquidos)*	48.5%	45.8%	44.6%	46.5%	43.3%
Solvencia (Activo total /Pasivo total)	111.5%	111.6%	111.6%	111.9%	112.1%
Apalancamiento (Pasivo total / Capital contable)	870.7%	861.9%	858.8%	838.3%	829.8%
Productividad (Gastos de administración 3 meses / Ingresos totales de la operación 3 meses)	46.1%	47.7%	45.3%	49.9%	42.1%

1). Cálculos de indicadores financieros consistentes con los publicados en el portal de la CNBV.

Notas:
Activos productivos*= Bancos + Instrumentos Financieros de Alta liquidez + Efectivo y equivalentes de efectivo restringidos o dados en garantía + Cuentas de Margen (Instrumentos Financieros Derivados) + Inversiones en Instrumentos financieros (excluyendo instrumentos financieros de capital) + Deudores por Reporto + Inversiones en Instrumentos financieros derivados + Cartera Etapa 1 + Cartera Etapa 2 + Cartera Valuada a valor razonable.*
Activo líquidos*= Efectivo y equivalentes de efectivo + Instrumentos financieros negociables sin restricción + Instrumentos financieros para cobrar o vender sin restricción.*
Pasivo líquidos*= Depósitos de exigibilidad inmediata + Préstamos interbancarios y de otros organismos de exigibilidad inmediata + Préstamos interbancarios y de otros organismos de corto plazo.*
Ingresos totales de la operación*= Margen financiero + Comisiones y tarifas netas + Resultado por intermediación + Otros ingresos/egresos de la operación.*

La utilidad neta al cierre del primer trimestre de 2026 alcanzó $4,415 millones, un incremento de $1,886 millones respecto al mismo periodo del año anterior, impulsado por el ingreso extraordinario derivado de la venta de la participación accionaria en Trans Union de México, S.A., S.I.C. (“Trans Union México”), un mejor desempeño en el margen financiero, el cual registró un crecimiento de 9% y una disminución de 24% en la estimación preventiva para riesgos de crédito respecto al mismo periodo de 2025.

Respecto al trimestre anterior, la utilidad neta mostró un incremento de $1,654 millones debido principalmente al ingreso por la venta de Trans Union de México, así como por menores requerimientos de reservas crediticias.

	3 meses			
Scotiabank- Información Financiera (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Ingresos por intereses	20,016	18,459	17,706	-12%
Gastos por intereses	(12,564)	(10,241)	(9,550)	-24%
Margen financiero	**7,452**	**8,218**	**8,156**	**9%**
Comisiones y tarifas netas	1,282	1,426	1,332	4%
Resultado por intermediación	623	500	549	-12%
Otros ingresos/egresos de la operación	276	335	2,017	> +100%
Ingresos no financieros	**2,181**	**2,261**	**3,898**	**79%**
Total ingresos	**9,633**	**10,479**	**12,054**	**25%**
Gastos de administración y promoción	(4,441)	(5,228)	(5,070)	14%
PTPP *	**5,192**	**5,251**	**6,984**	**35%**
Estimación preventiva para riesgos crediticios	(1,637)	(1,754)	(1,242)	-24%
Resultado de la operación	**3,555**	**3,497**	**5,742**	**62%**
Participación en el resultado neto de otras entidades	32	29	114	> +100%
Resultado antes de Impuestos a la utilidad	**3,587**	**3,526**	**5,856**	**63%**
Impuestos a la utilidad	(1,058)	(765)	(1,441)	36%
Resultado neto	**2,529**	**2,761**	**4,415**	**75%**
Otros resultados integrales				
Valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender	584	(173)	(173)	> -100%
Valuación de instrumentos financieros derivados de cobertura de flujos de efectivo	(1,203)	404	404	> -100%
Remedición de beneficios definidos a los empleados	(14)	(495)	(495)	> +100%
Participación en ORI de otras entidades	-	1	1	0%
Resultado integral	**1,896**	**2,498**	**4,152**	**> +100%**

*PTPP: “Pre-Tax, Pre-Provision”, resultado antes de impuestos y estimaciones.

Margen financiero

El margen financiero fue de $8,156 millones al cierre del primer trimestre de 2026, un incremento de $704 millones u 9% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido principalmente a mayores volúmenes en la cartera menudeo, así como a menores volúmenes en depósitos a plazo y de exigibilidad inmediata; compensados parcialmente por menores volúmenes en la cartera comercial.

Respecto al trimestre anterior, el margen financiero mostró una disminución de $62 millones o 1%, debido a dos días menos de operación, compensados parcialmente por mayores volúmenes en la cartera de menudeo, así como a menores volúmenes en depósitos a plazo y de exigibilidad inmediata.

Ingresos no financieros

El total de ingresos no financieros fue de $3,898 millones en el primer trimestre de 2026, un incremento de $1,717 millones o 79% respecto al mismo periodo del año anterior, Este incremento se debió a mejores resultados en otros ingresos/egresos de la operación (venta de Trans Union México, bonos tarjeta de crédito VISA y Mastercard, y seguros). Por su parte el resultado por intermediación disminuyó $74 millones o 12% debido a una pérdida en inversiones; mitigada por una mayor utilidad en derivados y mercado cambiario.

Respecto al trimestre anterior, los ingresos no financieros mostraron un incremento de $1,637 millones o 72%, debido principalmente a mayores ingresos derivado de la venta de Trans Union México y bonos de tarjeta de crédito VISA y Mastercard (ambos en otros ingresos / egresos de la operación). La variación en el resultado por intermediación se debió a una mayor utilidad en mercado cambiario y menor perdida en inversiones; compensadas parcialmente por una menor utilidad en derivados.

	3 meses			
Scotiabank-Comisiones y tarifas (netas) (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Aceptaciones por cuenta de terceros	-	2	3	0%
Actividades fiduciarias	58	54	53	-9%
Apertura de cuenta	4	4	4	0%
Cartas de crédito	66	55	57	-14%
Cheques certificados	1	-	1	0%
Cheques de caja	-	1	-	0%
Compraventa de instrumentos financieros	4	3	5	25%
Manejo de cuenta	99	99	101	2%
Operaciones de crédito	485	597	514	6%
Otras comisiones y tarifas	386	438	426	10%
Servicios de banca electrónica	154	146	144	-6%
Transferencia de fondos	25	27	24	-4%
Total de comisiones y tarifas (netas)	1,282	1,426	1,332	4%

Scotiabank- Otros ingresos/egresos de la operación (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Afectaciones a la estimación de pérdidas crediticias esperadas	(2)	(16)	(2)	0%
Aportaciones al IPAB	(608)	(594)	(585)	-4%
Cancelación de otras cuentas de pasivo	5	5	5	0%
Donativos	-	(17)	-	0%
Bienes adjudicados	75	28	34	-55%
Ingresos por arrendamiento	13	13	14	8%
Intereses a favor provenientes de préstamos a funcionarios y empleados	62	65	52	-16%
Otras partidas de los ingresos/egresos de la operación	778	907	2,517	> +100%
Quebrantos	(67)	(54)	(24)	-64%
Utilidad/pérdida por venta de cartera de crédito	20	(2)	6	-70%
Total de otros ingresos/egresos de la operación	**276**	**335**	**2,017**	**> +100%**

Estimación preventiva para riesgos crediticios

En el primer trimestre de 2026, la estimación preventiva para riesgos crediticios ascendió a $1,242 millones, una disminución de $395 millones o 24% respecto al mismo periodo del año anterior, principalmente por menores requerimientos en la cartera de vivienda y comercial.

Respecto al trimestre anterior, la estimación preventiva para riesgos crediticios muestra una disminución de $512 millones o 29%, debido principalmente a menores requerimientos en la cartera de vivienda y automotriz, así como una reducción en el monto de reservas adicionales en el primer trimestre de 2026; compensados parcialmente por mayores requerimientos en la cartera comercial.

Scotiabank – Estimación preventiva para riesgos crediticios (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Total de estimación preventiva para riesgos crediticios	**(1,637)**	**(1,754)**	**(1,242)**	**-24%**

Gastos de administración y promoción

Los gastos de administración y promoción se ubicaron en $5,070 millones en el primer trimestre de 2026, un incremento de $629 millones o 14% respecto al mismo periodo del año anterior debido principalmente a mayores gastos de personal asociados a sueldos y compensación variable.

Respecto al trimestre anterior, los gastos de administración y promoción muestran una disminución de $158 millones o 3%, debido principalmente a menores gastos de operación en honorarios, IVA, gastos legales, promoción, publicidad, tecnología y gastos de operación de tarjetas de crédito; así como menores gastos del personal por compensación variable; los cuales fueron compensados parcialmente por mayores gastos del personal asociados a sueldos.

Scotiabank – Gastos de administración y promoción (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Gastos de personal	(1,997)	(2,232)	(2,534)	27%
Gastos de operación	(2,444)	(2,996)	(2,536)	4%
Total de gastos de administración y promoción	**(4,441)**	**(5,228)**	**(5,070)**	**14%**

Impuestos a la utilidad

En el primer trimestre de 2026, se registró un impuesto neto a cargo de $1,441 millones, un aumento de $383 millones o 36% respecto al mismo trimestre del año anterior, debido a una mayor utilidad gravable en el periodo.

Respecto al trimestre inmediato anterior, el impuesto a la utilidad mostró un incremento de $676 millones u 88%, debido a una mayor utilidad gravable en el periodo.

Scotiabank – Impuestos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	3 meses			
	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Impuesto a la utilidad causado	(1,166)	(374)	(1,575)	35%
Impuesto a la utilidad diferido	108	(391)	134	24%
Total de impuestos a la utilidad	**(1,058)**	**(765)**	**(1,441)**	**36%**

Balance general

Al 31 de marzo de 2026, el total de activos de Scotiabank se ubicó en $898,942 millones, un incremento de $6,411 millones o 1% respecto al cierre de marzo de 2025. El incremento anual se debió a mayores volúmenes en la cartera de crédito total, inversiones en instrumentos financieros y derivados; compensados parcialmente por menores volúmenes en deudores por reporto y en efectivo y equivalentes de efectivo.

Los activos totales incrementaron $6,098 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido a mayores volúmenes en deudores por liquidación de operaciones en otros activos y en deudores por reporto; compensados parcialmente por menores volúmenes en efectivo y equivalentes de efectivo.

El total del pasivo registró $802,259 millones al 31 de marzo de 2026, un incremento de $1,670 millones respecto al cierre de marzo de 2025, debido principalmente a mayores volúmenes en otros pasivos (acreedores por reporto, valores asignados por liquidar, instrumentos financieros derivados y acreedores por liquidación de operaciones) y a la emisión de obligaciones subordinadas híbridas; compensados parcialmente por menores volúmenes en el total de depósitos.

El pasivo total incrementó $4,570 millones o 1% respecto al cierre del trimestre anterior, debido principalmente a mayores volúmenes en acreedores por liquidación de operaciones; compensados parcialmente por menores volúmenes en acreedores por reporto, ambos registrados en otros pasivos.

Scotiabank – Cifras relevantes del Balance General (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Efectivo, Equivalentes de efectivo, Inversiones en instrumentos financieros, Derivados y Valores	312,807	307,888	302,134	-3%
Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2	502,148	512,957	514,805	3%
Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	20,167	22,250	22,001	9%
Partidas diferidas	3,989	4,362	4,373	10%
Estimación preventiva para riesgos crediticios	(13,868)	(15,450)	(15,431)	11%
Otros activos	67,288	60,837	71,060	6%
Total activo	**892,531**	**892,844**	**898,942**	**1%**
Depósitos	556,179	527,914	523,730	-6%
Préstamos bancarios y de otros organismos	45,161	47,867	46,084	2%
Obligaciones subordinadas en circulación	8,908	12,408	12,408	39%
Otros pasivos	190,341	209,500	220,037	16%
Total pasivo	**800,589**	**797,689**	**802,259**	**0%**
Capital	**91,942**	**95,155**	**96,683**	**5%**
Total pasivo y capital	**892,531**	**892,844**	**898,942**	**1%**

Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2

La cartera de préstamos de menudeo al 31 de marzo de 2026 alcanzó $299,576 millones, un incremento respecto al cierre de marzo de 2025 de $17,286 millones o 6% y de $3,193 millones o 1% respecto al trimestre inmediato anterior. Los incrementos se debieron principalmente a mayores créditos a la vivienda y automotriz.

El total de préstamos a entidades comerciales, financieras y gubernamentales al 31 de marzo de 2026 se ubicó en $215,229 millones, una disminución respecto al cierre de marzo de 2025 de $4,629 millones o 2%, debido principalmente a menores créditos de actividad empresarial o comercial y entidades financieras; los cuales fueron compensados por mayores créditos gubernamentales.

Respecto al trimestre pasado, disminuyó $1,345 millones debido a menores créditos a entidades financieras; los cuales fueron compensados por mayores créditos de actividad empresarial o comercial.

Scotiabank - Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Tarjeta de crédito y otros préstamos personales	49,916	56,353	57,869	16%
Créditos a la vivienda	232,374	240,030	241,707	4%
Total préstamos de menudeo	**282,290**	**296,383**	**299,576**	**6%**
Actividad empresarial o comercial	186,132	177,283	181,222	-3%
Entidades financieras	21,040	23,527	18,262	-13%
Entidades gubernamentales	12,686	15,764	15,745	24%
Total de préstamos comerciales, financieras y gubernamentales	**219,858**	**216,574**	**215,229**	**-2%**
Total cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 y 2	**502,148**	**512,957**	**514,805**	**3%**

Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3

Al 31 de marzo de 2026 la cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 sumó $22,001 millones, un incremento anual de $1,834 millones o 9% y una disminución de $249 millones o 1% respecto al trimestre anterior.

Por otro lado, la estimación preventiva para riesgos crediticios al 31 de marzo de 2026 se ubicó en $15,431 millones, un incremento anual de $1,563 millones u 11% y una disminución de $19 millones respecto al trimestre anterior.

El índice de morosidad al 31 de marzo de 2026 fue de 4.1%, un incremento de 24pb respecto al año anterior y una disminución de 6pb respecto al trimestre pasado.

El índice de cobertura de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 fue de 70.1% al 31 de marzo de 2026, un incremento de 137pb respecto al año pasado y 70pb respecto al trimestre anterior.

Scotiabank – Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	20,167	22,250	22,001	9%
Estimación preventiva para riesgos crediticios	(13,868)	(15,450)	(15,431)	11%
Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 neta	**6,299**	**6,800**	**6,570**	**4%**
Índice de morosidad	**3.9%**	**4.2%**	**4.1%**	**24 pb**

Depósitos

El total de depósitos registró $523,730 millones al 31 de marzo de 2026, una disminución anual de $32,449 millones o 6% y trimestral de $4,184 millones o 1%, ambas disminuciones se debieron principalmente a menores volúmenes en depósitos de clientes.

Scotiabank – Depósitos (millones de pesos; consolidado con subsidiarias)	31-mar 2025	31-dic 2025	31-mar 2026	A/A Δ%
Total depósitos vista y ahorro	282,388	281,614	286,086	1%
Público en general	209,178	176,386	167,166	-20%
Mercado de dinero	32,839	31,606	29,749	-9%
Total depósitos a plazo	242,017	207,992	196,915	-19%
Títulos de crédito emitidos	30,237	36,461	38,969	29%
Cuenta global de captación sin movimientos	1,537	1,847	1,760	15%
Total de depósitos	**556,179**	**527,914**	**523,730**	**-6%**

Obligaciones subordinadas en circulación

Al 31 de marzo de 2026, el monto de las obligaciones subordinadas se ubicó en $12,408 millones, un incremento anual de $3,500 millones o 39% originado por la emisión de obligaciones subordinadas híbridas SCOTIAS 25 con fecha de emisión el 9 de diciembre de 2025. Sin cambios respecto al trimestre anterior.

Scotiabank-Inversiones en instrumentos financieros (millones de pesos al 31 de marzo de 2026 valor razonable)

Categoría	Deuda Gubernamental	Deuda Bancaria	Instrumentos de Patrimonio neto	Otros títulos de deuda	Total
Instrumentos financieros negociables	**81,101**	**997**	**22**	**774**	**82,894**
Sin restricción:	19	-	17	774	810
Restringidos:	81,082	997	5	-	82,084
En operaciones de reporto	61,162	947	-	-	62,109
Préstamos de valores	3,513	-	-	-	3,513
Otros	16,407	50	5	-	16,462
Instrumentos financieros para cobrar o vender	**87,151**	**20,476**	**-**	**800**	**108,427**
Sin restricción:	71,437	20,476	-	800	92,713
Restringidos:	15,714	-	-	-	15,714
En operaciones de reporto	14,582	-	-	-	14,582
En operaciones de préstamo de valores	-	-	-	-	-
Otros	1,132	-	-	-	1,132
Instrumentos financieros para cobrar principal e interés	**2,224**	**-**	**-**	**-**	**2,224**
Sin restricción	2,224	-	-	-	2,224
Total	170,476	21,473	22	1,574	193,545

Scotiabank-Inversiones en instrumentos financieros no gubernamentales (superiores al 5% del capital neto) (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)

Emisor	Títulos	Tasa	Plazo	Importe
I_BANSAN_26133	14,902,773,106	6.70%	1	14,900

Scotiabank-Instrumentos financieros derivados (millones de pesos al 31 de marzo de 2026 valor razonable)

Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Opciones		Operaciones Estructuradas		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados		Total Activo	Total Pasivo
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición			
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva		
Negociación	5,885	5,884	-	-	1,691	1,356	323	486	41,937	41,929	-	-	49,836	49,655
Cobertura	-	-	-	-	-	-	-	-	13,584	13,301	-	-	13,584	13,301

Scotiabank-Montos nocionales en operaciones derivadas (Valores nominales y presentados en su moneda de origen al 31 de marzo de 2026)												
Con fines de:	Contratos Adelantados		Futuros		Operaciones Estructuradas		Opciones		Swaps		Paquetes de Instrumentos Derivados	
	Posición		Posición		Posición		Posición		Posición		Posición	
	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva	Activa	Pasiva
Negociación												
Posición USD	8,202	8,124	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición EUR	130	133	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CHF	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición GBP	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Posición CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas CAD	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas USD	-	-	-	-	58	58	1,063	1,025	-	-	-	-
Divisas EUR	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Divisas MXN	-	-	-	-	-	-	3	3	-	-	-	-
Acciones MXN	-	-	-	-	-	-	917	917	-	-	-	-
Acciones USD	-	-	-	-	127	122	239	10	-	-	-	-
Índices MXN	-	-	-	-	738	1,884	2,434	1,288	-	-	-	-
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	34,155	33,770	1,098,872	1,127,518	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	996	996	12,623	12,077	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	82	-	-	-
Pesos Colombianos	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Cobertura												
Tasa de interés												
Pesos	-	-	-	-	-	-	-	-	104,405	-	-	-
Dólares	-	-	-	-	-	-	-	-	755	826	-	-
Euros	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Scotiabank-Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 1 (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	136,488	43,587	-	180,075
Créditos a entidades financieras	17,972	290	-	18,262
Créditos a entidades gubernamentales	15,745	-	-	15,745
Créditos al consumo	56,358	-	-	56,358
Créditos a la vivienda	237,707	1	15	237,723
Total	464,270	43,878	15	508,163

Scotiabank-Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 2 (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	772	375	-	1,147
Créditos al consumo	1,511	-	-	1,511
Créditos a la vivienda	3,983	-	1	3,984
Total	6,266	375	1	6,642

Scotiabank-Cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	Pesos	Dólares	Udis	Total
Actividad empresarial o comercial	5,014	128	-	5,142
Créditos a entidades financieras	48	-	-	48
Créditos al consumo	1,704	-	-	1,704
Créditos a la vivienda	15,074	29	4	15,107
Total	21,840	157	4	22,001

Scotiabank-Variaciones cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3 (millones de pesos)	
Saldo al 31 de diciembre de 2025	22,250
Reestructuras	501
Recuperaciones	(704)
Castigos, quitas, daciones, adjudicaciones y otros	(1,329)
Traspasos de y a cartera de crédito con riesgo de crédito entre etapa 1, 2 y 3	1,284
Fluctuación Tipo Cambio	(1)
Saldo al 31 de marzo de 2026	22,001

Scotiabank-Estimaciones preventivas para riesgos crediticios (millones de pesos)		
Saldo al 31 de diciembre de 2025		15,450
Más: Creación de reservas		46
Calificación		1,287
Menos: Adjudicaciones y otros		103
Castigos y quitas		1,246
Comercial	-	
Hipotecario	213	
Consumo	1,033	
Eliminaciones		-
Desliz cambiario		3
Saldo al 31 de marzo de 2026		15,431

Scotiabank-Calificación de la cartera crediticia
(millones de pesos al 31 de marzo de 2026)

Grado de Riesgo	Importe Cartera Crediticia	Reservas Preventivas Necesarias				
		Cartera Comercial	Consumo		Cartera de Vivienda	Total Reservas Preventivas
			No revolventes	Tarjeta de Crédito y Otros Créditos Revolventes		
Exceptuada calificada						
Riesgo A1	453,984	826	165	543	355	1,889
Riesgo A2	59,727	484	69	271	34	858
Riesgo B1	8,060	42	67	91	21	221
Riesgo B2	8,477	21	142	44	45	252
Riesgo B3	4,048	8	49	44	43	144
Riesgo C1	4,960	75	75	98	69	317
Riesgo C2	5,821	-	93	158	376	627
Riesgo D	10,954	653	108	478	1,912	3,151
Riesgo E	11,799	2,678	1,122	479	3,540	7,819
Total	567,830	4,787	1,890	2,206	6,395	15,278
Exceso						153
Reservas Constituidas						15,431

Notas:

1). Las cifras para la calificación y constitución de las reservas preventivas son las correspondientes al día último del mes a que se refiere el balance general al 31 de marzo de 2026.

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

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

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

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

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

-Reservas para cobertura de riesgos sobre cartera de vivienda con riesgo de crédito etapa 3	-
-Reservas riesgos operativos (sociedades de información crediticia)	94
-Reservas por intereses devengados sobre créditos etapa 3	6
-Ordenada por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	49
-Reconocida por la Comisión Nacional Bancaria y de Valores	4
Total	153

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 31 de marzo de 2026 mantiene el Banco en el rubro de "Inversiones en Instrumentos Financieros – Instrumentos Financieros para cobrar principal e intereses" son:

Scotiabank-Terminación anticipada de los programas hipotecarios-Cetes (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	Títulos	Importe	Vencimiento
B4 270701	11,209,686	2,224	01-jul-27
BV 270701	6	-	01-jul-27
Total	11,209,692	2,224	

Scotiabank-ISR y PTU diferido (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	ISR	PTU
Futuros castigos de crédito	6,009	1,518
Pagos anticipados	(404)	(100)
Comisiones cobradas por anticipado	(588)	(149)
Remanente por deducir de propiedades, mobiliario y equipo	779	176
Plan de pensiones	1,249	314
Provisiones y otros	972	171
Otros	(411)	55
Efecto neto en diferido	7,606	1,985

Scotiabank-Resultados por intermediación (millones de pesos)	31 mar 2026
Resultado por valuación de instrumentos financieros a valor razonable	(404)
Resultado por valuación de divisas	(375)
Resultado por compraventa de instrumentos financieros e instrumentos financieros derivados	836
Resultado por compraventa de divisas	506
Costos de transacción	(11)
Estimación de pérdidas crediticias esperadas para inversiones en instrumentos financieros	(3)
Total	549

Al 31 de marzo de 2026, Scotiabank cuenta con un crédito fiscal correspondiente al ejercicio fiscal de 2016.

Scotiabank-Préstamos interbancarios y de otros organismos (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)						
Vencimiento	Préstamos			Financiamiento		Total
	Banca Múltiple	Banco de México	Banca de Desarrollo	Fondos de Fomento	Otros Organismos	
Pesos						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	-	-	900	3,622	-	4,522
Largo	-	-	12,732	5,963	-	18,695
Total	-	-	13,632	9,585	-	23,217
Tasa promedio	0.00%	0.00%	8.33%	7.21%	0.00%	
Otras divisas						
Inmediato	-	-	-	-	-	-
Mediano	9,030	-	2,693	1,072	112	12,907
Largo	-	-	946	980	8,034	9,960
Total	9,030	-	3,639	2,052	8,146	22,867
Tasa promedio	4.19%	0.00%	4.95%	4.40%	4.79%	
Total préstamos interbancarios	9,030	-	17,271	11,637	8,146	46,084

Scotiabank no cuenta con créditos o financiamientos específicos que representen más del 10% de los pasivos que se muestran en sus estados financieros al 31 de marzo de 2026.

Scotiabank-Tasas pagadas en captación tradicional Tasa promedio (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)	Pesos	Dólares
Depósitos a la vista (incluye ahorro)	3.99%	1.62%
Depósitos a plazo	6.48%	0.00%

Emisión de Obligaciones Subordinadas

(MXN al 31 de marzo de 2026)					
Fecha Inicio	Fecha Vencimiento	ISIN	Plazo	Importe ($)	Tasa (%)
14-nov-24	Perpetua	MX0QSC10040	-	8,908,000,000	14.02
09-dic-25	Perpetua	MX0QSC10057	-	3,500,000,000	11.65
Total de obligaciones subordinadas				12,408,000,000	

Emisión de Certificados Bursátiles

Al cierre de marzo de 2026, las principales características de las emisiones de Certificados Bursátiles Bancarios, con los que cuenta Scotiabank actualmente son las siguientes:

	*Primera	*Segunda	*Tercera	*Cuarta	*Quinta	*Sexta	*Septima	*Octava
Clave de Pizarra	SCOTIAB 24	SCOTIAB 24-2	SCOTIAB 24V	SCOTIAB 24D	SCOTIAB 24-3	SCOTIAB 25	SCOTIAB 26	SCOTIAB 26-2
Monto de la Emisión	$5,189 millones	$4,811 millones	$4,325 millones	"$24 millones usd / $472 millones MXN	$3,970 millones	$6,000 millones	$5,091 millones	$4,662 millones
Fecha de Emisión y Colocación	26 febrero 2024	26 febrero 2024	13 sep 2024	13 sep 2024	13 sep 2024	23 sep 2025	29 ene 2026	29 ene 2026
Plazo de Vigencia de la Emisión	1,095 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años	1,095 días, aprox. 3 años	1,092 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años	1,095 días, aprox. 3 años	1,095 días, aprox. 3 años	2,548 días, aprox. 7 años
Garantía	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria	Quirografaria
Tasa de interés	TIIE Fondeo+0.32 %	9.74%	TIIE Fondeo+0.32 %	3.46+0.84%	9.89%	TIIE Fondeo+0.34 %	TIIE Fondeo+0.34 %	9.10%
Pago de Intereses	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 28 días durante la vigencia de la emisión	Cada 182 días durante la vigencia de la emisión
Calificaciones otorgadas Moody´s/S&P	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA	AAA.mx /"mxAAA
Amortización del principal	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento	Un sólo pago al vencimiento

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

Emisión de Bonos Bancarios Estructurados

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

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto MXN
99_SCOTIAB_5-23	907,000	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	90,700,000
99_SCOTIAB_6-23	730,600	08-dic-23	07-dic-26	1095	S&P / BMV IPC (MEXBOL)	73,060,000
99_SCOTIAB_7-23	481,400	15-dic-23	14-dic-26	1095	S&P 500 Futures Index ER (SPXFP)	48,140,000
99_SCOTIAB_6-24	1,234,750	11-dic-24	10-dic-26	729	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	123,475,000
99_SCOTIAB_7-24	986,900	11-dic-24	10-dic-27	1094	S&P 500 Futures ER Index (SPXFP)	98,690,000
99_SCOTIAB_2-25	1,661,500	30-ene-25	29-ene-27	729	S&P 500 Index (SPX Index)	166,150,000
99_SCOTIAB_10-25	11,178,406	01-dic-25	28-nov-28	1093	MSCI World Analyst Sentiment ER 3% Decrement USD	1,117,840,600
83_SCOTIAB_2-26	6,096,350	12-feb-26	11-feb-27	364	Dólar – Peso (BBG: USDMXN CURNCY)	609,635,000
Total bonos bancarios al 31 de marzo de 2026						2,327,690,600

Clave	Número de títulos	Fecha de Emisión	Vencimiento	Plazo (días)	Subyacente	Monto USD
83_SCOTIAB_7-25D	10,000	30-abr-25	29-abr-26	364	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	1,000,000
99_SCOTIAB_8-25D	16,500	06-may-25	06-may-27	730	VanEck Semiconductor ETF (SMH US Equity)	1,650,000
99_SCOTIAB_9-25D	582,808	11-jul-25	10-jul-28	1095	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	58,280,800
99_SCOTIAB_11-25D	534,110	11-dic-25	08-dic-28	1093	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ)	53,411,000
99_SCOTIAB_1-26D	17,800	28-ene-26	28-ene-28	730	VanEck Semiconductor ETF (SMH US Equity)	1,780,000
99_SCOTIAB_3-26D	19,000	11-mar-26	10-mar-28	730	VanEck Semiconductor ETF (SMH US Equity)	1,900,000
83_SCOTIAB_4-26D	14,300	13-mar-26	12-mar-27	364	Invesco QQQ Trust Series 1 (QQQ US Equity)	1,430,000
Total bonos bancarios al 31 de marzo de 2026						119,451,800

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 31 de marzo de 2026)		
Referencia	Capital Fundamental (CF): instrumentos y reservas	Monto
1	Acciones ordinarias que califican para capital común de fundamental más su prima correspondiente	13,468.3356
2	Resultados de ejercicios anteriores	68,915.0085
3	Otros elementos de la utilidad integral (incluyendo otras reservas)	14,288.3836
4	Derogado	No aplica
5	Acciones ordinarias emitidas por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital fundamental)	No aplica
6	**Capital Fundamental antes de ajustes regulatorios**	96,671.7277
	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)	2,529.4721
11	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo	-
12 consevador	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)	1,084.9554
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

Referencia	Capital común de nivel 1: ajustes regulatorios	Monto
26	Ajustes regulatorios adicionales	8,688.7660
A	Derogado	-
B	del cual: Inversiones en deuda subordinada	-
C	Derogado	-
D	del cual: Inversiones en organismos multilaterales	-
E	del cual: Inversiones en empresas relacionadas	-
F	del cual: Inversiones en capital de riesgo	-
G	del cual: Inversiones en sociedades de inversión	-
H	del cual: Financiamiento para la adquisición de acciones propia	-
I	Derogado	-
J	del cual: Cargos diferidos y pagos anticipados	7,601.4868
K	Derogado	-
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 el capital de empresas que tengan por finalidad compensar y liquidar operaciones celebradas en bolsa	1,087.2792
Q	del cual: Grandes Exposiciones	-
27	Ajustes regulatorios que se aplican al capital fundamental debido a la insuficiencia de capital básico no fundamental y al capital complementario para cubrir deducciones	-
28	Ajustes regulatorios totales al capital común fundamental	12,303.1935
29	Capital Fundamental	84,368.5342
	Capital Básico No Fundamental: instrumentos	
30	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital básico no fundamental, más su prima	12,408.0000
31	de los cuales: Clasificados como capital bajo los criterios contables aplicables	12,408.0000
32	de los cuales: Clasificados como pasivos bajo los criterios contables aplicables	No aplica
33	Derogado	-
34	Instrumentos emitidos de capital básico no fundamental e instrumentos de capital fundamental que no se incluyen en el reglón 5 que fueron emitidos por subsidiarias en tenencia de terceros (monto permitido en el capital básico no fundamental)	No aplica
35	Derogado	No aplica
36	Capital Básico No Fundamental antes de ajustes regulatorios	12,408.0000
	Capital Basíco No Fundamental: ajustes regulatorios	
37 conservador	Inversiones en instrumentos de capital propios de capital básico no fundamental	No aplica
38 conservador	Inversiones en acciones recíprocas en instrumentos de capital básico no fundamental	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	No aplica
42	Ajustes regulatorios aplicados al capital básico no fundamental debido a la insuficiencia del capital complementario para cubrir deducciones	No aplica
43	Ajustes regulatorios totales al capital básico no fundamental	-
44	Capital Básico No Fundamental (CBNF)	12,408.0000
45	Capital Básico (CB = CF + CBNF)	96,776.5342

Referencia	Capital Complementario: instrumentos y reservas	Monto
46	Instrumentos emitidos directamente que califican como capital complementario, más su prima	-
47	Derogado	-
48	Instrumentos de capital complementario e instrumentos de capital fundamental y capital básico no fundamental 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)	No aplica
49	Derogado	-
50	Reservas	3.6592
51	Capital Complementario antes de ajustes regulatorios	3.6592
	Capital Complementario: ajustes regulatorios	
52	Inversiones en instrumentos propios de capital complementario	No aplica
53	Inversiones recíprocas en instrumentos de capital complementario	No aplica
54	Inversiones en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de la consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución no posea más del 10% del capital social emitido (monto que excede el umbral del 10%)	No aplica
55	Inversiones significativas en el capital de bancos, instituciones financieras y aseguradoras fuera del alcance de consolidación regulatoria, netas de las posiciones cortas elegibles, donde la Institución posea más del 10% del capital social emitido	No aplica
56	Ajustes regulatorios nacionales	-
57	Ajustes regulatorios totales al capital complementario	-
58	Capital Complementario (CC)	3.6592
59	Capital Neto (CN = CB + CC)	96,780.1934
60	Activos ponderados por riesgo totales	460,521.6355
	Razones de capital y suplementos	
61	Capital Fundamental (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	18.32%
62	Capital Básico (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	21.01%
63	Capital Neto (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	21.02%
64	Suplemento específico institucional (al menos deberá constar de: el requerimiento de capital fundamental más el suplemento de conservación de capital, más el suplemento de capital contracíclico, más el suplemento de conservación de capital a Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local; expresado como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	7.60%
65	del cual: Suplemento de conservación de capital	2.50%
66	del cual: Suplemento de capital contracíclico bancario específico	0.00%
67	del cual: Suplemento de Conservación de Capital a Instituciones de Banca Múltiple de Importancia Sistémica Local	0.60%
68	Capital Fundamental disponible para cubrir los suplementos (como porcentaje de los activos ponderados por riesgo totales)	11.32%
	Mínimos nacionales (en caso de ser diferentes a los de Basilea III)	
69	Razón mínima nacional de Capital Fundamental (si difiere del mínimo establecido por Basilea III)	No aplica
70	Razón mínima nacional de Capital Básico (si difiere del mínimo establecido por Basilea III)	No aplica
71	Razón mínima nacional de Capital Neto (si difiere del mínimo establecido por Basilea III)	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)	-

Referencia	Límites aplicables a la inclusión de reservas en el capital complementario	Monto
76	Reservas elegibles para su inclusión en el capital complementario con respecto a las exposiciones sujetas a la metodología estandarizada (previo a la aplicación de límite)	3.6592
77	Límite en la inclusión de provisiones en el capital complementario bajo la metodología estandarizada	4,055.4122
78	Reservas elegibles para su inclusión en el capital complementario 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 complementatio bajo la metodología de calificaciones internas	-
	Derogado	
80	Derogado	-
81	Derogado	-
82	Derogado	-
83	Derogado	-
84	Derogado	-
85	Derogado	-

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

Referencia	Descripción
1	Elementos del capital contribuido conforme a la fracción I inciso a) numerales 1) y 2) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
2	Resultados de ejercicios anteriores y sus correspondientes actualizaciones.
3	Reservas de capital, resultado neto, resultado por valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender, resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujos de efectivo y el saldo de remediciones por beneficios definidos a los empleados considerando en cada concepto sus actualizaciones.
4	Derogado
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 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, únicamente cuando correspondan a partidas valuadas a costo amortizado y siempre que sea positivo; en caso de que este monto sea negativo deberá sumarse al Capital Fundamental. Lo anterior, sin incluir el efecto de los impuestos a la utilidad diferida correspondientes a este resultado.

Referencia	Descripción
12*	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	Este tratamiento es más conservador que lo establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III, ya que deduce del capital fundamental las reservas preventivas pendientes de constituirse, de acuerdo con lo dispuesto en el Capítulo V del Título Segundo de las presentes disposiciones, así como aquéllas constituidas con cargo a cuentas contables que no formen parte de las partidas de resultados o del capital contable y no sólo la diferencia positiva entre las Pérdidas Esperadas Totales menos las Reservas Admisibles Totales.
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
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III, debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital fundamental, 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 la fracción I 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 estas de conformidad con lo establecido en la fracción I inciso j) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, incluyendo aquellas inversiones correspondientes a fondos de inversión consideradas en la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III, debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital fundamental, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se considera a cualquier tipo de entidad, no solo entidades financieras.
18* (conservador)	Inversiones en acciones, donde la institución posea hasta el 10% del capital social de entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 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 los que se refiere la fracción I, inciso i) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III, debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital fundamental, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.

Referencia	Descripción
19* (conservador)	Inversiones en acciones, donde la Institución posea más del 10% del capital social de las entidades financieras a que se refieren los Artículos 89 de la Ley y 12 y 81 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 los que se refiere la fracción I inciso i) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. Las inversiones anteriores excluyen aquellas que se realicen en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III, debido a que la deducción por este concepto se realiza del capital fundamental, sin importar el nivel de capital en el que se haya invertido, y adicionalmente porque se deduce el monto total registrado de las inversiones.
20* (conservador)	Los derechos por servicios hipotecarios se deducirán por el monto total registrado en caso de existir estos derechos.
	Este tratamiento es más conservador que el establecido por el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento “asilea III, debido a que se deduce el monto total registrado de los derechos.
21	El monto de impuestos a la utilidad diferidos a favor provenientes de diferencias temporales menos los correspondientes impuestos a la utilidad diferidos a cargo no considerados para compensar otros ajustes, que exceda el 10% de la diferencia entre la referencia 6 y la suma de las referencias 7 a 20.
22	No aplica. Los conceptos fueron deducidos del capital en su totalidad. Ver las notas de las referencias 19, 20 y 21.
23	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 19.
24	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 20.
25	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 21.
26	Ajustes nacionales considerados como la suma de los siguientes conceptos.
	A. Derogado
	B. Inversiones en instrumentos de deuda subordinada, conforme a lo establecido en la fracción I inciso b) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	C. Derogado
	D. Inversiones en el capital de organismos multilaterales de desarrollo o de fomento de carácter internacional conforme a lo establecido en la fracción I inciso f) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones que cuenten con Calificación crediticia asignada por alguna de las Instituciones Calificadoras al emisor, igual o mejor al Grado de Riesgo 2 a largo plazo.
	E. Inversiones en acciones de empresas relacionadas con la Institución en los términos de los Artículos 73, 73 Bis y 73 Bis 1 de la Ley, incluyendo el monto correspondiente de las inversiones en sociedades de inversión y las inversiones en índices conforme a lo establecido en la fracción I inciso g) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	F. Inversiones que realicen las instituciones de banca de desarrollo en capital de riesgo, conforme a lo establecido en la fracción I inciso h) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	G. Las inversiones en acciones, distintas del capital fijo, de sociedades de inversión cotizadas en las que la Institución mantenga más del 15 por ciento del capital contable de la citada sociedad de inversión, conforme a la fracción I del artículo 2 Bis 6, que no hayan sido consideradas en las referencias anteriores.
	H. Cualquier tipo de aportación cuyos recursos se destinen a la adquisición de acciones de la sociedad controladora del grupo financiero, de las demás entidades financieras integrantes del grupo al que pertenezca la Institución o de las filiales financieras de éstas conforme a lo establecido en la fracción I incisos l) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.

Referencia	Descripción
	I. Derogado
	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. Derogado
	L. La participación de los trabajadores en las utilidades diferidas a favor conforme a la fracción I inciso p) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	M. El monto agregado de las Operaciones Sujetas a Riesgo de Crédito a cargo de Personas Relacionadas Relevantes conforme a la fracción I inciso r) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
	N. La diferencia entre las inversiones realizadas por el fondo de pensiones de beneficios definidos conforme al Artículo 2 Bis 8 menos la referencia 15.
	O. Derogado
	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.
	Q. El monto que exceda los límites a los que se refieren el Artículo 54 o, en su caso, el Artículo 59 de las presentes disposiciones, respecto de la cantidad positiva que resulte de restar, al importe de la suma de los conceptos referidos en el inciso a) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, el importe de la suma de los conceptos referidos en los incisos b) a r) de dicho artículo.
27	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital básico no fundamental ni para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital fundamental.
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 básico no fundamental, más su prima se registran contablemente como capital.
33	Derogado
34	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
35	Derogado
36	Suma de los renglones 30 y 34.
37 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
38 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
39 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
40 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
41	Ajustes nacionales considerados:
	Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al excedente de los Instrumentos de Capital a los que se refiere fracción II, inciso b), del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
42	No aplica. No existen ajustes regulatorios para el capital complementario. Todos los ajustes regulatorios se realizan del capital fundamental.
43	Suma de los renglones 37 a 42.
44	Renglón 36, menos el renglón 43.

Referencia	Descripción
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 fracción II de las presentes disposiciones.
47	Derogado
48	No aplica. Ver la nota de la referencia 5.
49	Derogado
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% 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 de las presentes disposiciones.
51	Suma de los renglones 46, 48 y 50.
52 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
53 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
54 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
55 conservador	No aplica. La deducción se realiza en su totalidad del capital fundamental.
56	Ajustes nacionales considerados:
	Ajuste por reconocimiento del Capital Neto. El monto que se muestra corresponde al excedente de los Instrumentos de Capital a los que se refiere fracción II, del artículo 2 Bis 7 de las presentes disposiciones.
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 el requerimiento mínimo del Capital Fundamental (4.5%) más la suma de los porcentajes expresados en los renglones 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 de las presentes disposiciones.
67	Porcentaje que se relaciona con el Suplemento de Conservación de Capital por carácter sistémico de la institución de banca múltiple, en los términos del inciso b), fracción III, del Artículo 2 Bis 5 de las presentes disposiciones.
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.
70	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III.
71	No aplica. El mínimo es el mismo que establece el Comité de Supervisión Bancaria de Basilea en su documento Basilea III.
72	No aplica. El concepto fue deducido del capital en su totalidad. Ver la nota de la referencia 18.

Referencia	Descripción
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% 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	Derogado
81	Derogado
82	Derogado
83	Derogado
84	Derogado
85	Derogado

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Estado de Situación Financiera (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Activo	
BG1	Efectivo y equivalentes de efectivo	37,031.4102
BG2	Cuentas de margen	1,081.6216
BG3	Inversiones en instrumentos financieros	193,545.0719
BG4	Deudores por reporto	6,310.7967
BG5	Préstamo de valores	-
BG6	Instrumentos financieros derivados	63,420.2575
BG7	Ajuste de valuación por cobertura de activos financieros	(1.1805)
BG8	Total de cartera de crédito (neto)	525,748.3596
BG9	Activos virtuales	-
BG10	Beneficios por recibir en operaciones de bursatilización	-
BG11	Otras cuentas por cobrar (neto)	46,768.4899
BG12	Bienes adjudicados (neto)	1,102.6220
BG13	Propiedades, mobiliario y equipo (neto)	2,675.0122
BG14	Inversiones permanentes	5,356.9819
BG15	Activos de larga duración mantenidos para la venta o para distribuir a los propietarios	7.0541
BG16	Activos por Derechos de Uso de Propiedades, Mobiliario y Equipo (neto)	1,110.6428
BG17	Activo por impuestos a la utilidad diferidos (neto)	7,521.3705
BG18	Activos Intangibles (neto)	4,613.4094
BG19	Activos por derechos de uso de activos intangibles (neto)	-
BG20	Crédito Mercantil	-
BG21	Pagos Anticipados y Otros activos (Neto)	3,035.8703

Referencias de los rubros del balance general	Rubros del Balance General	Monto presentado en el balance general
	Pasivo	
BG22	Captación tradicional	524,094.2883
BG23	Préstamos interbancarios y de otros organismos	46,084.4721
	Valores Asignados por liquidar	23,186.0358
BG24	Acreedores por reporto	76,612.0144
BG25	Préstamo de valores	0.0430
BG26	Colaterales vendidos o dados en garantía	3,284.9277
BG27	Instrumentos Financieros Derivados	62,956.6481
BG28	Ajuste de valuación por cobertura de pasivos financieros	-
BG29	Obligaciones en operaciones de bursatilización	-
BG30	Pasivos por arrendamiento	1,317.1391
BG31	Recursos de aplicación restringida recibidos del Gobierno Federal	-
BG32	Otras cuentas por pagar	41,488.5427
BG33	Pasivos relacionados con grupos de activos mantenidos para la venta	-
BG34	Instrumentos Financieros que califican como pasivo	12,408.0000
BG35	Obligaciones asociadas con el retiro de componentes de propiedades, mobiliario y equipo	-
BG36	Pasivo por Impuestos a la Utilidad	1,503.8800
BG37	Pasivos por Beneficio a los Empleados	8,064.9948
BG38	Créditos diferidos y cobros anticipados	1,643.8536
	Capital contable	
BG39	Capital contribuido	13,468.3356
BG40	Capital ganado	83,214.6149
	Cuentas de orden	
BG41	Avales otorgados	-
BG42	Activos y pasivos contingentes	-
BG43	Compromisos crediticios	353,430.0850
BG44	Bienes en fideicomisos o mandato	532,760.5347
BG45	Agente financiero del gobierno federal	-
BG46	Bienes en custodia o en administración	90,175.0590
BG47	Colaterales recibidos por la entidad	28,092.6594
BG48	Colaterales recibidos y vendidos o entregados en garantía por la entidad	3,284.9277
BG49	Operaciones de banca de inversión por cuenta de terceros (neto)	-
BG50	Intereses devengados no cobrados derivados de cartera de crédito con riesgo de crédito etapa 3	2,596.9727
BG51	Otras cuentas de registro	4,007,792.3353

Scotiabank-Relación del Capital neto con el Estado de Situación Financiera Conceptos regulatorios considerados para el cálculo de los componentes del Capital neto (millones de pesos al 31 de marzo de 2026)				
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 Estado de Situación Financiera 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	2,529.4721	BG 16 Pagos Anticipados y Otros activos (Neto) $2,529.4721
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	1,084.9554	BG 15 Impuestos y PTU diferidos (neto) $1,084.9554
13	Reservas reconocidas como capital complementario	50	3.6592	BG 8 Total de cartera de crédito (neto) $3.6592
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	-	BG 13 Inversiones Permanentes $ 0
19	Financiamiento para la adquisición de acciones propias	26-H	-	
20	Cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	7,601.4868	BG 16 Activos Intangibles $4,033 más Gastos de Instalación $3,695

21	Participación de los trabajadores en las utilidades (neta)	26-L	-	
22	Inversiones del plan de pensiones por beneficios definidos	26-N	-	
23	Inversiones en cámara de compensación	26-P	1,087.2792	BG 13 Inversiones Permanentes $ 1,087.2792
24	Derechos por servicios hipotecarios (monto que excede el umbral del 10%)	20		
	Pasivo			
25	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al crédito mercantil	8	-	
26	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros intangibles	9	-	
27	Pasivo del plan de pensiones por beneficios sin acceso irrestricto e ilimitado	15	-	
28	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados al plan de pensiones por beneficios definidos	15	-	
29	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a otros distintos a los anteriores	21	-	
30	Obligaciones subordinadas monto que cumple con el Anexo 1-R	31	12,408.0000	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $12,408.0000
31	Obligaciones subordinadas monto que cumplen con el Anexo 1-S	46	-	BG 26 Obligaciones Subordinadas en circulación $-
32	Impuestos a la utilidad diferida (a cargo) asociados a cargos diferidos y pagos anticipados	26-J	-	
	Capital contable			
33	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-Q	1	13,468.3356	BG 29 Capital Social $10,670.9658 más Prima en Venta de Acciones $2,797.3698
34	Resultado de ejercicios anteriores	2	68,915.0085	BG 30 Resultado de Ejercicios Anteriores $68,915.0085
35	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo	3	-210.6313	BG 30 Resultado por Valuación de Instrumentos de Cobertura de Flujo de Efectivo- $210.6313
36	Otros elementos del capital ganado distintos a los anteriores	3	14,499.0148	BG 30 Reservas de Capital $10,671.9658 más Resultado por Valuación de Títulos Disponibles para la Venta $129.4042 más Remedición por beneficios definidos a los empleados

				($716.2949) más Resultado Neto $4414.9397
37	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-R	31	-	
38	Capital contribuido que cumple con el Anexo 1-S	46	-	
39	Resultado por valuación de instrumentos de cobertura de flujo de efectivo de partidas no registradas a valor razonable	3, 11	-	
40	Efecto acumulado por conversión	3	-	
41	Resultado por tenencia de activos no monetarios	3	-	
	Conceptos regulatorios no considerados en el Estado de Situación Financiera			
42	Reservas pendientes de constituir	12	-	
43	Operaciones con Personas Relacionadas Relevantes	26-M	-	
44	Grandes Exposiciones	26-Q	-	

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.

Identificador	Descripción
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, 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.
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	Los derechos por servicios hipotecarios registrados, en caso de existir estos derechos.
25	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados 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 asociados al plan de pensiones por beneficios definidos.
29	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales distintos los de las referencias 24, 25, 29 y 35.
30	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
31	Monto de obligaciones subordinadas que cumplen con el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
32	Impuestos a la utilidad diferidos a cargo provenientes de diferencias temporales asociados a cargos diferidos y pagos anticipados.
33	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-Q de las presentes disposiciones.
34	Resultado de ejercicios anteriores.
35	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a valor razonable.
36	Resultado neto y resultado por valuación de instrumentos financieros para cobrar o vender.

Identificador	Descripción
37	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-R de las presentes disposiciones.
38	Monto del capital contribuido que satisface lo establecido en el Anexo 1-S de las presentes disposiciones.
39	Resultado por valuación de instrumentos para cobertura de flujo de efectivo de partidas cubiertas valuadas a costo amortizado.
40	Efecto acumulado por conversión.
41	Resultado por tenencia de activos no monetarios.
42	Reservas pendientes de constituir conforme a lo establecido en la fracción I inciso k) del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones.
43	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.
44	El monto que exceda los límites a los que se refieren el Artículo 54 o, en su caso, el Artículo 59 de las presentes disposiciones, respecto de la cantidad positiva que resulte de restar, al importe de la suma de los conceptos referidos en el inciso a) del artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones, el importe de la suma de los conceptos referidos en los incisos b) a r) de dicho artículo.

Scotiabank-Activos ponderados sujetos a riesgos totales
(millones de pesos al 31 de marzo de 2026)

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Operaciones en moneda nacional con tasa nominal	40,881.2900	3,270.5032
Operaciones con títulos de deuda en moneda nacional con sobretasa y una tasa revisable	993.9938	79.5195
Operaciones en moneda nacional con tasa real o denominados en UDI's o UMA´s	1,616.3538	129.3083
Operaciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Posiciones en UDI's, UMA´s o con rendimiento referido al INPC	13.2625	1.0610
Posiciones en moneda nacional con tasa de rendimiento referida al crecimiento del Salario Mínimo General	-	-
Operaciones en moneda extranjera con tasa nominal	6,716.0875	537.2870
Posiciones en divisas o con rendimiento indizado al tipo de cambio	969.5200	77.5616
Posición en acciones o con rendimiento indizado al precio de una acción o grupos de acciones	590.4863	47.2389
Posiciones en Mercancía	-	-
Requerimiento de capital por impacto Gamma	-	-
Requerimiento de capital por impacto Vega	14.4800	1.1584
Activos ponderados sujetos a riesgo de crédito por grupo de riesgo		
Grupo I-A (ponderados al 0%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 10%)	-	-
Grupo I-A (ponderados al 20%)	-	-
Grupo I-B (ponderados al 2%)	18.5000	1.4800
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%)	-	-

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
Grupo II (ponderados al 150%)	-	-
Grupo III (ponderados al 2.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 10%)	675.2500	54.0200
Grupo III (ponderados al 11.5%)	-	-
Grupo III (ponderados al 20%)	3,594.0000	287.5200
Grupo III (ponderados al 25%)	13.5000	1.0800
Grupo III (ponderados al 50%)	910.0000	72.8000
Grupo III (ponderados al 60%)	-	-
Grupo III (ponderados al 100%)	186.1250	14.8900
Grupo III (ponderados al 115%)	-	-
Grupo III (ponderados al 120%)	0.2500	0.0200
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%)	1,108.0000	88.6400
Grupo V (ponderados al 10%)	-	-
Grupo V (ponderados al 20%)	32.5000	2.6000
Grupo V (ponderados al 50%)	-	-
Grupo V (ponderados al 115%)	-	-
Grupo V (ponderados al 150%)	1,073.3750	85.8700
Grupo VI (ponderados al 20%)	7,537.1475	602.9718
Grupo VI (ponderados al 25%)	5,126.4688	410.1175
Grupo VI (ponderados al 30%)	18,463.7163	1,477.0973
Grupo VI (ponderados al 40%)	15,592.7800	1,247.4224
Grupo VI (ponderados al 50%)	31,998.5000	2,559.8800
Grupo VI (ponderados al 70%)	329.1575	26.3326
Grupo VI (ponderados al 75%)	42,415.6725	3,393.2538
Grupo VI (ponderados al 85%)	8,126.9763	650.1581
Grupo VI (ponderados al 100%)	20,928.8750	1,674.3100
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%)	146.3750	11.7100
Grupo VII_A (ponderados al 20%)	18,841.3750	1,507.3100
Grupo VII_A (ponderados al 23%)	1,539.2275	123.1382
Grupo VII_A (ponderados al 25%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 50%)	4,574.5900	365.9672
Grupo VII_A (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 75%)	5,547.1250	443.7700
Grupo VII_A (ponderados al 100%)	126,193.6313	10,095.4905
Grupo VII_A (ponderados al 115%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 120%)	983.3250	78.6660
Grupo VII_A (ponderados al 138%)	-	-
Grupo VII_A (ponderados al 150%)	0.5000	0.0400
Grupo VII_A (ponderados al 172.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 0%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 20%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 23%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 50%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 57.5%)	-	-
Grupo VII_B (ponderados al 100%)	-	-

Posiciones expuestas a riesgo de mercado por factor de riesgo	Importe de posiciones equivalentes	Requerimiento de capital
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%)	11,661.5813	932.9265
Grupo VIII (ponderados al 150%)	3,425.8750	274.0700
Grupo IX (ponderados al 100%)	19,473.2850	1,557.8628
Grupo IX (ponderados al 115%)	-	-
Grupo X (ponderados al 1250%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 1	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 50%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 100%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 350%)	-	-
Bursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 1 (ponderados al 40%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 2 (ponderados al 100%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 3 (ponderados al 225%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4 (ponderados al 650%)	-	-
Rebursatilizaciones con Grado de Riesgo 4, 5 o No calificados (ponderados al 1250%)	-	-
Ajuste por Valuación Crediticia en Operaciones Derivadas	7,361.4100	588.9128
Exposición al Fondo de Incumplimiento en Cámaras de Compensación	-	-
Por la contraparte en incumplimiento en mecanismos de libre entrega	274.8738	21.9899

Activos ponderados sujetos a riesgo operacional		
Método empleado	Activos ponderados por riesgo	Requerimiento de capital
Indicador de Negocio	50,572.1938	**4,045.7755**

Categoría Capitalización

El índice de capitalización de Scotiabank Inverlat S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (Scotiabank) fue de 21.02% al cierre de marzo 2026, 246pb superior al mínimo requerido para la categoría I del artículo 220 de las Disposiciones Generales aplicables a las Instituciones de Crédito (18.56% Índice regulatorio más suplementos de Absorción de Pérdidas Totales y de capital por considerarse una Institución de Importancia Sistémica Local).

Scotiabank-Características de los títulos que forman parte del Capital Neto		
Referencia	Características	Opciones
1	Emisor	Scotiabank Inverlat, S.A., Institución de Banca Múltiple, Grupo Financiero Scotiabank Inverlat
2	Identificador ISIN, CUSIP o Bloomberg	N.A.
3	Marco legal	Ley de Instituciones de Crédito, Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito.
4	Tratamiento regulatorio Derogado	Derogado
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"

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

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

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

Scotiabank-Formato de revelación de los principales indicadores asociados al Suplemento al Capital Neto
(millones de pesos al 31 de marzo de 2026)

Ref.	Rubro	Mar-26[1)] T	Dic-25 T-1	Sep-25 T-2	Jun-25 T-3	Mar-25 T-4
1	Monto del Suplemento al Capital Neto al que hace referencia el último párrafo del artículo 2 Bis 5 de presentes disposiciones	34,350.0841	34,375.4449	25,217.5243	25,082.6183	25,262.6205
1ª	No aplica					
2	Activos Ponderados Sujetos a Riesgo Totales (APSRT) conforme al monto registrado en la fila 60 de la Tabla I.1 de este anexo	460,521.635	465,425.920	467,099.07	471,618.000	469,284.471
3	Suplemento al Capital como porcentaje de los APSRT (%)	6.50%	6.50%	4.88%	4.88%	4.88%
3a	No aplica					
4	Exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento conforme a fila 21 de la Tabla I.1 del Anexo 1-O Bis de estas disposiciones	916,002.243	916,678.530	896,623.087	891,826.429	898,226.507
5	"Suplemento al Capital Neto como porcentaje de las exposiciones totales asociadas a la Razón de Apalancamiento (%)	3.75%	3.75%	2.81%	2.81%	2.81%
5a	No aplica					
6a	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que estatutariamente se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No

Ref.	Rubro	Mar-26[1)] T	Dic-25 T-1	Sep-25 T-2	Jun-25 T-3	Mar-25 T-4
6b	Como parte del monto del Suplemento al Capital Neto, ¿existen instrumentos de capital que se encuentran en el mismo nivel de prelación de pagos (i.e. pari assu), en relación con instrumentos que conforme a las Disposiciones de Carácter General Aplicables a las Instituciones de Crédito, se encuentran excluidos de ser convertidos en acciones ordinarias o sobre cuyo monto operaria la remisión o condonación de la deuda y de sus accesorios en favor de la institución, en un proceso de resolución?	No	No	No	No	No
6c	En el caso de que se actualice el supuesto contenido en la fila 6b, ¿cuál es la participación (%) del monto de los instrumentos de capital considerados en el suplemento al capital neto, en relación con el monto de los instrumentos de capital emitidos que cumplen con la mencionada prelación de pagos?	0%	0%	0%	0%	0%

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

Aumentos y/o Disminuciones de Capital

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

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat / Administración Integral de Riesgos

Cifras en millones de pesos

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo de mercado

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

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

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

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

El VaR global de un día para el Banco al cierre de marzo de 2026 fue de $22.94 millones y su promedio durante el primer trimestre de 2026 fue de $20.84 millones mismo que corresponde a un 0.022% del capital neto ($96,874 millones a febrero 2026, último disponible). Los nocionales y VaR por factor de riesgo (promedio y cierre) del primer trimestre de 2026 se muestran a continuación:

Nocional (millones de pesos)	Cierre Marzo 2026	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés		
Derivados	3,198,372	3,069,683
Mercado de Dinero	56,401	62,117
Tipo de cambio		
Cash	7,000	5,279
Derivados	356,145	328,080
Capitales		
Cash	22	22
Derivados	15,223	14,996

VaR 1 día (millones de pesos)	Cierre Marzo 2026	Promedio
Factor de Riesgo		
Tasas de interés	23.01	18.39
Tipo de cambio	3.11	7.79
Capitales	-	-
VaR Global	22.94	20.84

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 primer trimestre de 2026 muestra una pérdida máxima de $544.25 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 primer trimestre de 2026, muestra niveles aceptables bajo el enfoque que establece el BIS.

Riesgo de liquidez y tasas de interés

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

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

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

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

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

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

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

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

Las brechas de liquidez acumuladas y los activos líquidos al cierre de marzo 2026 así como el promedio del primer trimestre de 2026 se muestra a continuación:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)[2]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+US	6,252	16,930
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	118,020	117,008

Las brechas de liquidez acumuladas traen implícito los vencimientos contractuales, incluyendo posiciones de derivados de cobertura. Adicionalmente, las exposiciones de riesgo de liquidez se encuentran dentro de los límites aprobados.

Como se puede observar en el cuadro anterior, se resalta que el Banco ha mantenido una sólida posición de liquidez, con un CCL y CFEN promedio durante el primer trimestre de 2026 de 163.23 % y 117.40% respectivamente.

Por otro lado, el riesgo de tasas de interés deriva de la incertidumbre en las utilidades y/o valor del portafolio como resultado de movimientos en las tasas de interés, y se presenta cuando existen desfasamientos (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.

[2] Cifras previas al cierre del primer trimestre 2026.

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

El valor económico estimado y la sensibilidad de margen al cierre de marzo 2026 y en promedio para el primer trimestre de 2026 es la siguiente:

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Valor Económico (+100 pbs)	(2,472)	(2,345)
Sensibilidad de Margen (-100 pbs)	(321)	(326)

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

Scotiabank (millones de pesos)	Posición (Cierre)	Posición (Promedio)
Instrumentos financieros para cobrar o vender[1)]	108,427	102,701
Derivados de Cobertura	131,702	133,220

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 para cierre de marzo 2026 y el promedio del primer trimestre 2026 fueron $6,214 millones y $6,538 millones, respectivamente.

Riesgo de crédito

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Asimismo, para el caso de la cartera hipotecaria y considerando los señalamientos de los Artículos 101, 102 y Anexo 25 de la Circular Única de Bancos, se aplica el esquema de seguros de primeras pérdidas para mitigación de riesgos de crédito, el monto cubierto por el esquema al cierre del primer trimestre de 2026 corresponde a $5 millones; la cobertura del seguro se incorpora en el cálculo del parámetro Severidad de la Pérdida.

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

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

Información adicional relevante sobre los cambios de etapas de la cartera.

En la cartera menudeo, se observa un incremento en cartera en Etapa 3, principalmente por cartera hipotecaria, En cartera comercial, el aumento se debe a créditos que ya se encontraba en Etapa 3, pero que incrementa de manera periódica conforme a los lineamientos regulatorios.

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 31 de marzo de 2026)	Pérdida Esperada	Pérdida no Esperada
Hipotecas	0.34%	2.90%
Consumo	3.72%	13.49%
Cartera Comercial	0.55%	4.72%
Total	0.79%	4.84%

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

Parámetros de Riesgo[1).] (Cifras a millones al 31 de marzo de 2026)	EI[2).]	PI	SP
Hipotecas	241,707	2.00%	16.02%
Consumo	78,908	4.75%	72.34%
Cartera Comercial	252,572	1.38%	43.06%

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

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

Técnicas de mitigación de riesgo de crédito

El Banco cuenta con políticas y procesos que le permite realizar una valoración de las garantías. En el proceso de constitución de garantías; previo a su aceptación, se valora la capacidad de absorción de riesgo y los impactos que se tendrán en términos de rentabilidad, y como mitigante en mediciones de riesgo y cálculos regulatorios de reservas preventivas y requerimientos de capital.

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

La institución no tiene operados derivados de crédito, al cierre de marzo de 2026.

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 marzo 2026 y en promedio durante el primer trimestre de 2026, la pérdida esperada sobre la exposición del portafolio de inversiones en valores (sin considerar ventas en directo y ventas fecha valor) fue de 0.02% y 0.02% respectivamente, mientras que la pérdida no esperada fue de 0.46% y 0.42% respectivamente.

Riesgo de crédito en operaciones de derivados

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

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

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

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

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

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

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

Riesgo Operacional

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

El Riesgo Operacional es un riesgo inherente a cada negocio del Grupo Financiero y de sus empresas y sus actividades clave de soporte, y potencialmente pueden resultar en una pérdida financiera, una sanción regulatoria o un daño a la reputación del Grupo y sus empresas.

El Riesgo Operacional es inherente en todos los productos, actividades, procesos y sistemas.

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.

Establece los requisitos institucionales mínimos para la presentación de reportes, el escalamiento, el análisis causal, la creación de planes de acción/observaciones/hallazgos de Eventos de Riesgo Operacional (ORE), y para la documentación en el libro único de registro del Banco.

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.

Esta herramienta busca mejorar la gestión del riesgo operacional al interior de cada línea de negocios y adoptar, en la medida de lo posible, las acciones necesarias para minimizar el riesgo de futuras pérdidas y concienciar a cada una de sus pérdidas operacionales para lograr mejoras en sus controles y procesos.

Indicadores Clave de Riesgo (KRI)

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

Riesgo Legal

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

Cálculo del requerimiento de capital por Riesgo Operacional

La Institución determina su requerimiento de capital por riesgo operacional por el Método del Indicador de Negocio, de conformidad con el artículo 2 Bis 114 b y el Anexo 1-D BIS de la CUB, a partir de la entrada en vigor de dicho método, la institución está obligada a llevar a cabo una revisión y validación de las políticas, procedimientos y ejecución del cálculo del requerimiento de capital por Riesgo Operacional (modelo de evaluación) por auditores externos al menos de forma anual.

Valor promedio de la exposición

Durante el periodo de enero - marzo 2026, el Banco reconoció pérdidas por riesgo operacional por $32.6 millones (MXN), por abajo de lo reportado durante el mismo periodo 2025. Asimismo, los riesgos operacionales de enero - marzo 2026 que en caso de materializarse causarían un impacto negativo suman $44.6 millones (MXN).

Riesgo Tecnológico

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

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

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

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

Anexo 5. Formato de Revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez (CCL)
Periodo Reportado: enero 2026 – marzo 2026 (T1 2026)
Tabla 1.1 Formato de revelación del Coeficiente de Cobertura de Liquidez[3]

(Cifras en millones de pesos)		Calculo Individual T1 2026		Calculo Consolidado T1 2026	
		Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)	Importe sin ponderar (promedio)	Importe ponderado (promedio)
Activos líquidos computables					
1	Total de activos líquidos computables	No aplica	127,439	No aplica	127,439
Salidas de efectivo					
2	Financiamiento minorista no garantizado	162,128	13,370	162,128	13,370
3	Financiamiento estable	92,715	6,275	92,715	6,275
4	Financiamiento menos estable	69,413	7,096	69,413	7,096
5	Financiamiento mayorista no garantizado	232,190	78,108	232,190	78,108
6	Depósitos operacionales	162,729	40,729	162,729	40,729
7	Depósitos no operacionales	67,788	35,668	67,788	35,668
8	Deuda no garantizada	1,674	1,711	1,674	1,711
9	Financiamiento mayorista garantizado	No aplica	-	No aplica	-
10	Requerimientos adicionales:	301,415	24,023	301,415	24,023
11	Salidas relacionadas a instrumentos financieros derivados y otros requerimientos de garantías	15,433	9,639	15,433	9,639
12	Salidas relacionadas a pérdidas del financiamiento de instrumentos de deuda	-	-	-	-
13	Líneas de crédito y liquidez	285,982	14,383	285,982	14,383
14	Otras obligaciones de financiamiento contractuales	71	72	71	72
15	Otras obligaciones de financiamiento contingentes	2,798	2,860	2,798	2,860
16	Total de salidas de efectivo	No aplica	118,434	No aplica	118,434
Entradas de efectivo					
17	Entradas de efectivo por operaciones garantizadas	3,868	264	No aplica	127,439
18	Entradas de efectivo por operaciones no garantizadas	36,115	25,271	37,509	24,651
19	Otras entradas de efectivo	15,239	15,578	19,424	19,325
20	Total de entradas de efectivo	55,222	41,113	66,783	44,201
					Importe ajustado
21	Total de activos líquidos computables	No aplica	127,439	No aplica	127,439
22	Total neto de salidas de efectivo	No aplica	77,320	No aplica	77,320
23	Coeficiente de cobertura de liquidez[1]	No aplica	163.23	No aplica	163.23

a) Los días naturales que contempla el trimestre que se está revelando. 90 días naturales

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

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

Durante marzo 2026, los principales cambios que afectaron al CCL son los siguientes (considerando una ventana de tiempo de 30 días):[4]

Principales Salidas de Efectivo:

Salidas ponderadas por depósitos de exigibilidad inmediata por $65,005 millones y depósitos a plazo tradicionales por $20,346 millones, salidas derivadas de la estimación de Look Back Approach (considerando las facilidades emitidas por Banco de México) y a la estimación relativa al impacto en liquidez por el posible deterioro de calificación de la institución en 3 niveles por $1,904 millones y $6,214 millones respectivamente, salidas por compromisos crediticios no dispuestos por $14,563 millones.

Principales Entradas de Efectivo:

Entradas ponderadas por flujo de carteras de $17,503 millones y por operaciones de call money de $4,320 millones y vencimiento de títulos con calificación menor a 2B por $14,900 millones.

Activos Líquidos:

Activos Líquidos totales de $119,185millones en mayor medida concentrados en Nivel 1; $82,099 millones en títulos de deuda de nivel 1, $24,331 millones en Depósito de Regulación Monetaria, cuenta única en BANXICO y subastas activas de TIIE; adicionalmente, efectivo disponible por $7,9938 millones y $4,762 millones en títulos de nivel 2.

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

Promedio del cuarto trimestre 2025: 157% – promedio del primer trimestre 2026: 163%

- El coeficiente de cobertura de liquidez aumento 600 pb respecto del trimestre anterior, esto debido principalmente a:
- En las entradas de efectivo, las carteras crecieron $1,076 millones y los depósitos en bancos decrecieron en MXN $1,906 millones.
- Los activos líquidos tuvieron un incremento de $1,154 millones
- Finalmente, fondeo tradicional del banco disminuyó en $2,131 millones, principalmente los depósitos a plazo en $8,828 millones. Además, fondeo profesional, interbancario y externo tuvieron disminución de $979 millones.

d) La evolución de la composición de los Activos Líquidos Elegibles y Computables[5];

Evolución de Activos Líquidos T1-2026	Enero	Febrero	Marzo
Efectivo	7%	6%	7%
Reservas en el Banco Central	24%	20%	20%
Nivel 1	66%	71%	70%
Nivel 2ª	3%	3%	3%
Nivel 2B	0%	0%	0%
Total de Activos Líquidos Ponderados	100%	100%	100%

4 Salidas y entradas ponderadas para los próximos 30 días considerando los factores definidos en las Disposiciones de Carácter General sobre los requerimientos de Liquidez para las Instituciones de Banca Múltiple.
5 Activos líquidos computables bajo los lineamientos establecidos por Banco de México.

e) La concentración de sus fuentes de financiamiento;

Concentración de fuentes de Financiamiento	Enero	Febrero	Marzo
CAPTACION TRADICIONAL			
Depósitos de exigibilidad inmediata	48%	48%	50%
Depósitos a plazo			
Del público en general	31%	32%	30%
Mercado de dinero	6%	5%	5%
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	3%	3%	3%
De largo plazo	5%	5%	5%
Total	100%	100%	100%

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

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

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

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

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

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

Exposición Potencial Futura (marzo 2026) (Cifras en millones de pesos)	
Con contrato de compensación	4,524
Sin contrato de compensación	14,494
Posibles llamadas de margen (marzo 2026)	
Colateral en Tránsito	72
Downgrade (marzo 2026)	
Baja calificación 3 niveles	6,214

La exposición en instrumentos financieros derivados del Banco al cierre de marzo 2026 es la siguiente:

Scotiabank-Exposición en Derivados (cifras en millones de pesos)	Posición Cierre
Factor de Riesgo	
Tasas de interés	3,198,372
Tipo de cambio	356,145
Capitales	15,223
Total	3,569,740

g) El descalce en divisas;

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

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

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

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

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

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

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

El impacto al Coeficiente de Cobertura de Liquidez derivado de la Consolidación para el Banco es menor a 1% durante todo el primer trimestre del 2026, adicionalmente, las salidas causadas por el apoyo financiero otorgado a las entidades que son parte del mismo grupo financiero fueron de 5.5% al cierre de marzo del 2026 y en promedio durante primer trimestre del 2026 fue de 6.2%.

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

I. Información cuantitativa:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Adicional a los controles que se han descrito a lo largo del presente boletín, Scotiabank cuenta también con métricas diseñadas para medir la exposición en diferentes escenarios en los que la liquidez pueda verse comprometida; dentro de estos escenarios se contemplan en aquellas situaciones en las que por limitaciones legales, regulatorias y operacionales limiten el flujo normal de las fuentes de financiamiento de la institución y represente un riesgo de liquidez, estas métricas son el Cash Gap, el horizonte de supervivencia y los activos líquidos en periodo de estrés, los cuales cuentan con las siguientes exposiciones a finales de marzo 2026.

[6] Sujeto a excepciones para algunos nombres.

Stress Test	Promedio T1 2026	Marzo 2026
Cash GAP 30 d - Grupo – estresado (MXN MM)	351	(13,097)
Cash GAP 90 d - Grupo – estresado (MXN MM)	712	(26,116)
Horizonte de Supervivencia – Banco (días)	40	39
Horizonte de Supervivencia - Banco – estresado (días)	37	36
Horizonte de Supervivencia – Grupo (días)	40	39
Horizonte de Supervivencia - Grupo – estresado (días)	34	36

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

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

Los resultados al cierre de marzo 2026 y el promedio del primer trimestre 2026 son:

Scotiabank [7]	Posición (Cierre)[8]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	6,252	16,930
Liquidity Buffer (bajo métrica CCL)	118,020	117,008

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

II. Información cualitativa

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

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

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

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

[7] Sujeto a excepciones para algunos nombres.
[8] Cifras previas al cierre de marzo 2026.

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;

c) 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.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

f) Una descripción de los planes de financiamiento contingentes.

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

Los objetivos generales del Plan de Financiamiento de Contingencia son:

- Identificar las amenazas potenciales que puedan llegar a afectar seriamente la liquidez del Grupo y subsidiarias.
- Apegarse a los sistemas de alertas tempranos, descritos en el Plan de Acción para la Conservación del Capital y la Liquidez.
- Establecer planes de acción para tratar los riesgos de liquidez que el Grupo pudiera enfrentar durante el periodo de crisis.
- Plantear acciones que aseguren que el riesgo de liquidez global del Grupo este dentro de los límites de tolerancia aprobados por el Consejo de Administración.
- Asegurar la disponibilidad del personal, información y fuentes necesarias en el evento de crisis para permitir una buena toma de decisiones.
- Asegurar que la información sea proveída al Comité de Manejo de Liquidez y el Capital de manera oportuna.
- En caso de requerir liquidez adicional a la ordinaria, Banco de México podrá otorgar financiamiento mediante alguna de las siguientes operaciones o combinación de estás: (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 cuarto trimestre de 2025, 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 cuarto trimestre 2025, se ubica en el Escenario I (i.e Escenario I, cuando el Coeficiente de Cobertura de Liquidez correspondiente a cada día del mes calendario inmediato anterior sea al menos de 100 por ciento).

Anexo 10. Formato de revelación del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (CFEN)
Periodo Reportado: primer trimestre del 2026
Tabla I.3 Formato de revelación del Coeficiente Estable Neto[9]

(Cifras en millones de pesos)		Cifras Individuales					Cifras Consolidadas				
		Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado	Importe sin ponderar por plazo residual				Importe ponderado
		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año		Sin vencimiento	< 6 meses	De 6 meses a < 1 año	>1 año	
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE DISPONIBLE											
1	Capital:	109,081.17	0.00	0.00	0.00	109,081.17	109,081.17	0.00	0.00	0.00	109,081.17
2	Capital fundamental y capital básico no fundamental.	109,081.17	0.00	0.00	0.00	109,081.17	109,081.17	0.00	0.00	0.00	109,081.17
3	Otros instrumentos de capital.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
4	Depósitos minoristas:	0.00	198,726.75	2,184.69	17.38	185,147.24	0.00	198,726.75	2,184.69	17.38	185,147.24
5	Depósitos estables.	0.00	85,664.84	526.38	15.04	81,896.71	0.00	85,664.84	526.38	15.04	81,896.71
6	Depósitos menos estables.	0.00	113,061.91	1,658.30	2.34	103,250.53	0.00	113,061.91	1,658.30	2.34	103,250.53
7	Financiamiento mayorista:	0.00	347,246.98	35,251.86	66,432.69	200,212.42	0.00	347,246.98	35,251.86	66,432.69	200,212.42
8	Depósitos operacionales.	0.00	41,753.85	0.00	0.00	20,876.93	0.00	41,753.85	0.00	0.00	20,876.93
9	Otro financiamiento mayorista.	0.00	305,493.13	35,251.86	66,432.69	179,335.49	0.00	305,493.13	35,251.86	66,432.69	179,335.49
10	Pasivos interdependientes	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
11	Otros pasivos:	392.56	65,132.58	0.00	2,197.14	2,197.14	392.56	65,132.58	0.00	2,197.14	2,197.14
12	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto	392.56	0.00	0.00	0.00	0.00	392.56	0.00	0.00	0.00	0.00
13	Todos los pasivos y recursos propios no incluidos en las categorías anteriores.	0.00	65,132.58	0.00	2,197.14	2,197.14	0.00	65,132.58	0.00	2,197.14	2,197.14
14	Total del Monto de Financiamiento Estable Disponible	109,473.74	611,106.31	37,436.55	68,647.21	496,637.97	109,473.74	611,106.31	37,436.55	68,647.21	496,637.97
ELEMENTOS DEL MONTO DE FINANCIAMIENTO ESTABLE REQUERIDO											
15	Total de activos líquidos elegibles para efectos del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,530.87	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	8,530.87
16	Depósitos en otras instituciones financieras con propósitos operacionales.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
17	Préstamos al corriente y valores:	0.00	102,111.23	39,701.91	300,264.81	356,943.68	0.00	102,111.23	39,701.91	300,264.81	356,943.68
18	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles de nivel I.	0.00	4,862.44	0.00	0.00	486.24	0.00	4,862.44	0.00	0.00	486.24
19	Financiamiento garantizado otorgado a entidades financieras con activos líquidos elegibles distintos de nivel I.	0.00	9,482.82	6,327.25	3,659.16	8,245.21	0.00	9,482.82	6,327.25	3,659.16	8,245.21

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

20	Financiamiento garantizado otorgado a contrapartes distintas de entidades financieras, las cuales:	0.00	69,898.30	30,076.33	142,088.92	163,230.62	0.00	69,898.30	30,076.33	142,088.92	163,230.62
21	Tienen un ponderador de riesgo de crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar para riesgo de crédito de Basilea II.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
22	Créditos a la Vivienda (vigentes), de los cuales:	0.00	4,548.93	4,837.54	268,405.89	175,479.72	0.00	4,548.93	4,837.54	268,405.89	175,479.72
23	Tienen un ponderador de riesgo crédito menor o igual a 35% de acuerdo al Método Estándar establecido en las Disposiciones.	0.00	1,583.01	1,700.28	116,207.36	77,176.43	0.00	1,583.01	1,700.28	116,207.36	77,176.43
24	Títulos de deuda y acciones distintos a los Activos Líquidos Elegibles (que no se encuentren en situación de impago).	0.00	14,901.75	161.07	2,318.20	9,501.88	0.00	14,901.75	161.07	2,318.20	9,501.88
25	Activos interdependientes.	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
26	Otros Activos:	0.00	73,042.22	968.19	8,573.73	42,998.37	0.00	73,042.22	968.19	8,573.73	42,998.37
27	Materias primas básicas (commodities) comercializadas físicamente, incluyendo oro.	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00	0.00	No Aplica	No Aplica	No Aplica	0.00
28	Margen inicial otorgado en operaciones con instrumentos financieros derivados y contribuciones al fondo de absorción de pérdidas de contrapartes centrales	No Aplica	5,206.08	0.00	0.00	4,425.17	No Aplica	5,206.08	0.00	0.00	4,425.17
29	Activos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto.	No Aplica	0.00	0.00	0.00	92.24	No Aplica	0.00	0.00	0.00	92.24
30	Pasivos por derivados para fines del Coeficiente de Financiamiento Estable Neto antes de la deducción por la variación del margen inicial	No Aplica	0.00	0.00	0.00	887.98	No Aplica	0.00	0.00	0.00	887.98
31	Todos los activos y operaciones no incluidos en las categorías anteriores.		67,836.14	968.19	8,573.73	37,592.98	0.00	67,836.14	968.19	8,573.73	37,592.98
32	Operaciones fuera de balance.	No Aplica	291,124.26	0.00	0.00	14,556.21	No Aplica	291,124.26	0.00	0.00	14,556.21
33	Total, de Monto de Financiamiento Estable Requerido.	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	423,029.13	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	423,029.13
34	Coeficiente de Financiamiento Estable Neto (%).	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	117.40	No Aplica	No Aplica	No Aplica	No Aplica	117.40

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

Durante marzo 2026, los principales rubros que determinaron el nivel del CFEN son los siguientes:

- Fondeo Estable Disponible:

Fondeo Disponible ponderado por depósitos de exigibilidad inmediata por $190,095 millones y depósitos a plazo tradicionales por $118,311 millones, Capital (fundamental y complementario) por $109,437 millones, fondeo Interbancario y fondeo profesional por $30,472 millones y $41,119 millones respectivamente; y finalmente fondeo colateralizado por $2,043 millones.

- Fondeo Estable Requerido:

Fondeo Requerido ponderado por carteras de $361,221 millones y por operaciones mercado de dinero de $18,786 millones, compromisos crediticios y apoyo estimado a entidades financieras del grupo por $17,541 millones, deducciones de capital por $12,566 millones y finalmente, requerimiento por operaciones de derivados por $ 867 millones.

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

Promedio del del cuarto trimestre del 2025: 114.64%– Promedio del primer trimestre del 2026: 117.40%

El coeficiente de financiamiento neto incrementó 276pb respecto al cuarto trimestre del 2025, esto debido:

a) El fondeo Estable Disponible tuvo los siguientes cambios: El fondeo tradicional disminuyó en MXN 2,131 millones. El fondeo profesional disminuyó en MXN 874 millones.

b) El fondeo Estable Requerido tuvo los siguientes cambios: Las carteras de crédito ponderadas aumentaron $1,398 millones.

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

Monto Computable (MXN MM)	Enero	Febrero	Marzo
Financiamiento Estable Disponible	494,388	502,210	493,316
Financiamiento Estable Requerido	421,844	424,470	422,774
Coeficiente de Fondeo Estable Neto	117.20%	118.31%	116.69%

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

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

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

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

Posiciones en Acciones

Al cierre de marzo de 2026 la posición accionaria de títulos para negociar asciende $22.12 millones de pesos, con una plusvalía de $0.35 millones de pesos.

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Importe Valuado	Costo	Plusvalía/ Minusvalía
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	2,100	4.18	4.08	0.10
Scotiabank	Pública	1A_DEO_N	1,500	2.01	2.00	0.01
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	115,000	1.87	1.81	0.06
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	-	-	(0.03)	0.03
Scotiabank	Pública	1I_MBIL_N	324	4.22	4.12	0.10
Scotiabank	Pública	1_AERO_*	40,000	1.01	1.06	(0.05)
Scotiabank	Pública	1I_VMSTX_N	2,800	8.83	8.73	0.10
Total			161,724	22.12	21.77	0.35

Al cierre del primer trimestre del año 2026, se reflejó una utilidad acumulada proveniente de las ventas por $0.63 millones de pesos.

La posición se integra como sigue:

Institución	Tipo de Cotización	Emisora	Títulos	Utilidad	Pérdida	Utilidad/ Pérdida
Scotiabank	Pública	1_CUERVO_*	160,693	0.04	(0.02)	0.02
Scotiabank	Pública	1_WALMEX_*	160,351	0.12	(0.01)	0.11
Scotiabank	Pública	1_LIVEPOL_C-1	28,587	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_ARA_*	67,490	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1I_SHV_*	1,800	-	(0.13)	(0.13)
Scotiabank	Pública	1_AC_*	5,346	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1_FEMSA_UBD	43,252	0.06	(0.02)	0.04
Scotiabank	Pública	1_GFINBUR_O	356	-	-	-
Scotiabank	Pública	1A_DEO_N	1,800	0.04	(0.01)	0.03
Scotiabank	Pública	1_ORBIA_*	95,000	0.02	(0.01)	0.01
Scotiabank	Pública	1A_STZ_*	818	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1I_IB1MXX_N	106	-	-	-
Scotiabank	Pública	1_AMX_B	139,489	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1_GCARSO_A1	43,406	0.18	(0.01)	0.17
Scotiabank	Pública	1_NEMAK_A	300,000	0.05	-	0.05
Scotiabank	Pública	1_ASUR_B	3,000	0.06	-	0.06
Scotiabank	Pública	1_ALPEK_A	48,662	0.01	(0.01)	-
Scotiabank	Pública	1I_MBIL_N	59	0.01	-	0.01
Scotiabank	Pública	1_GMEXICO_B	41,179	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1I_VMSTX_N	660	0.02	-	0.02
Scotiabank	Pública	1A_MSFT_*	800	0.07	(0.08)	(0.01)
Scotiabank	Pública	1A_QCOM_*	700	0.04	-	0.04
Scotiabank	Pública	1_SITES1_A-1	213,647	0.11	(0.07)	0.04
Scotiabank	Pública	1_TLEVISA_CPO	75,000	0.03	-	0.03
Scotiabank	Pública	1_VOLAR_A	291,494	0.08	(0.10)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1_AERO_*	24,648	-	(0.02)	(0.02)
Scotiabank	Pública	1_TRAXION_A	20,177	-	(0.01)	(0.01)
Total			1,768,520	1.13	(0.50)	0.63

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

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

Al 31 de marzo, para efectos del cálculo de índice de capital, la posición accionaria generó un requerimiento de capital de $47.24 millones, el requerimiento de capital por riesgo de mercado asciende a la cantidad de $34.74 millones de pesos y el requerimiento por riesgo especifico asciende a la cantidad de $12.50 millones de pesos.

Requerimientos de Capitalización	Total Larga	Total Corta	Valor Absoluto de la posición	Coeficiente de Riesgo de mercado	Requerimiento de capital
Por Riesgo General de Mercado	156.27	-	156.27	22.23%	34.74
Por riesgo específico		-			
Canasta de acciones,	156.27	-	156.27	8.00%	12.50
Índices accionarios	-	-	-	4.00%	0.00
Requerimiento por riesgos específico	-	-	-	4.00%	0.00
Total Requerimiento de capital					47.24

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	dic-25	mar-25
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)	827,192	829,597
2	(Importes de los activos deducidos para determinar el capital de nivel 1 de Basilea III)	(12,553)	(12,303)
3	Exposiciones dentro del balance (Netas) (excluidos instrumentos financieros derivados y SFT, suma de las líneas 1 y 2)	814,639	817,294
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)	4,430	3,907
5	Importes de los factores adicionales por exposición potencial futura, asociados a todas las operaciones con instrumentos financieros derivados	8,946	9,446
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)	(5,741)	(2,804)
8	(Exposición por operaciones en instrumentos financieros derivados por cuenta de clientes, en las que el socio liquidador no otorga su garantía en caso del incumplimiento de las obligaciones de la Contraparte Central)	-	-
9	Importe nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos	-	-
10	(Compensaciones realizadas al nocional efectivo ajustado de los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos y deducciones de los factores adicionales por los instrumentos financieros derivados de crédito suscritos)	-	-

11	Exposiciones totales a instrumentos financieros derivados (suma de las líneas 4 a 10)	7,634	10,549
Exposiciones por operaciones de financiamiento con valores			
12	Activos SFT brutos (sin reconocimiento de compensación), después de ajustes por transacciones contables por ventas	2,400	6,311
13	(Cuentas por pagar y por cobrar de SFT compensadas)	(340)	(6,311)
14	Exposición Riesgo de Contraparte por SFT	54	89
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)	2,115	89
Otras exposiciones fuera de balance			
17	Exposición fuera de balance (importe nocional bruto)	356,460	353,430
18	(Ajustes por conversión a equivalentes crediticios)	(264,169)	(265,359)
19	Partidas fuera de balance (suma de las líneas 17 y 18)	92,290	88,071
Capital y exposiciones totales			
20	Capital de Nivel 1	94,999	96,777
21	Exposiciones totales (suma de las líneas 3, 11, 16 y 19)	916,679	916,002
Coeficiente de apalancamiento			
22	Coeficiente de apalancamiento de Basilea III	10.36%	10.57%

Tabla II.1

Comparativo de los activos totales y los activos ajustados

Referencia	Descripción	dic-25	mar-26
1	Activos totales	893,217	899,328
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	(1,087)	(1,087)
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	(55,990)	(52,871)
5	Ajuste por operaciones de reporto y préstamo de valores	(285)	(6,222)
6	Ajuste por partidas reconocidas en cuentas de orden	92,290	88,071
7	Otros ajustes	(11,466)	(11,216)
8	Exposición del coeficiente de apalancamiento	916,679	916,002

Tabla III.1

Conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

Referencia	Descripción	dic-25	mar-26
1	Activos totales	893,217	899,328
2	Operaciones en instrumentos financieros derivados	(63,624)	(63,420)
3	Operaciones en reporto y préstamos de valores	(2,400)	(6,311)
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	827,192	829,597

Tabla IV.1
Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos (numerador y denominador) de la razón de apalancamiento

Concepto/Periodo	dic-25	mar-26	Variación
Capital Básico [1)]	89,845	96,777	1,778
Activos Ajustados[2)]	896,623	916,002	(676)
Razón de Apalancamiento [3)]	10.02%	10.57%	0.20%

1). *Reportado en la fila 20*
2). *Reportado en la fila 21 y*
3). *Reportado en la fila 22, de la Tabla I.1*
Cifras previas a la réplica de Banxico

Principales causas de las variaciones más importantes de los elementos de la Razón de Apalancamiento por el periodo de diciembre 2025 a marzo de 2026.

El indicador se ubicó en 10.57%, un incremento de 20pb respecto al trimestre anterior, debido al crecimiento del capital básico por $1,778 millones (+19pb) principalmente por las utilidades del periodo (+48 pb) que se vieron disminuidas por un decreto de dividendos (-33 pb); los Activos Ajustados tuvieron una ligera disminución de $676 millones (+1 pb).

Tabla I.2
Notas al formato de revelación estandarizado de revelación para la razón de apalancamiento

Referencia	Explicación
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico (menos los activos presentados en dicho balance por: 1) operaciones con instrumentos financieros derivados, 2) operaciones de reporto y 3) préstamo de valores.
2	Monto de las deducciones del capital básico establecidas en los incisos b) a r) de la fracción I, del Artículo 2 Bis 6 de las presentes disposiciones. El monto se debe registrar con signo negativo.
3	Suma de las líneas 1 y 2
4	Costo actual de remplazo (RC) de las operaciones con instrumentos financieros derivados, conforme a los establecido en el Anexo 1-L de las presentes disposiciones, menos las liquidaciones parciales en efectivo (margen de variación en efectivo) *recibidas,* siempre que se cumpla con las condiciones siguientes: **a)** Tratándose de contrapartes distintas a las cámaras de compensación señaladas en el segundo párrafo del Artículo 2 Bis 12 a, el efectivo recibido deberá de estar disponible para la Institución. **b)** La valuación a mercado de la operación sea realizada diariamente y el efectivo recibido sea intercambiado con la misma frecuencia. **c)** El efectivo recibido, así como la operación con el instrumento derivado, estén denominados en la misma moneda. **d)** El monto intercambiado del margen de variación en efectivo sea al menos el importe necesario para cubrir el valor de mercado considerando el umbral y el monto mínimo transferido acordados en el contrato marco correspondiente. **e)** El contrato marco con la contraparte debe considerar tanto la operación como el margen de variación, y debe estipular explícitamente que la liquidación, en caso de incumplimiento, quiebra, reestructuración o insolvencia, de cualquiera de las partes, se realizará tras compensar las operaciones y considerará los márgenes de variación en efectivo recibidos. En todo caso, el importe máximo de márgenes de variación en efectivo recibidos que se podrá considerar será el que corresponda al valor positivo del costo actual de reemplazo de cada contraparte.
5	Factor adicional conforme al Anexo 1-L de las presentes disposiciones, de las operaciones con instrumentos financieros derivados. Adicionalmente, tratándose de instrumentos financieros derivados de crédito en los que se provea protección crediticia, se deberá incluir el valor de conversión a riesgo de crédito de conformidad con el Artículo 2 Bis 22 de las presentes disposiciones. En ningún caso podrán utilizarse las garantías reales financieras que la Institución haya recibido para reducir el importe del Factor adicional reportado en esta línea.
6	No aplica. El marco contable no permite la baja de activos entregados como colateral.

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

Tabla II.2

Notas al comparativo de los activos totales y los activos ajustados

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

Tabla III.2

Notas a la conciliación entre activo total y la exposición dentro del balance

Referencia	Descripción
1	Total de activos de la Institución sin consolidar subsidiarias ni entidades de propósito específico.
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
Standard & Poor's	mxAAA	mxA-1+	Estable
Moody´s[1]	AAA.mx	ML A-1.mx	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 (Standard & Poor's y Moody´s), en su calidad de emisor a escala nacional y están sujetas a modificaciones sin previo aviso por parte de las Agencias Calificadoras.

Dividendos

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Mediante Asamblea General Ordinaria de Accionistas de fecha 20 de mayo del 2025, se aprobó decretar y pagar un dividendo en efectivo, hasta por la cantidad de $3,000,000,000.00 (tres mil millones de pesos 00/100 M.N.), a razón de $0.318461180865 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420'300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientas treinta y tres) acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de la Sociedad, con cargo a la cuenta de "Resultado de Ejercicios Anteriores".

Mediante Asamblea General Ordinaria de accionistas de fecha 23 de marzo de 2026, se aprobó decretar y pagar un dividendo hasta por la cantidad de $3,000,000,000.00 (tres mil millones de pesos 00/100 M.N.), a razón de $0.318461180865 por acción, para distribuirlos entre la totalidad de las acciones en circulación, es decir, sobre las 9,420'300,433 (Nueve mil cuatrocientas veinte millones trescientas mil cuatrocientas treinta y tres) acciones de las series "F" y "B" que integran el capital social suscrito y pagado de la Sociedad mediante una sola exhibición en efectivo, con cargo a la cuenta de "Resultado de Ejercicios Anteriores. Asimismo, se aprobó que el dividendo se pagara en una sola exhibición, el 24 de marzo de 2026.

Fuentes internas y externas de liquidez

Al 31 de marzo de 2026, 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$106,738 millones de pesos.
- Efectivo y equivalentes de efectivo en bancos y reservas con el Banco Central por MXN$37,769 millones de pesos.

Adicionalmente:

- Se cuenta con líneas comprometidas con Instituciones Extranjeras por USD $250 millones de dólares.
- Se mantiene una buena calificación de crédito para asegurar acceso a préstamos a tasas y plazos competitivos.
- Se cuenta con una amplia base de depósitos tradicionales (Vista y Plazo), bien diversificada y segmentada entre los diferentes tipos de depositantes de tal forma que no se cuenta con dependencias relevantes que comprometan la liquidez de la institución.
- Adicionalmente se cuenta con préstamos de la banca de desarrollo y de fomento (Fovi, Nafin, Fira, entre otros) cuyas funciones son contar con una fuente de fondeo destinada a apoyar sectores específicos de la economía.

Inversiones relevantes en capital

Al 31 de marzo de 2026, el Banco no cuenta con inversiones relevantes de Capital.

Instrumentos Financieros Derivados

INFORME TRIMESTRAL **T1 2026**

Instrumentos Financieros Derivados

SCOTIABANK INVERLAT

I. Información cualitativa

A) Discusión sobre las políticas de uso de instrumentos financieros derivados

La Dirección General del Grupo Financiero Scotiabank Inverlat (GFSBI), al cual pertenece Scotiabank Inverlat (SBI) y un comité designado por el Consejo de Administración revisan por lo menos con periodicidad semestral y cada vez que las condiciones del mercado lo ameritan, los objetivos, metas y procedimientos de operación y control, así como los niveles de tolerancia de riesgo. Para tales efectos, la Dirección General se apoya en las áreas u órganos apropiados (Consejo de Administración, Comité de Riesgos) para llevar a cabo las actividades específicas en los requerimientos de administración que marca la Circular 4/2012 emitida por Banco de México.

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

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

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

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

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

Los derivados operados podrán ser clasificados en los siguientes rubros:

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

2). *(MR) Mercados reconocidos*

3). *(ME) Mercados extrabursátiles*

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

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

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

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

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

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

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

Scotiabank Inverlat, asume riesgos de liquidez como una parte intrínseca a su función de intermediación. El riesgo de liquidez es el resultado de desfases en los flujos de efectivo. El objetivo del proceso de administración de riesgo de liquidez es garantizar que Scotiabank Inverlat pueda cubrir la totalidad de sus obligaciones a medida que 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 marzo 2026 y en promedio para el primer trimestre de 2026 es de:

Scotiabank– Brechas de liquidez acumuladas (millones de pesos)	Posición (Cierre)[10]	Posición (Promedio)
Brecha acumulada 30 días (MXN+UDIs+USD)	6,252	16,930
Liquidity Buffer	118,020	117,008

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

Inventario de modelos de derivados

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

Instrumentos VALUADOS a valor razonable

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

[10] Cifras previas al cierre de marzo 2026.

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

Instrumentos VALUADOS a COSTO

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

Políticas Líneas de Crédito

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

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

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

Productos del mercado financiero autorizados para operar en el Banco

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

Sujetos de Crédito

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

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

Reglas Particulares

Metodología utilizada para el consumo de Líneas:

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

Idoneidad del Cliente

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

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

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

Políticas de VaR

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

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

B) Descripción de políticas y técnicas de valuación

Métodos y técnicas de Valuación:

Cálculo de Sensibilidades

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

Portafolio de Renta Fija (Bonos)

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

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

Bonos de Tasa Flotante

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

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

Bonos Cupón Cero

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

Riesgo de Crédito

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

Sensibilidad del Pasivo

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

Derivados de Tasas de Interés

Swaps de Tasa de Interés

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

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

Futuros de TIIE

Se considera la duración para estimar su sensibilidad.

Futuros de Bono M

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

Futuros de CETE

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

Efectividad de la Cobertura:

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

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

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

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

Grado de relación entre los cambios observados: $R2 \geq 80\%$.
Pendiente de la regresión entre [-1.25 y -0.80].
Significancia de la regresión: $F > 5$.

Lo anterior para comprobar que la tasa de cambio de respuesta del valor de la posición primaria respecto al cambio de una unidad en el valor del instrumento de cobertura cumpla con el criterio para concluir cobertura efectiva, en adición, la NIF C-10 especifica que mientras los términos críticos entre la cobertura y la posición cubierta estén cercanamente alineados, es posible concluir cualitativamente que se trata de una cobertura efectiva. Al cierre de marzo 2026 y como resultado del proceso de revisión y monitoreo de las operaciones de cobertura, se concluye que la totalidad de operaciones son coberturas efectivas.

Durante el primer trimestre de 2026 no se observaron cambios en la posición primaria ni en los derivados que implicaran la necesidad de deshacer coberturas por inefectividad.

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

Cobertura de Flujos de efectivo:

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

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

Cobertura de Valor Razonable:

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

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

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

C) Información de riesgos por el uso de derivados

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

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

Al cierre de marzo de 2026 y promedio del primer trimestre 2026 se cuentan con los siguientes activos líquidos:

Scotiabank– (millones de pesos)	Posición (Cierre)[11]	Posición (Promedio)
Liquidity Buffer	118,020	117,008

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.

[11] Cifras previas al cierre del primer trimestre 2026.

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:

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

Aquellos instrumentos financieros derivados con MTM Negativo:

$$SD = \sum_{i=1}^{n} SD_i$$
$$SD_i = Max\left(\left|MTM\right| - T_{ij}, \left(T_{ii} - T_{ij}\right)\right)$$

En donde:

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

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

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

Scotiabank (millones de pesos)	Normal	Escenario Posible	Escenario Probable	Escenario Estrés
Gap 30d Gap Acum	6,252	5,940	5,315	5,002
Cambios en el Gap respecto al escenario normal		(312)	(937)	(1,250)

D) Análisis de sensibilidad y cambios en el valor razonable.

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

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

Delta

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

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

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

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

Gamma

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

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

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

Vega

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

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

Rho

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

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

Theta

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

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

Dividend Risk

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

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

II. Información Cuantitativa

Cifras expresadas en pesos

A) Análisis de sensibilidades del portafolio de operaciones derivadas de tasa.

Resumen Sensibilidades (PV01) – Portafolio de Derivados de Tasas de Interés a marzo 31, 2026.

	0-3 Months	3-12 Months	1 - 3 Years	3 - 5 Years	5 - 10 Years	10 - 30 Years	Total Today
Swaps	(150,014.38)	841,957.13	(335,650.25)	395,872.46	68,314.23	(320,380.55)	500,098.64
CCS	(38.93)	(71.01)	2,256.40	9,241.97	5,091.54	100,443.24	116,923.21
Caps&Floors	(149.98)	4.42	204.36	353.22	-	-	412.02
Binary Caps&Floors	(12.88)	-	-	-	-	-	(12.88)
F TIIE Futures	-	-	-	-	-	-	-
Total	(150,216.17)	841,890.54	(333,189.49)	405,467.65	73,405.77	(219,937.31)	617,420.99

Análisis de sensibilidad

Supuestos de Cálculo.

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

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

Los impactos en los estados de resultados son:

a) Bajo el escenario probable una pérdida de (82.46) Millones de pesos.

b) Con escenario poco probable un P&L de (164.91) Millones de pesos.

c) Y finalmente con el escenario muy poco probable (381.41) Millones de pesos.

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

Tipo Sensibilidad	Instrumento	Sensibilidad	MTM	Probable Shock (+/-)	P&L	Stress 1 Shock (+/-)	P&L	Stress 2 Shock (+/-)	P&L
- 1pb a la tasa	Futuros de TIIE y Bono M	-	-	50.00	-	100.00	-	200.00	-
- 1pb a la tasa	IRS & CCS & Delta Caps	0.62	3.09	50.00	(30.87)	100.00	(61.74)	200.00	(123.48)
Volatilidad al 1%	Caps &Floors	-	0.11	0.10	-	0.40	-	1.00	-
a FX %	Forwards	28.78	515.86	0.10	(51.59)	0.20	(103.17)	0.50	(257.93)
a FX %	Opciones Divisa	-	-	0.10	-	0.20	-	0.50	-
Total					(82.46)		(164.91)		(381.41)

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 31 de marzo de 2026 (la sensibilidad de la mayoría de opciones es Back to Back, es decir el riesgo está cerrado).

Opciones	Delta	Vega	Gamma
Options ADBE.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options CRM.N	-	-	-
Options LULU.OQ	-	-	-
Options MELI.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MXWOAS3D.INDX	-	-	-
Options NVO.N	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SMH.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options SPY.P	-	-	-
Options TSM.N	-	-	-
Options UNH.N	-	-	-
Options V.N	-	-	-
Options XLV.P	-	-	-
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 ADBE.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options CRM.N	-	-	-
Options LULU.OQ	-	-	-
Options MELI.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MXWOAS3D.INDX	-	-	-
Options NVO.N	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SMH.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options SPY.P	-	-	-
Options TSM.N	-	-	-
Options UNH.N	-	-	-
Options V.N	-	-	-
Options XLV.P	-	-	-
Total	-	-	-

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

Escenarios al alza	0.05	0.15	0.2
Options ADBE.OQ	-	-	-
Options AMZN.OQ	-	-	-
Options CRM.N	-	-	-
Options LULU.OQ	-	-	-
Options MELI.OQ	-	-	-
Options MEXBOL.INDX	-	-	-
Options MXWOAS3D.INDX	-	-	-
Options NVO.N	-	-	-
Options QQQ.OQ	-	-	-
Options SMH.OQ	-	-	-
Options SPX.INDX	-	-	-
Options SPXFP.INDX	-	-	-
Options SPXSR5.INDX	-	-	-
Options SPY.P	-	-	-
Options TSM.N	-	-	-
Options UNH.N	-	-	-
Options V.N	-	-	-
Options XLV.P	-	-	-
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:

Escenario	Monto
Probable	-
Poco Probable	-
Muy poco Probable	-

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

Respecto a las llamadas de margen, al 31 de marzo de 2026 se tienen los siguientes saldos:

Contraparte	Colateral Recibido MXN	Colateral Enviado MXN	Colateral Recibido USD	Colateral Enviado USD
CLIENTE 1	22,000,000.00	(34,700,000.00)	22,360,000.00	(20,595,000.00)
CLIENTE 2	2,356,000,000.00	(1,094,000,000.00)	-	-
CLIENTE 3	-	-	3,700,000.00	(6,200,000.00)
CLIENTE 4	-	-	12,420,000.00	(2,720,000.00)
CLIENTE 5	-	(3,761,624.95)	20,315,000.00	(22,300,000.00)
CLIENTE 6	-	0.00	910,000.00	(1,820,000.00)
CLIENTE 7	-	0.00	48,600,000.00	(118,300,000.00)
CLIENTE 8	-	0.00	228,100,000.00	(315,400,000.00)
CLIENTE 9	-	0.00	7,380,000.00	(10,310,000.00)
CLIENTE 10	-	0.00	28,310,000.00	(19,710,000.00)
CLIENTE 11	61,700,000.00	(93,800,000.00)	-	-
CLIENTE 12	188,100,000.00	(144,600,000.00)	-	-
CLIENTE 13	258,900,000.00	(36,500,000.00)	3,830,000.00	(22,550,000.00)
CLIENTE 14	892,304,731.49	(499,499,666.00)	-	-
CLIENTE 15	-	(36,300,000.00)	-	-
CLIENTE 16	-	-	270,000.00	(1,800,000.00)
CLIENTE 17	-	-	3,240,000.00	(1,570,000.00)
CLIENTE 18	966,300,000.00	(239,600,000.00)	-	-
CLIENTE 19	27,600,000.00	(13,700,000.00)	-	-
CLIENTE 20	15,800,000.00	(15,800,000.00)	-	-
TOTAL	4,788,704,731.49	(2,212,261,290.95)	379,435,000.00	(543,275,000.00)

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

Producto	Fecha de evento	Cliente	Divisa	Monto a liquidar	Motivo del incumplimiento
Opción	ene-26	Cliente 1	MXN	241,859	No pago el cliente
Opción	ene-26	Cliente 2	MXN	104,829	No pago el cliente
Swaps	ene-26	Cliente 3	USD	1,477	No pago el cliente
Swaps	ene-26	Cliente 4	USD	5,245	No pago el cliente
Swaps	ene-26	Cliente 5	USD	229,485	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 6	MXN	725,880	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 7	USD	40,000	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 8	MXN	14,937,000	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 9	USD	750,000	No pago el cliente
Otros	feb-26	Cliente 10	MXN	12,128,442	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 11	MXN	627,540	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 12	MXN	726,980	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 13	USD	40,000	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 14	EUR	731	No pago el cliente
Swaps	feb-26	Cliente 15	USD	23,359	No pago el cliente
Swaps	feb-26	Cliente 16	USD	1,709	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 17	MXN	13,074,910	No pago el cliente
Forwards	feb-26	Cliente 18	USD	751,000	No pago el cliente
Swaps	mar-26	Cliente 19	USD	587	No pago el cliente
Forwards	mar-26	Cliente 20	MXN	346,320	No pago el cliente
Swaps	mar-26	Cliente 21	MXN	139,458	No pago el cliente

Describir y numerar los Instrumentos Financieros Derivados que hayan vencido durante el trimestre

Cifras expresadas en pesos

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
XCU866	01/04/2026	Active	-	usd/mxn	51,906,065	2,893,105	-
XCU654	31/03/2026	Active	-	usd/mxn	45,103,660	2,488,265	-
M00982314	31/03/2026	Active	6,231,531	mxn	-	6,231,531	-
M00982310	31/03/2026	Active	19,668,392	mxn	-	19,668,392	-
M00982311	31/03/2026	Active	87,393,550	mxn	87,393,550	-	-
M00982312	31/03/2026	Active	95,216,472	mxn	95,216,472	-	-
M00982313	31/03/2026	Active	156,710,099	mxn	156,710,099	-	-
M00980505	30/03/2026	Active	91,795,956	mxn	91,795,956	-	-
M00980506	30/03/2026	Active	153,698,760	mxn	153,698,760	-	-
XCU421	30/03/2026	Active	-	usd/mxn	47,175,492	2,607,173	-
M00978729	27/03/2026	Active	75,804,840	mxn	75,804,840	-	-
M00978730	27/03/2026	Active	100,721,715	mxn	100,721,715	-	-
M00978731	27/03/2026	Active	3,194,596	mxn	3,194,596	-	-
M00978732	27/03/2026	Active	17,273,802	mxn	-	17,273,802	-
XCU152	27/03/2026	Active	-	usd/mxn	43,891,933	2,469,064	-
M00977809	26/03/2026	Active	87,776,706	mxn	87,776,706	-	-
M00977811	26/03/2026	Active	149,294,892	mxn	149,294,892	-	-
XCT962	26/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,807,926	2,807,401	-
XCT740	25/03/2026	Active	-	usd/mxn	50,401,531	2,835,258	-
M00975276	25/03/2026	Active	96,731,626	mxn	96,731,626	-	-
XCT531	24/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,312,217	2,777,887	-
M00973209	24/03/2026	Active	91,819,145	mxn	91,819,145	-	-
M00973210	24/03/2026	Active	153,676,592	mxn	153,676,592	-	-
M00970078	23/03/2026	Active	81,779,073	mxn	81,779,073	-	-
M00970079	23/03/2026	Active	18,320,635	mxn	-	18,320,635	-
M00970080	23/03/2026	Active	92,797,600	mxn	92,797,600	-	-
M00970081	23/03/2026	Active	1,487,370	mxn	1,487,370	-	-
M00970082	23/03/2026	Active	154,768,668	mxn	154,768,668	-	-
XCT280	23/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,184,713	2,739,340	-
XCT062	20/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,177,935	2,754,804	-
M00967326	20/03/2026	Active	17,467,256	mxn	-	17,467,256	-
M00967327	20/03/2026	Active	1,417,731	mxn	1,417,731	-	-
M00967328	20/03/2026	Active	80,911,486	mxn	80,911,486	-	-
M00967329	20/03/2026	Active	77,752,324	mxn	77,752,324	-	-
M00967330	20/03/2026	Active	142,614,286	mxn	142,614,286	-	-
XCS867	19/03/2026	Active	-	usd/mxn	46,097,743	2,590,969	-
M00965430	19/03/2026	Active	16,059,814	mxn	-	16,059,814	-
M00965426	19/03/2026	Active	70,539,277	mxn	70,539,277	-	-
M00965427	19/03/2026	Active	6,216,711	mxn	6,216,711	-	-
M00965428	19/03/2026	Active	210,598,499	mxn	210,598,499	-	-
XCS650	18/03/2026	Active	-	usd/mxn	45,109,067	2,554,047	-
XCS249	17/03/2026	Active	-	usd/mxn	52,700,519	2,938,008	-
M00961098	17/03/2026	Active	93,677,664	mxn	93,677,664	-	-
M00961099	17/03/2026	Active	1,756,579	mxn	1,756,579	-	-
M00961100	17/03/2026	Active	17,273,100	mxn	-	17,273,100	-
M00961101	17/03/2026	Active	76,476,547	mxn	76,476,547	-	-
M00961102	17/03/2026	Active	154,637,690	mxn	154,637,690	-	-
M00960208	12/03/2026	Active	17,269,742	mxn	-	17,269,742	-
M00960209	12/03/2026	Active	1,756,238	mxn	1,756,238	-	-
M00960210	12/03/2026	Active	76,341,321	mxn	76,341,321	-	-
M00960211	12/03/2026	Active	148,514,500	mxn	148,514,500	-	-
M00958486	12/03/2026	Active	146,054,459	mxn	146,054,459	-	-
XCR773	12/03/2026	Active	-	usd/mxn	53,270,183	3,013,616	-
XCR510	11/03/2026	Active	-	usd/mxn	51,810,693	2,948,606	-
M00956535	11/03/2026	Active	90,901,825	mxn	90,901,825	-	-
M00956539	11/03/2026	Active	152,248,576	mxn	152,248,576	-	-
M00955191	10/03/2026	Active	16,675,207	mxn	-	16,675,207	-
M00955192	10/03/2026	Active	74,003,917	mxn	74,003,917	-	-
M00955193	10/03/2026	Active	3,776,635	mxn	3,776,635	-	-
M00955194	10/03/2026	Active	94,526,770	mxn	94,526,770	-	-
M00955195	10/03/2026	Active	155,632,115	mxn	155,632,115	-	-
XCR242	10/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,849,686	2,799,439	-
M00953234	09/03/2026	Active	110,975,055	mxn	-	110,975,055	-
M00953235	09/03/2026	Active	16,887,091	mxn	-	16,887,091	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00953236	09/03/2026	Active	75,323,548	mxn	75,323,548	-	-
M00953237	09/03/2026	Active	3,016,951	mxn	3,016,951	-	-
M00953238	09/03/2026	Active	49,521,647	mxn	-	49,521,647	-
XCQ902	09/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,086,715	2,758,037	-
XCQ637	06/03/2026	Active	-	usd/mxn	49,455,154	2,782,068	-
M00951554	05/03/2026	Active	100	mxn	100	-	-
M00951555	05/03/2026	Active	100	mxn	-	100	-
M00951552	05/03/2026	Active	100	mxn	-	100	-
M00951553	05/03/2026	Active	100	mxn	100	-	-
M00951479	06/03/2026	Active	106,547,701	mxn	-	106,547,701	-
XCQ385	05/03/2026	Active	-	usd/mxn	50,273,091	2,861,026	-
M00950318	05/03/2026	Active	101,548,185	mxn	-	101,548,185	-
M00950326	05/03/2026	Active	15,086,756	mxn	-	15,086,756	-
M00950328	05/03/2026	Active	9,205,845	mxn	9,205,845	-	-
M00950329	05/03/2026	Active	40,249,690	mxn	-	40,249,690	-
M00950333	05/03/2026	Active	67,179,405	mxn	67,179,405	-	-
M00948777	04/03/2026	Active	66,545,207	mxn	66,545,207	-	-
M00948778	04/03/2026	Active	105,225,265	mxn	-	105,225,265	-
M00948779	04/03/2026	Active	7,688,501	mxn	7,688,501	-	-
M00948780	04/03/2026	Active	15,527,206	mxn	-	15,527,206	-
M00948781	04/03/2026	Active	46,518,762	mxn	-	46,518,762	-
XCQ061	04/03/2026	Active	-	usd/mxn	52,034,106	2,949,495	-
XCP787	03/03/2026	Active	-	usd/mxn	58,427,511	3,375,040	-
M00946807	03/03/2026	Active	12,346,609	mxn	-	12,346,609	-
M00946808	03/03/2026	Active	52,876,908	mxn	52,876,908	-	-
M00946809	03/03/2026	Active	314,422,048	mxn	-	314,422,048	-
M00946810	03/03/2026	Active	18,754,777	mxn	18,754,777	-	-
M00946811	03/03/2026	Active	255,136,972	mxn	-	255,136,972	-
XCP757	03/03/2026	Active	-	usd/mxn	437,361,568	25,264,148	-
XCP755	03/03/2026	Active	-	usd/mxn	127,952,325	7,391,154	-
XCP741	03/03/2026	Active	-	mxn/usd	33,228,375	575,234,671	-
M00945766	02/03/2026	Active	53,541,849	mxn	53,541,849	-	-
M00945767	02/03/2026	Active	307,226,685	mxn	-	307,226,685	-
M00945768	02/03/2026	Active	20,027,155	mxn	20,027,155	-	-
M00945769	02/03/2026	Active	12,339,411	mxn	-	12,339,411	-
M00945770	02/03/2026	Active	245,997,092	mxn	-	245,997,092	-
XCP443	02/03/2026	Active	-	usd/mxn	435,803,706	25,330,356	-
XCP441	02/03/2026	Active	-	usd/mxn	127,163,320	7,391,154	-
XCP439	02/03/2026	Active	-	mxn/usd	33,383,570	574,357,638	-
XCP415	02/03/2026	Active	-	usd/mxn	58,031,896	3,370,802	-
XCP199	27/02/2026	Active	-	usd/mxn	57,212,269	3,326,933	-
M00943004	27/02/2026	Active	249,482,205	mxn	-	249,482,205	-
M00943008	27/02/2026	Active	188,260,463	mxn	-	188,260,463	-
M00941416	26/02/2026	Active	18,503,736	mxn	18,503,736	-	-
M00941417	26/02/2026	Active	253,684,291	mxn	-	253,684,291	-
M00941418	26/02/2026	Active	55,326,711	mxn	55,326,711	-	-
M00941419	26/02/2026	Active	12,780,395	mxn	-	12,780,395	-
M00941420	26/02/2026	Active	192,634,239	mxn	-	192,634,239	-
XCO942	26/02/2026	Active	-	usd/mxn	57,924,866	3,377,622	-
M00938671	25/02/2026	Active	177,657,000	mxn	-	177,657,000	-
M00938672	25/02/2026	Active	238,938,928	mxn	-	238,938,928	-
XCO746	25/02/2026	Active	-	usd/mxn	54,277,068	3,160,858	-
M00935502	24/02/2026	Active	246,141,542	mxn	-	246,141,542	-
M00935503	24/02/2026	Active	184,717,456	mxn	-	184,717,456	-
XCO534	24/02/2026	Active	-	usd/mxn	56,558,047	3,274,608	-
M00935333	23/03/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
M00933633	23/02/2026	Active	242,394,814	mxn	-	242,394,814	-
M00933634	23/02/2026	Active	11,495,820	mxn	-	11,495,820	-
M00933635	23/02/2026	Active	51,213,981	mxn	51,213,981	-	-
M00933636	23/02/2026	Active	21,611,210	mxn	21,611,210	-	-
M00933637	23/02/2026	Active	181,065,444	mxn	-	181,065,444	-
XCO316	23/02/2026	Active	-	usd/mxn	55,277,488	3,226,978	-
M00932033	20/02/2026	Active	251,842,922	mxn	-	251,842,922	-
M00932035	20/02/2026	Active	190,629,632	mxn	-	190,629,632	-
XCO069	20/02/2026	Active	-	usd/mxn	55,111,486	3,196,416	-
M00930260	19/02/2026	Active	49,998,089	mxn	49,998,089	-	-
M00930261	19/02/2026	Active	22,132,264	mxn	22,132,264	-	-
M00930262	19/02/2026	Active	252,924,543	mxn	-	252,924,543	-
M00930263	19/02/2026	Active	11,356,502	mxn	-	11,356,502	-
M00930264	19/02/2026	Active	192,150,693	mxn	-	192,150,693	-
XCN843	19/02/2026	Active	-	usd/mxn	49,722,157	2,888,858	-
M00929611	17/02/2026	Active	102,633,706	mxn	-	102,633,706	-
M00929612	17/02/2026	Active	11,347,988	mxn	-	11,347,988	-
M00929613	17/02/2026	Active	50,242,360	mxn	50,242,360	-	-
M00929614	17/02/2026	Active	21,832,247	mxn	21,832,247	-	-
M00929615	17/02/2026	Active	41,907,087	mxn	-	41,907,087	-
XCN591	18/02/2026	Active	-	usd/mxn	47,638,922	2,782,371	-
M00927718	17/02/2026	Active	21,290,170	mxn	21,290,170	-	-
M00927719	17/02/2026	Active	234,984,944	mxn	-	234,984,944	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00927720	17/02/2026	Active	51,126,648	mxn	51,126,648	-	-
M00927721	17/02/2026	Active	11,476,012	mxn	-	11,476,012	-
M00927722	17/02/2026	Active	174,044,137	mxn	-	174,044,137	-
XCN372	17/02/2026	Active	-	usd/mxn	49,330,724	2,876,880	-
XCN167	13/02/2026	Active	-	usd/mxn	50,453,166	2,924,533	-
XCN158	13/02/2026	Active	-	usd/mxn	452,372,229	26,267,876	-
XCN156	13/02/2026	Active	-	usd/mxn	118,062,346	6,855,520	-
XCN154	13/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,804,168	582,158,478	-
M00925194	13/02/2026	Active	233,276,586	mxn	-	233,276,586	-
M00925195	13/02/2026	Active	53,024,388	mxn	53,024,388	-	-
M00925196	13/02/2026	Active	11,885,032	mxn	-	11,885,032	-
M00925197	13/02/2026	Active	19,710,265	mxn	19,710,265	-	-
M00925198	13/02/2026	Active	172,426,966	mxn	-	172,426,966	-
M00923734	12/02/2026	Active	19,443,805	mxn	19,443,805	-	-
M00923735	12/02/2026	Active	11,951,263	mxn	-	11,951,263	-
M00923736	12/02/2026	Active	237,695,650	mxn	-	237,695,650	-
M00923737	12/02/2026	Active	53,347,784	mxn	53,347,784	-	-
M00923738	12/02/2026	Active	176,855,324	mxn	-	176,855,324	-
XCM883	12/02/2026	Active	-	usd/mxn	52,170,818	3,035,552	-
M00922089	11/02/2026	Active	237,641,418	mxn	-	237,641,418	-
M00922090	11/02/2026	Active	11,948,940	mxn	-	11,948,940	-
M00922091	11/02/2026	Active	53,882,689	mxn	53,882,689	-	-
M00922092	11/02/2026	Active	19,440,025	mxn	19,440,025	-	-
M00922093	11/02/2026	Active	176,267,643	mxn	-	176,267,643	-
XCM655	11/02/2026	Active	-	usd/mxn	51,653,040	3,004,586	-
M00921378	10/02/2026	Active	236,581,651	mxn	-	236,581,651	-
M00921379	10/02/2026	Active	14,446,320	mxn	14,446,320	-	-
M00921380	10/02/2026	Active	60,086,899	mxn	60,086,899	-	-
M00921381	10/02/2026	Active	13,248,913	mxn	-	13,248,913	-
M00921382	10/02/2026	Active	175,297,345	mxn	-	175,297,345	-
XCM433	10/02/2026	Active	-	usd/mxn	451,446,286	26,267,876	-
XCM429	10/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,804,168	580,966,881	-
XCM431	10/02/2026	Active	-	usd/mxn	117,820,689	6,855,520	-
XCM389	10/02/2026	Active	-	usd/mxn	53,170,628	3,092,862	-
M00919493	09/02/2026	Active	208,847,174	mxn	-	208,847,174	-
M00919495	09/02/2026	Active	147,852,509	mxn	-	147,852,509	-
XCM219	09/02/2026	Active	-	usd/mxn	452,942,242	26,267,876	-
XCM217	09/02/2026	Active	-	usd/mxn	52,095,959	3,021,194	-
XCM215	09/02/2026	Active	-	usd/mxn	118,211,110	6,855,520	-
XCM213	09/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,804,308	582,894,445	-
M00918111	06/02/2026	Active	13,246,337	mxn	-	13,246,337	-
M00918112	06/02/2026	Active	59,823,844	mxn	59,823,844	-	-
M00918113	06/02/2026	Active	374,159,954	mxn	-	374,159,954	-
M00918114	06/02/2026	Active	14,443,511	mxn	14,443,511	-	-
M00918115	06/02/2026	Active	313,138,936	mxn	-	313,138,936	-
XCL979	06/02/2026	Active	-	usd/mxn	456,567,209	26,267,876	-
XCL975	06/02/2026	Active	-	usd/mxn	119,157,172	6,855,520	-
XCL970	06/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,804,308	587,559,439	-
XCL953	06/02/2026	Active	-	usd/mxn	52,443,890	3,017,242	-
XCL711	05/02/2026	Active	-	usd/mxn	53,288,291	3,076,407	-
M00915608	04/02/2026	Active	58,662,616	mxn	58,662,616	-	-
M00915609	04/02/2026	Active	15,325,744	mxn	15,325,744	-	-
M00915610	04/02/2026	Active	362,089,452	mxn	-	362,089,452	-
M00915611	04/02/2026	Active	12,998,550	mxn	-	12,998,550	-
M00915612	04/02/2026	Active	301,099,642	mxn	-	301,099,642	-
XCL698	05/02/2026	Active	-	usd/mxn	454,205,727	26,267,876	-
XCL693	05/02/2026	Active	-	usd/mxn	118,540,861	6,855,520	-
XCL691	05/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,804,308	584,520,432	-
XCL469	04/02/2026	Active	-	usd/mxn	452,892,333	26,267,876	-
M00914689	04/02/2026	Active	366,297,286	mxn	-	366,297,286	-
M00914690	04/02/2026	Active	19,733,316	mxn	19,733,316	-	-
M00914691	04/02/2026	Active	53,278,965	mxn	53,278,965	-	-
M00914692	04/02/2026	Active	11,899,353	mxn	-	11,899,353	-
M00914693	04/02/2026	Active	305,184,358	mxn	-	305,184,358	-
XCL467	04/02/2026	Active	-	usd/mxn	118,198,085	6,855,520	-
XCL465	04/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,824,543	583,179,092	-
XCL449	04/02/2026	Active	-	usd/mxn	52,255,602	3,032,545	-
M00910981	03/02/2026	Active	335,805,053	mxn	-	335,805,053	-
M00910984	03/02/2026	Active	274,214,569	mxn	-	274,214,569	-
XCL003	03/02/2026	Active	-	usd/mxn	458,328,650	26,331,647	-
XCL001	03/02/2026	Active	-	usd/mxn	119,327,189	6,855,520	-
XCK998	03/02/2026	Active	-	mxn/usd	33,888,245	589,858,800	-
XCK990	03/02/2026	Active	-	usd/mxn	53,089,199	3,049,911	-
XCK736	30/01/2026	Active	-	usd/mxn	453,465,195	26,331,647	-
XCK732	30/01/2026	Active	-	usd/mxn	118,052,062	6,855,003	-
XCK727	30/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,888,245	583,599,641	-
M00910062	30/01/2026	Active	51,801,054	mxn	51,801,054	-	-
M00910063	30/01/2026	Active	21,487,073	mxn	21,487,073	-	-
M00910064	30/01/2026	Active	11,759,956	mxn	-	11,759,956	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00910065	30/01/2026	Active	321,252,424	mxn	-	321,252,424	-
M00910066	30/01/2026	Active	259,724,252	mxn	-	259,724,252	-
XCK698	30/01/2026	Active	-	usd/mxn	51,910,000	3,011,615	-
M00907704	29/01/2026	Active	51,235,574	mxn	51,235,574	-	-
M00907705	29/01/2026	Active	11,689,128	mxn	-	11,689,128	-
M00907706	29/01/2026	Active	327,902,033	mxn	-	327,902,033	-
M00907707	29/01/2026	Active	21,746,161	mxn	21,746,161	-	-
M00907708	29/01/2026	Active	266,609,425	mxn	-	266,609,425	-
XCK426	29/01/2026	Active	-	usd/mxn	453,207,145	26,331,647	-
XCK424	29/01/2026	Active	-	usd/mxn	117,993,790	6,855,520	-
XCK422	29/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,886,791	583,242,495	-
XCK418	29/01/2026	Active	-	usd/mxn	52,788,967	3,060,833	-
M00904415	28/01/2026	Active	11,277,227	mxn	-	11,277,227	-
M00904412	28/01/2026	Active	22,172,331	mxn	22,172,331	-	-
M00904413	28/01/2026	Active	50,612,374	mxn	50,612,374	-	-
M00904414	28/01/2026	Active	266,194,122	mxn	-	266,194,122	-
XCK116	28/01/2026	Active	-	usd/mxn	453,655,559	26,342,395	-
XCK112	28/01/2026	Active	-	usd/mxn	118,436,887	6,877,269	-
XCK106	28/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,919,287	584,141,003	-
XCK098	28/01/2026	Active	-	usd/mxn	51,785,029	3,012,194	-
XCJ790	27/01/2026	Active	-	usd/mxn	457,609,553	26,342,395	-
XCJ788	27/01/2026	Active	-	usd/mxn	119,469,165	6,877,269	-
XCJ784	27/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,929,206	589,404,602	-
M00901786	27/01/2026	Active	342,476,041	mxn	-	342,476,041	-
M00901787	27/01/2026	Active	19,534,293	mxn	19,534,293	-	-
M00901788	27/01/2026	Active	280,596,874	mxn	-	280,596,874	-
M00901789	27/01/2026	Active	11,962,628	mxn	-	11,962,628	-
M00901790	27/01/2026	Active	54,307,503	mxn	54,307,503	-	-
XCJ769	27/01/2026	Active	-	usd/mxn	51,169,002	2,947,201	-
XCJ513	26/01/2026	Active	-	usd/mxn	58,222,781	3,351,916	-
M00899838	26/01/2026	Active	339,953,939	mxn	-	339,953,939	-
M00899844	26/01/2026	Active	277,781,094	mxn	-	277,781,094	-
M00898077	23/01/2026	Active	339,425,391	mxn	-	339,425,391	-
M00898078	23/01/2026	Active	276,985,078	mxn	-	276,985,078	-
XCJ278	23/01/2026	Active	-	usd/mxn	460,320,185	26,342,395	-
XCJ276	23/01/2026	Active	-	usd/mxn	120,176,836	6,877,269	-
XCJ274	23/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,963,896	593,502,099	-
XCJ261	23/01/2026	Active	-	usd/mxn	52,775,408	3,019,706	-
XCI999	22/01/2026	Active	-	usd/mxn	460,507,216	26,342,395	-
XCI996	22/01/2026	Active	-	usd/mxn	120,225,665	6,877,269	-
XCI994	22/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,965,125	593,764,723	-
XCI989	22/01/2026	Active	-	usd/mxn	49,859,819	2,852,115	-
M00896438	22/01/2026	Active	60,235,250	mxn	60,235,250	-	-
M00896439	22/01/2026	Active	14,789,786	mxn	14,789,786	-	-
M00896440	22/01/2026	Active	13,197,970	mxn	-	13,197,970	-
M00896441	22/01/2026	Active	433,805,284	mxn	-	433,805,284	-
M00896442	22/01/2026	Active	495,632,349	mxn	-	495,632,349	-
XCI784	21/01/2026	Active	-	usd/mxn	50,959,583	2,894,477	-
XCI732	21/01/2026	Active	-	usd/mxn	37,916,900	2,154,210	-
XCI730	21/01/2026	Active	-	usd/mxn	463,660,401	26,342,395	-
XCI728	21/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,959,931	597,738,940	-
M00894779	21/01/2026	Active	3,188,272	mxn	3,188,272	-	-
M00894780	21/01/2026	Active	195,709,480	mxn	-	195,709,480	-
M00894781	21/01/2026	Active	75,007,150	mxn	75,007,150	-	-
M00894782	21/01/2026	Active	133,666,942	mxn	-	133,666,942	-
M00894783	21/01/2026	Active	16,152,884	mxn	-	16,152,884	-
M00894043	20/01/2026	Active	16,149,588	mxn	-	16,149,588	-
M00894044	20/01/2026	Active	3,187,496	mxn	3,187,496	-	-
M00894045	20/01/2026	Active	193,594,508	mxn	-	193,594,508	-
M00894046	20/01/2026	Active	75,232,665	mxn	75,232,665	-	-
M00894047	20/01/2026	Active	131,323,935	mxn	-	131,323,935	-
M00893194	19/01/2026	Active	66,020,480	mxn	66,020,480	-	-
M00893195	19/01/2026	Active	10,293,938	mxn	10,293,938	-	-
M00893196	19/01/2026	Active	327,883,391	mxn	-	327,883,391	-
M00893197	19/01/2026	Active	14,284,393	mxn	-	14,284,393	-
M00893198	19/01/2026	Active	265,853,365	mxn	-	265,853,365	-
XCI446	20/01/2026	Active	-	usd/mxn	464,837,906	26,342,395	-
XCI444	20/01/2026	Active	-	usd/mxn	121,356,288	6,877,269	-
XCI442	20/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	599,258,769	-
XCI438	20/01/2026	Active	-	usd/mxn	50,134,466	2,840,190	-
XCI294	16/01/2026	Active	-	usd/mxn	464,714,097	26,342,395	-
XCI292	16/01/2026	Active	-	usd/mxn	121,323,965	6,877,269	-
XCI290	16/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	599,099,157	-
M00890737	16/01/2026	Active	332,394,666	mxn	-	332,394,666	-
M00890738	16/01/2026	Active	14,281,616	mxn	-	14,281,616	-
M00890739	16/01/2026	Active	65,901,346	mxn	65,901,346	-	-
M00890740	16/01/2026	Active	10,291,937	mxn	10,291,937	-	-
M00890741	16/01/2026	Active	270,482,999	mxn	-	270,482,999	-
XCI283	16/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,142,280	3,010,587	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
XCI050	15/01/2026	Active	-	usd/mxn	469,187,036	26,342,380	-
M00889157	15/01/2026	Active	71,660,618	mxn	71,660,618	-	-
M00889158	15/01/2026	Active	5,812,599	mxn	5,812,599	-	-
M00889159	15/01/2026	Active	333,106,705	mxn	-	333,106,705	-
M00889160	15/01/2026	Active	15,447,748	mxn	-	15,447,748	-
M00889161	15/01/2026	Active	271,081,235	mxn	-	271,081,235	-
XCI048	15/01/2026	Active	-	usd/mxn	122,491,725	6,877,269	-
XCI046	15/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	604,865,571	-
XCI032	15/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,576,316	3,007,101	-
XCH849	14/01/2026	Active	-	usd/mxn	470,375,078	26,342,395	-
XCH846	14/01/2026	Active	-	usd/mxn	122,801,890	6,877,269	-
XCH844	14/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	606,397,169	-
M00887415	14/01/2026	Active	16,132,338	mxn	-	16,132,338	-
M00887416	14/01/2026	Active	332,212,336	mxn	-	332,212,336	-
M00887417	14/01/2026	Active	3,177,742	mxn	3,177,742	-	-
M00887418	14/01/2026	Active	75,541,770	mxn	75,541,770	-	-
M00887419	14/01/2026	Active	269,625,162	mxn	-	269,625,162	-
XCH825	14/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,203,396	2,980,357	-
XCH619	13/01/2026	Active	-	usd/mxn	471,818,641	26,342,395	-
XCH617	13/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,178,764	6,877,269	-
XCH615	13/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	608,258,178	-
M00886953	13/01/2026	Active	269,336,768	mxn	-	269,336,768	-
M00886949	13/01/2026	Active	75,298,675	mxn	75,298,675	-	-
M00886950	13/01/2026	Active	16,119,484	mxn	-	16,119,484	-
M00886951	13/01/2026	Active	3,176,485	mxn	3,176,485	-	-
M00886952	13/01/2026	Active	331,692,445	mxn	-	331,692,445	-
XCH596	13/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,524,767	2,990,010	-
M00885156	12/01/2026	Active	1,095,436	mxn	1,095,436	-	-
M00885157	12/01/2026	Active	16,662,788	mxn	-	16,662,788	-
M00885158	12/01/2026	Active	562,789,366	mxn	-	562,789,366	-
M00885159	12/01/2026	Active	77,681,436	mxn	77,681,436	-	-
M00885160	12/01/2026	Active	500,675,282	mxn	-	500,675,282	-
XCH432	12/01/2026	Active	-	usd/mxn	473,965,546	26,342,395	-
XCH424	12/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,739,261	6,877,269	-
XCH422	12/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,960,035	611,025,921	-
XCH419	12/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,782,249	2,990,561	-
M00883421	09/01/2026	Active	16,513,150	mxn	-	16,513,150	-
M00883422	09/01/2026	Active	77,004,954	mxn	77,004,954	-	-
M00883423	09/01/2026	Active	1,372,243	mxn	1,372,243	-	-
M00883424	09/01/2026	Active	530,406,161	mxn	-	530,406,161	-
M00883425	09/01/2026	Active	468,542,114	mxn	-	468,542,114	-
XCH200	09/01/2026	Active	-	usd/mxn	473,601,130	26,342,053	-
XCH198	09/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,643,145	6,877,125	-
XCH196	09/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,959,647	610,557,102	-
XCH194	09/01/2026	Active	-	usd/mxn	55,216,035	3,069,365	-
XCH006	08/01/2026	Active	-	usd/mxn	472,339,345	26,342,053	-
XCH004	08/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,313,731	6,877,125	-
XCH002	08/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,959,647	608,930,435	-
M00880746	08/01/2026	Active	526,357,287	mxn	-	526,357,287	-
M00880747	08/01/2026	Active	15,960,244	mxn	-	15,960,244	-
M00880748	08/01/2026	Active	74,344,398	mxn	74,344,398	-	-
M00880749	08/01/2026	Active	464,532,889	mxn	-	464,532,889	-
M00880750	08/01/2026	Active	3,440,244	mxn	3,440,244	-	-
XCG933	08/01/2026	Active	-	usd/mxn	55,406,710	3,085,659	-
XCG795	07/01/2026	Active	-	usd/mxn	473,387,759	26,342,053	-
M00879159	07/01/2026	Active	75,672,979	mxn	75,672,979	-	-
M00879160	07/01/2026	Active	16,235,329	mxn	-	16,235,329	-
M00879161	07/01/2026	Active	530,741,289	mxn	-	530,741,289	-
M00879162	07/01/2026	Active	2,386,562	mxn	2,386,562	-	-
M00879163	07/01/2026	Active	468,917,078	mxn	-	468,917,078	-
XCG793	07/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,587,440	6,877,125	-
XCG791	07/01/2026	Active	-	mxn/usd	33,959,647	610,282,029	-
XCG762	07/01/2026	Active	-	usd/mxn	55,475,501	3,088,630	-
M00878128	06/01/2026	Active	507,434,413	mxn	-	507,434,413	-
XCG574	06/01/2026	Active	-	usd/mxn	472,544,798	26,412,726	-
XCG572	06/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,037,270	6,877,125	-
XCG570	06/01/2026	Active	-	mxn/usd	34,030,321	608,829,659	-
XCG568	06/01/2026	Active	-	usd/mxn	54,990,440	3,071,920	-
XCG494	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	53,094,669	2,948,066	-
XCG372	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	472,544,798	26,412,726	-
XCG370	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,037,270	6,877,125	-
XCG368	05/01/2026	Active	-	mxn/usd	34,030,321	608,829,659	-
M00876825	05/01/2026	Active	71,865,405	mxn	71,865,405	-	-
M00876826	05/01/2026	Active	504,229,453	mxn	-	504,229,453	-
M00876827	05/01/2026	Active	15,685,159	mxn	-	15,685,159	-
M00876828	05/01/2026	Active	5,978,003	mxn	5,978,003	-	-
M00876829	05/01/2026	Active	442,071,204	mxn	-	442,071,204	-
XCG356	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	54,766,278	3,062,734	-
SQY986	02/03/2026	Active	2,500,000,000	mxn	2,500,000,000	2,500,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
XCG210	02/01/2026	Active	-	mxn/usd	34,030,321	612,852,043	-
XCG208	02/01/2026	Active	-	usd/mxn	475,666,782	26,412,726	-
XCG204	02/01/2026	Active	-	usd/mxn	123,850,146	6,877,125	-
M00875277	02/01/2026	Active	2,808,476	mxn	2,808,476	-	-
M00875278	02/01/2026	Active	651,038,186	mxn	-	651,038,186	-
M00875279	02/01/2026	Active	16,510,414	mxn	-	16,510,414	-
M00875280	02/01/2026	Active	75,767,364	mxn	75,767,364	-	-
M00875281	02/01/2026	Active	588,972,760	mxn	-	588,972,760	-
SQY972	02/03/2026	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	-
XCG044	02/01/2026	Active	-	usd/mxn	474,049,043	26,423,844	-
SQY675	27/03/2026	Active	1,556,000,000	mxn	1,556,000,000	1,556,000,000	-
SQY529	25/03/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SQY484	25/03/2026	Active	2,335,000,000	mxn	2,335,000,000	2,335,000,000	-
M00867602	27/02/2026	Active	1,600,000	usd	-	1,600,000	-
M00867113	20/02/2026	Active	21,000,000	mxn	-	21,000,000	-
SQW801	12/03/2026	Active	2,000,000,000	mxn	2,000,000,000	2,000,000,000	-
SQW785	12/03/2026	Active	4,670,000,000	mxn	4,670,000,000	4,670,000,000	-
SQW786	12/02/2026	Active	6,985,000,000	mxn	6,985,000,000	6,985,000,000	-
M00859021	13/03/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	-	-
M00858934	13/03/2026	Active	20,000,000	mxn	-	20,000,000	-
XCD424	05/01/2026	Active	-	mxn/usd	26,000,000	476,023,955	-
XCD426	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	476,023,955	26,000,000	-
M00855373	31/03/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00854527	31/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SQV463	09/03/2026	Active	787,500,000	mxn	787,500,000	787,500,000	-
SQV465	09/03/2026	Active	787,500,000	mxn	787,500,000	787,500,000	-
SQV446	09/02/2026	Active	11,810,000,000	mxn	11,810,000,000	11,810,000,000	-
SQV447	12/01/2026	Active	23,550,000,000	mxn	23,550,000,000	23,550,000,000	-
SQV131	05/03/2026	Active	8,000,000,000	mxn	8,000,000,000	8,000,000,000	-
M00852143	12/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851327	09/01/2026	Active	5,500,000	usd	-	5,500,000	-
M00851301	22/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851300	19/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851299	18/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851298	17/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851297	13/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851291	11/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851290	10/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00851288	09/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SQV035	05/03/2026	Active	8,000,000,000	mxn	8,000,000,000	8,000,000,000	-
SQV020	05/03/2026	Active	7,930,000,000	mxn	7,930,000,000	7,930,000,000	-
M00851228	06/02/2026	Active	500,000	usd	-	500,000	-
XCC936	05/01/2026	Active	-	mxn/usd	26,000,000	476,023,955	-
XCC938	05/01/2026	Active	-	usd/mxn	476,023,955	26,000,000	-
M00849943	06/03/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
M00849189	06/03/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
SQU140	06/02/2026	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
M00846818	06/02/2026	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	-	-
M00846804	06/02/2026	Active	40,000,000	mxn	-	40,000,000	-
SQT783	23/03/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00845398	23/03/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
SQT761	27/02/2026	Active	3,965,000,000	mxn	3,965,000,000	3,965,000,000	-
M00845278	23/03/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00843517	27/02/2026	Active	10,000,000	mxn	-	10,000,000	-
M00842400	30/01/2026	Active	14,000,000	mxn	-	14,000,000	-
SQS545	26/03/2026	Active	2,800,000	mxn	2,800,000	2,800,000	-
M00839397	26/03/2026	Active	2,800,000	mxn	2,800,000	-	-
M00837852	26/03/2026	Active	2,800,000	mxn	-	2,800,000	-
M00837050	23/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
SQR188	19/02/2026	Active	2,390,000,000	mxn	2,390,000,000	2,390,000,000	-
SQR138	19/02/2026	Active	2,390,000,000	mxn	2,390,000,000	2,390,000,000	-
SQR050	19/02/2026	Active	5,985,000,000	mxn	5,985,000,000	5,985,000,000	-
M00836057	23/02/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00832683	23/01/2026	Active	10,000,000	mxn	-	10,000,000	-
SQQ593	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	-
M00831964	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	-	-
SQQ549	17/02/2026	Active	5,680,000,000	mxn	5,680,000,000	5,680,000,000	-
SQQ530	17/02/2026	Active	8,000,000,000	mxn	8,000,000,000	8,000,000,000	-
SQQ531	17/02/2026	Active	4,100,000,000	mxn	4,100,000,000	4,100,000,000	-
M00831056	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
SQQ382	17/03/2026	Active	10,000,000,000	mxn	10,000,000,000	10,000,000,000	-
M00829378	18/02/2026	Active	7,330,362	mxn	7,330,362	-	-
M00829343	18/02/2026	Active	7,330,362	mxn	-	7,330,362	-
SQO378	18/03/2026	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	-
M00827097	18/03/2026	Active	2,500,000	usd	2,500,000	-	-
SQO366	12/02/2026	Active	1,595,000,000	mxn	1,595,000,000	1,595,000,000	-
M00826277	18/03/2026	Active	2,500,000	usd	-	2,500,000	-
M00821539	13/03/2026	Active	4,000,000	usd	-	4,000,000	-
M00820410	09/02/2026	Active	8,000,000	mxn	8,000,000	-	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00820353	09/02/2026	Active	8,000,000	mxn	-	8,000,000	-
SQN156	12/03/2026	Active	16,000,000	mxn	16,000,000	16,000,000	-
M00819648	12/03/2026	Active	16,000,000	mxn	16,000,000	-	-
M00819627	11/03/2026	Active	4,500,000	usd	4,500,000	-	-
M00819613	12/03/2026	Active	16,000,000	mxn	-	16,000,000	-
M00819602	11/03/2026	Active	4,500,000	usd	-	4,500,000	-
M00818718	06/02/2026	Active	7,340,600	mxn	7,340,600	-	-
SQN050	04/02/2026	Active	5,980,000,000	mxn	5,980,000,000	5,980,000,000	-
SQN031	04/02/2026	Active	1,995,000,000	mxn	1,995,000,000	1,995,000,000	-
M00818561	06/02/2026	Active	7,340,600	mxn	-	7,340,600	-
M00816652	05/03/2026	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	-	-
M00816152	05/03/2026	Active	3,000,000	mxn	-	3,000,000	-
M00816105	06/03/2026	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	-	-
M00815331	06/03/2026	Active	3,000,000	mxn	-	3,000,000	-
SQK811	28/01/2026	Active	800,000,000	mxn	800,000,000	800,000,000	-
SQK651	27/01/2026	Active	16,125,000,000	mxn	16,125,000,000	16,125,000,000	-
M00806612	30/01/2026	Active	6,650,000	mxn	6,650,000	-	-
M00806607	27/01/2026	Active	7,340,600	mxn	7,340,600	-	-
SQK088	23/01/2026	Active	2,400,000,000	mxn	2,400,000,000	2,400,000,000	-
SQK055	23/01/2026	Active	1,700,000,000	mxn	1,700,000,000	1,700,000,000	-
M00805853	27/01/2026	Active	7,340,600	mxn	-	7,340,600	-
M00805831	30/01/2026	Active	6,650,000	mxn	-	6,650,000	-
M00803768	28/01/2026	Active	2,800,000	mxn	2,800,000	-	-
M00801878	28/01/2026	Active	2,800,000	mxn	-	2,800,000	-
SQI548	16/01/2026	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	-
SQI521	13/02/2026	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	-
SQI330	18/02/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
M00794854	18/02/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
SQI325	18/02/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
M00793988	18/02/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
M00792795	17/02/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
SQH588	12/02/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	-
SQH527	13/02/2026	Active	6,000,000	mxn	6,000,000	6,000,000	-
M00789334	13/02/2026	Active	6,000,000	mxn	6,000,000	-	-
M00789326	12/02/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	-	-
M00789098	13/02/2026	Active	6,000,000	mxn	-	6,000,000	-
M00787697	12/02/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
M00787333	12/01/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
M00786466	12/01/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
SQG557	06/01/2026	Active	17,690,000,000	mxn	17,690,000,000	17,690,000,000	-
SQG558	31/03/2026	Active	8,925,000,000	mxn	8,925,000,000	8,925,000,000	-
SQG512	31/03/2026	Active	3,240,000,000	mxn	3,240,000,000	3,240,000,000	-
SQG291	30/03/2026	Active	8,050,000,000	mxn	8,050,000,000	8,050,000,000	-
SQG259	04/02/2026	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	-
M00783174	04/02/2026	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	-	-
SQG220	02/02/2026	Active	10,000,000,000	mxn	10,000,000,000	10,000,000,000	-
M00781143	04/02/2026	Active	4,000,000	mxn	-	4,000,000	-
M00780155	09/01/2026	Active	4,550,000	mxn	4,550,000	-	-
SQF858	26/03/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SQF850	01/01/2026	Active	2,365,000,000	mxn	2,365,000,000	2,365,000,000	-
SQF851	26/03/2026	Active	1,205,000,000	mxn	1,205,000,000	1,205,000,000	-
M00779175	09/01/2026	Active	4,550,000	mxn	-	4,550,000	-
M00778923	02/01/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
M00778922	02/01/2026	Active	1,500,000	mxn	1,500,000	-	-
SQF646	03/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00778920	03/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00778906	02/01/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
M00778793	02/01/2026	Active	1,500,000	mxn	-	1,500,000	-
M00778752	03/02/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SQF400	30/01/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00777964	30/01/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00777226	30/01/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SQF327	24/03/2026	Active	3,225,000,000	mxn	3,225,000,000	3,225,000,000	-
SQF196	23/03/2026	Active	2,010,000,000	mxn	2,010,000,000	2,010,000,000	-
SQF182	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000	-
M00775671	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	-	-
SQF170	23/03/2026	Active	2,050,000,000	mxn	2,050,000,000	2,050,000,000	-
SQF137	31/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
M00775586	31/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	-	-
M00775584	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	-	2,500,000	-
M00775507	31/03/2026	Active	30,000,000	mxn	-	30,000,000	-
SQE896	16/03/2026	Active	1,000,000	usd	1,000,000	1,000,000	-
SQE890	20/03/2026	Active	2,010,000,000	mxn	2,010,000,000	2,010,000,000	-
SQE866	20/03/2026	Active	2,030,000,000	mxn	2,030,000,000	2,030,000,000	-
SQE855	20/03/2026	Active	2,010,000,000	mxn	2,010,000,000	2,010,000,000	-
SQE856	20/03/2026	Active	2,015,000,000	mxn	2,015,000,000	2,015,000,000	-
SQE609	24/02/2026	Active	250,000	usd	250,000	250,000	-
M00773567	24/02/2026	Active	250,000	usd	250,000	-	-
M00773452	24/02/2026	Active	250,000	usd	-	250,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SQE406	23/02/2026	Active	200,000	usd	200,000	200,000	-
M00773327	23/02/2026	Active	200,000	usd	200,000	-	-
SQE400	23/01/2026	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	-
M00773306	23/01/2026	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	-	-
M00772558	23/02/2026	Active	200,000	usd	-	200,000	-
M00772553	23/01/2026	Active	10,000,000	mxn	-	10,000,000	-
SQE325	23/03/2026	Active	1,300,000	usd	1,300,000	1,300,000	-
SQE188	17/03/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SQE165	23/01/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	-
M00770647	23/01/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	-	-
SQE144	17/03/2026	Active	1,210,000,000	mxn	1,210,000,000	1,210,000,000	-
M00770533	23/01/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
SQE092	22/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	-
M00770517	22/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	-	-
M00770516	16/03/2026	Active	1,000,000	usd	1,000,000	-	-
SQE088	19/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	337,500	-
M00770513	19/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	-	-
M00770512	22/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	20,000,000	-
M00770511	16/03/2026	Active	1,000,000	usd	-	1,000,000	-
M00770504	19/02/2026	Active	337,500	usd	-	337,500	-
SQD942	18/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00770223	18/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
SQD931	23/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00769467	23/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00769466	18/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
M00769465	23/03/2026	Active	1,300,000	usd	1,300,000	-	-
M00769458	23/03/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
M00769325	23/03/2026	Active	1,300,000	usd	-	1,300,000	-
SQD636	20/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	-
M00768662	20/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	-	-
SQD635	13/03/2026	Active	17,610,519	mxn	17,610,519	17,610,519	-
M00768661	13/03/2026	Active	17,610,519	mxn	17,610,519	-	-
SQD632	17/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	337,500	-
M00768654	17/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	-	-
SQD631	17/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	337,500	-
M00768653	17/02/2026	Active	337,500	usd	337,500	-	-
M00767908	20/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	20,000,000	-
M00767897	20/01/2026	Active	10,000,000	mxn	-	10,000,000	-
M00767876	13/03/2026	Active	17,610,519	mxn	-	17,610,519	-
M00767765	23/03/2026	Active	800,000	mxn	-	800,000	-
M00767282	17/02/2026	Active	337,500	usd	-	337,500	-
SQD317	17/02/2026	Active	280,000	usd	280,000	280,000	-
M00766252	17/02/2026	Active	280,000	usd	280,000	-	-
SQD293	23/03/2026	Active	1,200,000	mxn	1,200,000	1,200,000	-
M00766241	23/03/2026	Active	1,200,000	mxn	1,200,000	-	-
SQD288	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	-
M00766240	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	-	-
SQD282	18/03/2026	Active	209,000	usd	209,000	209,000	-
M00766239	18/03/2026	Active	209,000	usd	209,000	-	-
M00766237	17/02/2026	Active	280,000	usd	-	280,000	-
SQD273	12/03/2026	Active	2,820,000,000	mxn	2,820,000,000	2,820,000,000	-
SQD264	12/03/2026	Active	4,020,000,000	mxn	4,020,000,000	4,020,000,000	-
SQD251	12/03/2026	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	-
M00766132	23/03/2026	Active	1,200,000	mxn	-	1,200,000	-
M00766113	20/03/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
M00766092	18/03/2026	Active	209,000	usd	-	209,000	-
SQC868	09/03/2026	Active	2,743,000	mxn	2,743,000	2,743,000	-
M00764827	09/03/2026	Active	2,743,000	mxn	2,743,000	-	-
SQC867	12/02/2026	Active	200,000	usd	200,000	200,000	-
M00764826	12/02/2026	Active	200,000	usd	200,000	-	-
SQC866	20/01/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00764825	20/01/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00763953	09/03/2026	Active	2,743,000	mxn	-	2,743,000	-
M00763932	12/02/2026	Active	200,000	usd	-	200,000	-
M00763909	20/01/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SQC629	17/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
SQC623	16/01/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
M00762456	17/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00762455	16/01/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
SQC558	10/03/2026	Active	2,015,000,000	mxn	2,015,000,000	2,015,000,000	-
M00761715	17/03/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
M00761245	16/01/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
M00760417	04/03/2026	Active	21,323,260	mxn	21,323,260	-	-
SQC429	11/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00760410	11/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00759676	04/03/2026	Active	21,323,260	mxn	-	21,323,260	-
SQC356	17/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00759656	17/03/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00759400	11/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00759385	17/03/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
SQC150	06/03/2026	Active	2,405,000,000	mxn	2,405,000,000	2,405,000,000	-
SQC070	10/02/2026	Active	295,000	usd	295,000	295,000	-
M00757994	10/02/2026	Active	295,000	usd	295,000	-	-
SQC064	11/03/2026	Active	241,000	usd	241,000	241,000	-
M00757993	11/03/2026	Active	241,000	usd	241,000	-	-
M00757988	10/02/2026	Active	295,000	usd	-	295,000	-
M00757984	11/03/2026	Active	241,000	usd	-	241,000	-
SQB516	13/01/2026	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	-
M00755922	13/01/2026	Active	2,500,000	usd	2,500,000	-	-
SQB504	05/03/2026	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	-
SQB503	05/03/2026	Active	8,050,000,000	mxn	8,050,000,000	8,050,000,000	-
SQB499	05/03/2026	Active	4,000,000,000	mxn	4,000,000,000	4,000,000,000	-
M00755046	13/01/2026	Active	2,500,000	usd	-	2,500,000	-
SQB142	08/01/2026	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	4,000,000	-
M00753547	08/01/2026	Active	4,000,000	mxn	4,000,000	-	-
SQB141	10/03/2026	Active	300,000	usd	300,000	300,000	-
M00753546	10/03/2026	Active	300,000	usd	300,000	-	-
M00753351	08/01/2026	Active	4,000,000	mxn	-	4,000,000	-
M00753350	10/03/2026	Active	300,000	usd	-	300,000	-
SQA932	04/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	250,000	-
M00752036	04/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	-	-
SQA916	10/03/2026	Active	500,000	mxn	500,000	500,000	-
M00752024	10/03/2026	Active	500,000	mxn	500,000	-	-
M00752020	09/01/2026	Active	2,500,000	usd	-	2,500,000	-
M00751876	04/03/2026	Active	250,000	usd	-	250,000	-
M00751830	10/03/2026	Active	500,000	mxn	-	500,000	-
SQA587	09/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00750149	09/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00750137	09/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
SQA554	27/02/2026	Active	569,790,000	mxn	569,790,000	569,790,000	-
SQA555	27/02/2026	Active	569,790,000	mxn	569,790,000	569,790,000	-
M00748710	07/01/2026	Active	3,000,000	mxn	3,000,000	-	-
SQA357	03/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	250,000	-
M00748701	03/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	-	-
SQA334	26/02/2026	Active	1,840,000,000	mxn	1,840,000,000	1,840,000,000	-
M00748329	07/01/2026	Active	3,000,000	mxn	-	3,000,000	-
SQA324	26/02/2026	Active	1,020,000,000	mxn	1,020,000,000	1,020,000,000	-
M00748194	03/03/2026	Active	250,000	usd	-	250,000	-
M00746429	03/03/2026	Active	1,500,000	mxn	1,500,000	-	-
SPZ924	03/03/2026	Active	1,500,000	mxn	1,500,000	1,500,000	-
M00746428	04/03/2026	Active	1,000,000	mxn	1,000,000	-	-
M00746427	04/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
SPZ916	04/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
SPZ902	28/01/2026	Active	7,166,626	mxn	7,166,626	7,166,626	-
M00745693	04/03/2026	Active	1,000,000	mxn	-	1,000,000	-
M00745561	04/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
SPZ497	23/02/2026	Active	410,000,000	mxn	410,000,000	410,000,000	-
SPZ498	23/02/2026	Active	410,000,000	mxn	410,000,000	410,000,000	-
M00744045	03/03/2026	Active	1,500,000	mxn	-	1,500,000	-
SPZ469	02/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	250,000	-
M00744033	02/03/2026	Active	250,000	usd	250,000	-	-
M00743857	02/03/2026	Active	250,000	usd	-	250,000	-
SPZ047	23/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00741959	23/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00741027	23/02/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
SPY760	27/02/2026	Active	25,900,000	mxn	25,900,000	25,900,000	-
M00740284	27/02/2026	Active	25,900,000	mxn	25,900,000	-	-
M00740283	27/02/2026	Active	25,900,000	mxn	-	25,900,000	-
SPY318	28/02/2026	Active	1,500,000	mxn	1,500,000	1,500,000	-
M00738527	28/02/2026	Active	1,500,000	mxn	1,500,000	-	-
M00737763	28/02/2026	Active	1,500,000	mxn	-	1,500,000	-
SPY263	16/02/2026	Active	2,045,000,000	mxn	2,045,000,000	2,045,000,000	-
SPY238	16/02/2026	Active	4,090,000,000	mxn	4,090,000,000	4,090,000,000	-
SPY220	17/02/2026	Active	818,000,000	mxn	818,000,000	818,000,000	-
SPY223	17/02/2026	Active	1,636,000,000	mxn	1,636,000,000	1,636,000,000	-
SPY206	17/02/2026	Active	409,000,000	mxn	409,000,000	409,000,000	-
SPY035	22/02/2026	Active	19,500,000	mxn	19,500,000	19,500,000	-
M00736164	23/02/2026	Active	19,500,000	mxn	19,500,000	-	-
M00735961	23/02/2026	Active	19,500,000	mxn	-	19,500,000	-
SPX444	11/02/2026	Active	7,317,000,000	mxn	7,317,000,000	7,317,000,000	-
SPX333	18/02/2026	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	10,000,000	-
M00730794	18/02/2026	Active	10,000,000	mxn	10,000,000	-	-
M00730786	18/02/2026	Active	10,000,000	mxn	-	10,000,000	-
SPW846	17/02/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	5,000,000	-
M00727682	17/02/2026	Active	5,000,000	mxn	5,000,000	-	-
M00727681	17/02/2026	Active	5,000,000	mxn	-	5,000,000	-
SPW720	13/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00726451	13/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00726335	13/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
SPV610	10/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
M00720644	10/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	-	-
M00720636	10/02/2026	Active	15,000,000	mxn	-	15,000,000	-
SPV215	31/03/2026	Active	1,852,500	usd	1,852,500	1,852,500	-
SPV206	06/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	2,000,000	-
M00717856	06/02/2026	Active	2,000,000	mxn	2,000,000	-	-
M00717762	31/03/2026	Active	1,852,500	usd	1,852,500	-	-
M00717754	06/02/2026	Active	2,000,000	mxn	-	2,000,000	-
M00717651	31/03/2026	Active	1,852,500	usd	-	1,852,500	-
SPU922	28/01/2026	Active	2,040,000,000	mxn	2,040,000,000	2,040,000,000	-
SPU872	28/01/2026	Active	4,090,000,000	mxn	4,090,000,000	4,090,000,000	-
SPU874	28/01/2026	Active	4,100,000,000	mxn	4,100,000,000	4,100,000,000	-
SPU806	09/03/2026	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	-
SPU807	06/02/2026	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	-
SPU776	28/01/2026	Active	204,000,000	mxn	204,000,000	204,000,000	-
SPU777	28/01/2026	Active	204,000,000	mxn	204,000,000	204,000,000	-
SPU693	18/02/2026	Active	38,973,400	mxn	38,973,400	38,973,400	-
M00715785	18/02/2026	Active	38,973,400	mxn	38,973,400	-	-
M00714923	18/02/2026	Active	38,973,400	mxn	-	38,973,400	-
SPU431	03/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
M00714220	03/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	-	-
M00714218	28/01/2026	Active	7,166,626	mxn	7,166,626	-	-
M00713351	03/02/2026	Active	15,000,000	mxn	-	15,000,000	-
SPU166	28/01/2026	Active	7,167,092	mxn	7,167,092	7,167,092	-
M00712718	28/01/2026	Active	7,167,092	mxn	7,167,092	-	-
M00711823	28/01/2026	Active	7,167,092	mxn	-	7,167,092	-
M00711720	28/01/2026	Active	7,166,626	mxn	-	7,166,626	-
SPU015	02/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	150,000	-
M00711642	02/02/2026	Active	150,000	usd	150,000	-	-
M00711598	02/02/2026	Active	150,000	usd	-	150,000	-
SPT984	30/01/2026	Active	1,729,600	usd	1,729,600	1,729,600	-
M00711567	30/01/2026	Active	1,729,600	usd	1,729,600	-	-
M00711378	30/01/2026	Active	1,729,600	usd	-	1,729,600	-
SPT380	20/01/2026	Active	3,100,000,000	mxn	3,100,000,000	3,100,000,000	-
SPT375	20/01/2026	Active	10,350,000,000	mxn	10,350,000,000	10,350,000,000	-
SPT344	20/01/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SPT260	05/02/2026	Active	40,000,000	usd	40,000,000	40,000,000	-
SPT253	20/01/2026	Active	8,290,000,000	mxn	8,290,000,000	8,290,000,000	-
SPS808	26/01/2026	Active	3,500,000	mxn	3,500,000	3,500,000	-
M00706413	26/01/2026	Active	3,500,000	mxn	3,500,000	-	-
M00705593	26/01/2026	Active	3,500,000	mxn	-	3,500,000	-
SPS718	16/01/2026	Active	1,240,000,000	mxn	1,240,000,000	1,240,000,000	-
SPS682	16/01/2026	Active	2,060,000,000	mxn	2,060,000,000	2,060,000,000	-
SPS277	14/01/2026	Active	1,235,000,000	mxn	1,235,000,000	1,235,000,000	-
M00702458	23/01/2026	Active	3,000,000	mxn	-	3,000,000	-
M00702116	23/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	20,000,000	-
SPR821	20/01/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
M00700014	20/01/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	-	-
M00699017	20/01/2026	Active	15,000,000	mxn	-	15,000,000	-
SPR485	19/01/2026	Active	1,600,000	mxn	1,600,000	1,600,000	-
M00697937	19/01/2026	Active	1,600,000	mxn	1,600,000	-	-
M00697825	19/01/2026	Active	1,600,000	mxn	-	1,600,000	-
CA3499	31/03/2026	Active	-	usd/mxn	40,241,905	748,097,014	-
SPR369	09/01/2026	Active	2,040,000,000	mxn	2,040,000,000	2,040,000,000	-
CA3493	31/03/2026	Active	-	mxn/usd	748,097,014	40,241,905	-
SPR108	08/01/2026	Active	4,090,000,000	mxn	4,090,000,000	4,090,000,000	-
SPR019	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	2,500,000	-
M00695855	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	2,500,000	-	-
M00695544	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	-	2,500,000	-
SPQ969	07/01/2026	Active	2,050,000,000	mxn	2,050,000,000	2,050,000,000	-
SPQ970	07/01/2026	Active	4,500,000,000	mxn	4,500,000,000	4,500,000,000	-
SPQ971	07/01/2026	Active	1,635,000,000	mxn	1,635,000,000	1,635,000,000	-
SPQ793	07/01/2026	Active	6,050,000,000	mxn	6,050,000,000	6,050,000,000	-
SPQ792	07/01/2026	Active	6,050,000,000	mxn	6,050,000,000	6,050,000,000	-
M00690548	08/01/2026	Active	4,625,000	mxn	4,625,000	-	-
SPQ426	30/03/2026	Active	1,110,000,000	mxn	1,110,000,000	1,110,000,000	-
M00689774	13/01/2026	Active	3,000,000	mxn	-	3,000,000	-
SPQ361	08/01/2026	Active	4,625,000	mxn	4,625,000	4,625,000	-
M00689646	08/01/2026	Active	4,625,000	mxn	-	4,625,000	-
SPP897	26/03/2026	Active	830,000,000	mxn	830,000,000	830,000,000	-
M00686831	09/01/2026	Active	3,900,000	mxn	-	3,900,000	-
SPP867	26/03/2026	Active	835,000,000	mxn	835,000,000	835,000,000	-
SPP844	26/03/2026	Active	825,000,000	mxn	825,000,000	825,000,000	-
SPP825	01/01/2026	Active	2,050,000,000	mxn	2,050,000,000	2,050,000,000	-
SPP808	26/03/2026	Active	1,385,000,000	mxn	1,385,000,000	1,385,000,000	-
SPP789	26/03/2026	Active	1,370,000,000	mxn	1,370,000,000	1,370,000,000	-
M00686660	23/02/2026	Active	2,500,000	mxn	-	2,500,000	-
SPP702	01/01/2026	Active	830,000,000	mxn	830,000,000	830,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SPP639	01/01/2026	Active	2,050,000,000	mxn	2,050,000,000	2,050,000,000	-
SPP494	09/01/2026	Active	1,080,000	usd	1,080,000	1,080,000	-
M00685259	09/01/2026	Active	1,080,000	usd	1,080,000	-	-
M00685182	09/01/2026	Active	1,080,000	usd	-	1,080,000	-
SPP216	07/01/2026	Active	500,000	usd	500,000	500,000	-
M00683778	07/01/2026	Active	500,000	usd	500,000	-	-
M00683679	07/01/2026	Active	500,000	usd	-	500,000	-
SPO981	06/01/2026	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	7,500,000	-
M00683011	06/01/2026	Active	7,500,000	mxn	7,500,000	-	-
M00682030	06/01/2026	Active	7,500,000	mxn	-	7,500,000	-
SPO260	19/03/2026	Active	1,380,000,000	mxn	1,380,000,000	1,380,000,000	-
SPN555	16/03/2026	Active	1,375,000,000	mxn	1,375,000,000	1,375,000,000	-
SPN232	12/03/2026	Active	1,400,000,000	mxn	1,400,000,000	1,400,000,000	-
SPN166	12/03/2026	Active	1,380,000,000	mxn	1,380,000,000	1,380,000,000	-
SPN159	12/03/2026	Active	1,380,000,000	mxn	1,380,000,000	1,380,000,000	-
SPN152	12/03/2026	Active	1,380,000,000	mxn	1,380,000,000	1,380,000,000	-
SPM946	11/03/2026	Active	1,400,000,000	mxn	1,400,000,000	1,400,000,000	-
SPM286	09/03/2026	Active	1,400,000,000	mxn	1,400,000,000	1,400,000,000	-
SPM234	30/03/2026	Active	21,000,000	usd	21,000,000	21,000,000	-
SPM074	06/03/2026	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	-
SPL830	05/03/2026	Active	1,410,000,000	mxn	1,410,000,000	1,410,000,000	-
SPL448	04/03/2026	Active	860,000,000	mxn	860,000,000	860,000,000	-
SPK299	25/02/2026	Active	2,790,000,000	mxn	2,790,000,000	2,790,000,000	-
SPJ506	20/02/2026	Active	835,000,000	mxn	835,000,000	835,000,000	-
SPI916	03/03/2026	Active	3,000,000	usd	3,000,000	3,000,000	-
M00648047	03/03/2026	Active	3,000,000	usd	3,000,000	-	-
M00647187	03/03/2026	Active	3,000,000	usd	-	3,000,000	-
SPI699	02/01/2026	Active	3,500,000,000	mxn	3,500,000,000	3,500,000,000	-
SPI698	03/03/2026	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	-
SPI572	16/02/2026	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	-
SPI573	16/02/2026	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	-
SPH655	11/02/2026	Active	4,260,000,000	mxn	4,260,000,000	4,260,000,000	-
SPG247	03/02/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SPG246	03/02/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SPE666	12/01/2026	Active	5,000,000,000	mxn	5,000,000,000	5,000,000,000	-
SPE226	23/01/2026	Active	900,000,000	mxn	900,000,000	900,000,000	-
SPD761	12/01/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOZ556	16/01/2026	Active	13,500,000	usd	13,500,000	13,500,000	-
SOY826	14/01/2026	Active	42,000,000	usd	42,000,000	42,000,000	-
SOV938	27/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOV041	23/03/2026	Active	1,050,000,000	mxn	1,050,000,000	1,050,000,000	-
SOU866	23/03/2026	Active	420,000,000	mxn	420,000,000	420,000,000	-
P20454	26/02/2026	Active	119,584,366	mxn	-	-	119,584,365.55
P20449	26/02/2026	Active	119,584,366	mxn	-	-	119,584,365.55
SOS621	11/03/2026	Active	1,050,000,000	mxn	1,050,000,000	1,050,000,000	-
SOS619	11/03/2026	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	-
SOS439	10/03/2026	Active	635,000,000	mxn	635,000,000	635,000,000	-
SOR677	06/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOQ454	27/02/2026	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	-
SOQ452	27/02/2026	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	-
SOQ453	27/02/2026	Active	215,000,000	mxn	215,000,000	215,000,000	-
SOQ404	27/01/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
M00541762	27/01/2026	Active	1,000,000,000	mxn	-	1,000,000,000	-
SOQ381	27/01/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SOQ379	27/01/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SOQ215	20/02/2026	Active	8,333,333	mxn	8,333,333	8,333,333	-
M00540275	20/02/2026	Active	8,333,333	mxn	-	8,333,333	-
SOQ179	20/02/2026	Active	8,333,333	mxn	8,333,333	8,333,333	-
SOQ178	20/02/2026	Active	8,333,333	mxn	8,333,333	8,333,333	-
SOP750	26/02/2026	Active	20,000,000	usd	20,000,000	20,000,000	-
SOP751	26/02/2026	Active	20,000,000	usd	20,000,000	20,000,000	-
M00536991	19/02/2026	Active	600,000,000	mxn	-	600,000,000	-
M00536992	18/02/2026	Active	1,600,000,000	mxn	-	1,600,000,000	-
SOP027	18/02/2026	Active	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	1,600,000,000	-
SOP026	19/02/2026	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	-
SOP009	19/02/2026	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	-
SOP010	18/02/2026	Active	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	1,600,000,000	-
SOO947	22/01/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SOO868	19/02/2026	Active	600,000,000	mxn	600,000,000	600,000,000	-
SOO869	18/02/2026	Active	1,600,000,000	mxn	1,600,000,000	1,600,000,000	-
SOO816	18/02/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOO100	14/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SOO099	14/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SON792	11/02/2026	Active	365,000,000	mxn	365,000,000	365,000,000	-
P20371	06/02/2026	Active	500,000	usd	-	-	500,000.00
P20370	06/02/2026	Active	500,000	usd	-	-	500,000.00
SOM961	05/02/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOM959	05/02/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOM937	05/02/2026	Active	850,000,000	mxn	850,000,000	850,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SOM479	04/02/2026	Active	1,080,000,000	mxn	1,080,000,000	1,080,000,000	-
SOM140	03/02/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOL865	30/01/2026	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	-
SOL451	28/01/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SOL159	27/01/2026	Active	635,000,000	mxn	635,000,000	635,000,000	-
SOK963	26/01/2026	Active	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	-
SOK645	23/01/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOK138	20/01/2026	Active	435,000,000	mxn	435,000,000	435,000,000	-
SOJ680	16/01/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOJ678	16/01/2026	Active	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	-
SOJ679	16/01/2026	Active	320,000,000	mxn	320,000,000	320,000,000	-
SOJ638	16/01/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOJ557	09/01/2026	Active	5,754,503	usd	5,754,503	5,754,503	-
SOJ539	09/01/2026	Active	5,754,503	usd	5,754,503	5,754,503	-
SOJ101	14/01/2026	Active	650,000,000	mxn	650,000,000	650,000,000	-
SOJ105	14/01/2026	Active	650,000,000	mxn	650,000,000	650,000,000	-
SOJ094	18/03/2026	Active	1,200,000,000	mxn	1,200,000,000	1,200,000,000	-
SOJ095	14/01/2026	Active	650,000,000	mxn	650,000,000	650,000,000	-
SOJ096	14/01/2026	Active	430,000,000	mxn	430,000,000	430,000,000	-
SOJ097	14/01/2026	Active	650,000,000	mxn	650,000,000	650,000,000	-
SOI658	12/01/2026	Active	640,000,000	mxn	640,000,000	640,000,000	-
SOI251	08/01/2026	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	-
SOI250	08/01/2026	Active	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	-
SOI190	08/01/2026	Active	630,000,000	mxn	630,000,000	630,000,000	-
SOD133	02/01/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SOD132	02/01/2026	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
C98097	27/02/2026	Active	-	mxn/usd	2,351,523,638	113,820,118	-
C98096	27/02/2026	Active	-	usd/mxn	113,820,118	2,351,523,638	-
SOC386	18/02/2026	Active	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	-
SOC186	02/01/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SOC185	02/01/2026	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
SOC079	05/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SOC081	06/02/2026	Active	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SOC085	19/02/2026	Active	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	-
SOC092	27/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SOC099	25/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SOC075	20/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SOC041	19/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SOC049	13/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SOC011	24/03/2026	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SOB981	25/03/2026	Active	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SNU072	30/01/2026	Active	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
SNU080	19/02/2026	Active	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	-
SNU090	25/02/2026	Active	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SNU091	04/03/2026	Active	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SNU039	18/02/2026	Active	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SNU044	19/03/2026	Active	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SNT399	05/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT402	13/02/2026	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	-
SNT404	16/02/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SNT412	27/02/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SNT414	02/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SNT394	16/01/2026	Active	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SNT353	19/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT358	25/03/2026	Active	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	-
SNT326	05/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT327	26/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT312	19/03/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SNS672	02/01/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SNS671	02/01/2026	Active	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
SNK780	21/01/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SNK775	18/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SNJ432	17/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SNJ428	17/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SNJ427	17/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SNJ375	17/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SNJ135	01/01/2026	Active	30,164,100	mxn	30,164,100	30,164,100	-
SNJ116	01/02/2026	Active	526,216,790	mxn	526,216,790	526,216,790	-
SNJ111	01/01/2026	Active	30,164,100	mxn	30,164,100	30,164,100	-
SNJ100	01/01/2026	Active	414,129,324	mxn	414,129,324	414,129,324	-
SNJ096	01/02/2026	Active	182,592,241	mxn	182,592,241	182,592,241	-
SNJ097	01/03/2026	Active	83,049,007	mxn	83,049,007	83,049,007	-
SNJ095	01/01/2026	Active	165,896,137	mxn	165,896,137	165,896,137	-
SNJ083	01/03/2026	Active	223,549,140	mxn	223,549,140	223,549,140	-
SNJ081	01/03/2026	Active	289,241,550	mxn	289,241,550	289,241,550	-
SNJ082	01/03/2026	Active	289,241,550	mxn	289,241,550	289,241,550	-
P19931	03/02/2026	Active	60,000,000	mxn	-	-	60,000,000.00
P19929	03/02/2026	Active	60,000,000	mxn	-	-	60,000,000.00
C95766	16/01/2026	Active	-	mxn/usd	3,612,920,000	200,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C95697	16/01/2026	Active	-	usd/mxn	200,000,000	3,612,920,000	-
C95619	16/01/2026	Active	-	usd/mxn	200,000,000	3,612,920,000	-
C95618	16/01/2026	Active	-	mxn/usd	3,612,920,000	200,000,000	-
M00349405	16/01/2026	Active	200,000,000	usd	-	200,000,000	-
P19742	05/02/2026	Active	1,500,000,000	mxn	-	-	1,500,000,000.00
P19738	05/02/2026	Active	1,500,000,000	mxn	-	-	1,500,000,000.00
SLA718	31/03/2026	Active	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	-
SLA717	31/03/2026	Active	275,000,000	mxn	275,000,000	275,000,000	-
SLA716	31/03/2026	Active	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	-
SLA243	25/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SLA227	25/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SLA195	25/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SLA191	25/03/2026	Active	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	-
SLA176	27/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SLA158	27/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
M00267991	27/03/2026	Active	250,000,000	mxn	-	250,000,000	-
SLA153	27/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SLA001	24/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SLA002	24/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ975	24/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ920	27/03/2026	Active	52,900,000	usd	52,900,000	52,900,000	-
SKZ894	27/03/2026	Active	52,900,000	usd	52,900,000	52,900,000	-
SKZ771	23/03/2026	Active	185,000,000	mxn	185,000,000	185,000,000	-
SKZ769	23/03/2026	Active	185,000,000	mxn	185,000,000	185,000,000	-
SKZ768	23/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ766	23/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ764	23/03/2026	Active	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SKZ746	23/03/2026	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	-
SKZ589	20/03/2026	Active	460,000,000	mxn	460,000,000	460,000,000	-
SKZ590	20/03/2026	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SKZ591	20/03/2026	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SKZ586	20/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ583	20/03/2026	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	-
SKZ584	20/03/2026	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	-
SKZ582	20/03/2026	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	-
SKZ580	20/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ546	25/03/2026	Active	52,900,000	usd	52,900,000	52,900,000	-
SKZ487	25/03/2026	Active	52,900,000	usd	52,900,000	52,900,000	-
SKZ352	19/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ348	19/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKZ343	19/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ340	19/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ158	02/03/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
SKY223	17/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKY008	13/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKY002	13/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKX730	12/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKX489	11/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKX342	10/03/2026	Active	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SKX340	10/03/2026	Active	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SKX339	10/03/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKX141	09/03/2026	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	-
SKX136	09/03/2026	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	-
SKX130	09/03/2026	Active	370,000,000	mxn	370,000,000	370,000,000	-
SKX112	09/03/2026	Active	465,000,000	mxn	465,000,000	465,000,000	-
SKW612	05/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SKW613	05/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SKW603	05/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW597	05/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW598	05/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW594	05/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW587	05/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW372	04/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKW359	04/03/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKW148	07/03/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
SKV952	06/03/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
SKV939	06/03/2026	Active	5,000,000	usd	5,000,000	5,000,000	-
SKV930	06/03/2026	Active	12,500,000	usd	12,500,000	12,500,000	-
SKV868	02/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV861	02/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKV726	27/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV725	27/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV662	04/03/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
SKV656	27/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKV634	27/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV532	04/03/2026	Active	20,000,000	usd	20,000,000	20,000,000	-
SKV481	04/03/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
SKV359	26/02/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKV355	26/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SKV351	26/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV349	26/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV247	01/03/2026	Active	10,600,000	usd	10,600,000	10,600,000	-
SKV234	01/03/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKV099	25/02/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKV085	25/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV077	25/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKU897	28/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKU890	24/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKU885	24/02/2026	Active	330,000,000	mxn	330,000,000	330,000,000	-
SKU871	24/02/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKU862	24/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKU732	28/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKU733	28/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKU729	28/02/2026	Active	105,000,000	usd	105,000,000	105,000,000	-
SKU655	23/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKU453	20/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKU442	20/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKU443	20/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKU441	20/02/2026	Active	940,000,000	mxn	940,000,000	940,000,000	-
SKU393	26/02/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
SKU373	28/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SKU361	26/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKU344	26/02/2026	Active	10,000,000	usd	10,000,000	10,000,000	-
SKU342	26/02/2026	Active	15,000,000	usd	15,000,000	15,000,000	-
C92562	23/02/2026	Active	-	usd/mxn	926,828	15,800,000	-
C92563	23/02/2026	Active	-	mxn/usd	15,800,000	926,828	-
C92560	23/02/2026	Active	-	mxn/usd	9,500,000	557,270	-
C92561	23/02/2026	Active	-	usd/mxn	557,270	9,500,000	-
SKU284	26/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKU190	19/02/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SKU191	19/02/2026	Active	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SKU167	19/02/2026	Active	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SKU161	19/02/2026	Active	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	-
SKU154	19/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKU036	22/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKT962	22/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKT890	18/02/2026	Active	59,000,000	mxn	59,000,000	59,000,000	-
SKT891	18/02/2026	Active	59,000,000	mxn	59,000,000	59,000,000	-
SKT888	18/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
SKT889	18/02/2026	Active	15,000,000	mxn	15,000,000	15,000,000	-
SKT831	22/02/2026	Active	50,000,000	usd	50,000,000	50,000,000	-
SKT687	16/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT683	16/02/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKT681	16/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT555	21/02/2026	Active	10,175,000	usd	10,175,000	10,175,000	-
SKT557	21/02/2026	Active	10,175,000	usd	10,175,000	10,175,000	-
SKT525	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT506	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT507	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT504	13/02/2026	Active	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	-
SKT486	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT484	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT482	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT453	13/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT407	20/02/2026	Active	15,250,000	usd	15,250,000	15,250,000	-
SKT259	20/02/2026	Active	15,250,000	usd	15,250,000	15,250,000	-
SKT256	20/02/2026	Active	15,250,000	usd	15,250,000	15,250,000	-
SKT213	12/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT199	12/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKT158	16/02/2026	Active	15,250,000	usd	15,250,000	15,250,000	-
SKT098	16/02/2026	Active	51,250,000	usd	51,250,000	51,250,000	-
SKS933	11/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS917	11/02/2026	Active	425,000,000	mxn	425,000,000	425,000,000	-
SKS909	11/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS898	11/02/2026	Active	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SKS896	11/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS895	15/02/2026	Active	10,150,000	usd	10,150,000	10,150,000	-
SKS870	15/02/2026	Active	25,250,000	usd	25,250,000	25,250,000	-
SKS869	15/02/2026	Active	25,250,000	usd	25,250,000	25,250,000	-
SKS709	10/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS705	10/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS671	16/02/2026	Active	40,560,000	mxn	40,560,000	40,560,000	-
SKS534	09/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS361	06/02/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKS359	06/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS354	06/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS105	05/02/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKS101	05/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SKS096	05/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKS039	09/02/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKS038	09/02/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKR957	09/02/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKR956	09/02/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKR857	04/02/2026	Active	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SKP566	06/02/2026	Active	79,000,000	usd	79,000,000	79,000,000	-
SKP529	06/02/2026	Active	26,300,000	usd	26,300,000	26,300,000	-
SKP530	06/02/2026	Active	52,700,000	usd	52,700,000	52,700,000	-
SKP524	06/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKP431	05/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKP352	05/02/2026	Active	25,500,000	usd	25,500,000	25,500,000	-
SKP349	05/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKP346	05/02/2026	Active	52,500,000	usd	52,500,000	52,500,000	-
SKP251	02/02/2026	Active	25,000,000	usd	25,000,000	25,000,000	-
SKP240	02/02/2026	Active	50,900,000	usd	50,900,000	50,900,000	-
SKP241	02/02/2026	Active	50,900,000	usd	50,900,000	50,900,000	-
SKP236	02/02/2026	Active	56,000,000	usd	56,000,000	56,000,000	-
SKP139	02/02/2026	Active	2,500,000	usd	2,500,000	2,500,000	-
SKP002	28/01/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SKP003	28/01/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SKP001	28/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKO772	27/01/2026	Active	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SKO764	27/01/2026	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	-
SKO376	23/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKO373	23/01/2026	Active	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SKO228	29/01/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKO227	29/01/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKO196	29/01/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKO198	29/01/2026	Active	52,600,000	usd	52,600,000	52,600,000	-
SKO137	22/01/2026	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	-
SKO114	22/01/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKO097	22/01/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKN557	20/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKN542	20/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKN298	23/01/2026	Active	20,000,000	usd	20,000,000	20,000,000	-
SKN296	19/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKN297	19/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKN295	19/01/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKN074	22/01/2026	Active	20,500,000	usd	20,500,000	20,500,000	-
SKM830	15/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKM821	15/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKM767	19/01/2026	Active	26,200,000	usd	26,200,000	26,200,000	-
SKM627	19/01/2026	Active	26,200,000	usd	26,200,000	26,200,000	-
SKM533	14/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKM531	14/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKM527	14/01/2026	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	-
P19419	09/01/2026	Active	174,000,000	mxn	-	-	174,000,000.00
P19418	09/01/2026	Active	174,000,000	mxn	-	-	174,000,000.00
P19415	09/01/2026	Active	174,000,000	mxn	-	-	174,000,000.00
P19414	09/01/2026	Active	174,000,000	mxn	-	-	174,000,000.00
SKL899	12/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKL500	31/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	-
SKL414	08/01/2026	Active	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKL341	31/01/2026	Active	32,397,404	mxn	32,397,404	32,397,404	-
SKL265	07/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKL170	07/01/2026	Active	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SKL089	06/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKL030	06/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKL031	06/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKL029	06/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK926	05/01/2026	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	-
SKK924	05/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK922	05/01/2026	Active	265,000,000	mxn	265,000,000	265,000,000	-
SKK919	05/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK723	02/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK724	02/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK721	02/01/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKK719	02/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK689	08/01/2026	Active	26,300,000	usd	26,300,000	26,300,000	-
SKK687	05/01/2026	Active	31,600,000	usd	31,600,000	31,600,000	-
SKK634	08/01/2026	Active	26,300,000	usd	26,300,000	26,300,000	-
SKK459	01/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKK429	05/01/2026	Active	31,600,000	usd	31,600,000	31,600,000	-
P19171	28/01/2026	Active	4,387,500	usd	-	-	4,387,500.00
P19170	28/01/2026	Active	4,387,500	usd	-	-	4,387,500.00
SII403	31/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SII229	30/03/2026	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	-
SIH960	27/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SIH959	27/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SIH680	26/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SIH496	25/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SIH481	25/03/2026	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	-
SIG864	17/03/2026	Active	12,665,765	mxn	12,665,765	12,665,765	-
P18781	17/03/2026	Active	17,000,000	mxn	-	-	17,000,000.00
SIG148	18/03/2026	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SIF651	21/03/2026	Active	3,500,000	usd	3,500,000	3,500,000	-
SIE341	10/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SIC696	27/02/2026	Active	105,000,000	mxn	105,000,000	105,000,000	-
SIC635	27/02/2026	Active	54,894,900	mxn	54,894,900	54,894,900	-
C85388	27/02/2026	Active	-	mxn/usd	54,894,900	3,000,000	-
M00022799	27/02/2026	Active	3,000,000	usd	-	3,000,000	-
SIC362	27/02/2026	Active	54,894,900	mxn	54,894,900	54,894,900	-
SIC361	27/02/2026	Active	54,894,900	mxn	54,894,900	54,894,900	-
C85346	27/02/2026	Active	-	usd/mxn	3,000,000	54,894,900	-
C85345	27/02/2026	Active	-	mxn/usd	54,894,900	3,000,000	-
C85344	27/02/2026	Active	-	usd/mxn	3,000,000	54,894,900	-
SIC356	27/02/2026	Active	54,894,900	mxn	54,894,900	54,894,900	-
SIB378	20/02/2026	Active	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	-
SIB372	20/02/2026	Active	710,000,000	mxn	710,000,000	710,000,000	-
SIB249	26/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SIB242	19/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SIB230	19/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SIB231	19/02/2026	Active	260,000,000	mxn	260,000,000	260,000,000	-
SIB229	19/02/2026	Active	85,000,000	mxn	85,000,000	85,000,000	-
SIA988	18/02/2026	Active	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	-
SIA283	05/02/2026	Active	283,511	mxn	283,511	283,511	-
SIA267	05/02/2026	Active	283,511	mxn	283,511	283,511	-
SHZ945	10/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SHZ929	10/02/2026	Active	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SHZ782	09/02/2026	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	-
SHZ659	09/02/2026	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	-
SHZ660	09/02/2026	Active	290,000,000	mxn	290,000,000	290,000,000	-
SHY064	30/01/2026	Active	480,000,000	mxn	480,000,000	480,000,000	-
SHY061	30/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SHX892	29/01/2026	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	-
P18681	30/01/2026	Active	100,000,000	mxn	-	-	100,000,000.00
SHX615	30/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
P18678	30/01/2026	Active	100,000,000	mxn	-	-	100,000,000.00
SHX605	30/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SHX452	27/01/2026	Active	45,000,000	mxn	45,000,000	45,000,000	-
SHX056	23/01/2026	Active	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	-
SHV834	05/01/2026	Active	379,170	mxn	379,170	379,170	-
SHV830	05/01/2026	Active	379,170	mxn	379,170	379,170	-
C84438	17/01/2026	Active	-	usd/mxn	6,250,000	117,812,500	-
C84437	17/01/2026	Active	-	mxn/usd	117,812,500	6,250,000	-
SHU696	07/01/2026	Active	3,180,000,000	mxn	3,180,000,000	3,180,000,000	-
SHB127	08/01/2026	Active	18,003,253	mxn	18,003,253	18,003,253	-
SHB123	08/01/2026	Active	18,003,253	mxn	18,003,253	18,003,253	-
P18092	23/01/2026	Active	4,500,000	mxn	-	-	4,500,000.00
SGW934	15/01/2026	Active	33,582,877	mxn	33,582,877	33,582,877	-
SGU875	27/02/2026	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	-
SGU780	27/02/2026	Active	7,000,000	mxn	7,000,000	7,000,000	-
SGL828	10/03/2026	Active	15,734,063	mxn	15,734,063	15,734,063	-
SGL786	10/03/2026	Active	15,734,063	mxn	15,734,063	15,734,063	-
SGF136	12/02/2026	Active	40,631,591	mxn	40,631,591	40,631,591	-
SGF134	12/02/2026	Active	40,631,591	mxn	40,631,591	40,631,591	-
SGE657	19/01/2026	Active	95,500,000	usd	95,500,000	95,500,000	-
SGE656	19/01/2026	Active	95,500,000	usd	95,500,000	95,500,000	-
SGE497	19/01/2026	Active	95,500,000	usd	95,500,000	95,500,000	-
MSU810	19/01/2026	Active	95,500,000	usd	-	95,500,000	-
SGD030	05/03/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SGC309	27/02/2026	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	-
SGC142	27/02/2026	Active	13,000,000	mxn	13,000,000	13,000,000	-
SGB091	25/02/2026	Active	512,640	usd	512,640	512,640	-
SGB071	25/02/2026	Active	512,640	usd	512,640	512,640	-
SGA462	24/02/2026	Active	1,365,360	usd	1,365,360	1,365,360	-
SGA459	24/02/2026	Active	1,365,360	usd	1,365,360	1,365,360	-
SGA144	19/02/2026	Active	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	-
SFZ906	18/02/2026	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	-
SFZ698	23/02/2026	Active	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SFZ699	23/02/2026	Active	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SFY818	28/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SFU227	12/01/2026	Active	11,343,126	mxn	11,343,126	11,343,126	-
SFU193	12/01/2026	Active	11,343,126	mxn	11,343,126	11,343,126	-
SFU023	08/01/2026	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	-
SFT810	07/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SES947	09/03/2026	Active	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDX278	26/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX219	11/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX220	11/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX189	05/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX199	05/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX202	05/02/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX168	06/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX172	06/03/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
P17277	11/03/2026	Active	250,000,000	mxn	-	-	250,000,000.00
P17269	13/02/2026	Active	5,000,000	mxn	-	-	5,000,000.00
P17276	11/03/2026	Active	250,000,000	mxn	-	-	250,000,000.00
P17262	30/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	-	20,000,000.00
P17263	30/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	-	20,000,000.00
P17264	30/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	-	20,000,000.00
P17265	30/01/2026	Active	20,000,000	mxn	-	-	20,000,000.00
P17268	13/02/2026	Active	5,000,000	mxn	-	-	5,000,000.00
P17258	23/01/2026	Active	4,500,000	mxn	-	-	4,500,000.00
SDX149	05/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX113	04/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX102	04/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX070	03/03/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDW986	16/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW973	08/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW916	02/02/2026	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDW921	02/02/2026	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDW934	16/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW905	16/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW872	16/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW832	02/02/2026	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SDW852	06/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW779	15/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW739	14/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW694	14/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW655	14/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW626	02/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW585	30/01/2026	Active	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDW566	26/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW556	14/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW533	30/01/2026	Active	390,000,000	mxn	390,000,000	390,000,000	-
SDW527	14/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW489	14/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW476	20/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW415	14/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDW382	14/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW352	14/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW353	29/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDW324	12/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW272	29/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW286	12/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW231	29/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW234	25/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW237	12/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW211	12/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW159	25/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW186	12/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW089	12/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDW124	13/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW044	13/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV990	13/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV925	13/01/2026	Active	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	-
SDV936	31/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV889	02/01/2026	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDV897	31/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV847	31/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV783	01/01/2026	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	-
SDV773	31/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV722	23/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV731	12/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV668	12/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV635	26/03/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDV537	09/01/2026	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	-
SDV540	23/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV477	07/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV402	26/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV411	20/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV376	13/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV386	13/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
MNF326	27/01/2026	Active	104,377,198	mxn	-	104,377,198	-
SDV314	30/01/2026	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDV328	07/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV286	07/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV298	30/01/2026	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	-
SDV253	20/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV256	31/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV232	07/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDV168	20/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV200	26/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV165	23/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV099	18/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV119	20/02/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV044	20/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU961	18/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU965	19/02/2026	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDU981	30/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU915	19/02/2026	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	-
SDU853	23/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU819	25/03/2026	Active	440,000,000	mxn	440,000,000	440,000,000	-
SDU758	27/01/2026	Active	104,377,198	mxn	104,377,198	104,377,198	-
SDU766	27/01/2026	Active	104,377,198	mxn	104,377,198	104,377,198	-
SDU772	27/01/2026	Active	104,377,198	mxn	104,377,198	104,377,198	-
SDU775	23/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU793	25/03/2026	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SDU794	23/01/2026	Active	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	-
SDU748	09/02/2026	Active	25,000,000	mxn	25,000,000	25,000,000	-
SDU695	09/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU714	23/01/2026	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	-
SDU633	16/01/2026	Active	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	-
SDU580	05/01/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU550	06/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU568	19/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU513	12/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU521	06/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU474	12/02/2026	Active	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	-
SDU388	11/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU370	22/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU373	06/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU308	06/02/2026	Active	270,000,000	mxn	270,000,000	270,000,000	-
SDU315	02/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU245	09/01/2026	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	-
SDU256	09/01/2026	Active	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	-
SDU265	18/02/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDU272	02/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU219	18/02/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU238	16/01/2026	Active	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	-
SDU175	05/01/2026	Active	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDU130	16/01/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT982	01/01/2026	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	-
SDT989	18/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT911	24/03/2026	Active	110,000,000	mxn	110,000,000	110,000,000	-
SDT935	06/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT754	15/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT795	17/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT717	17/03/2026	Active	60,000,000	mxn	60,000,000	60,000,000	-
SDT657	27/01/2026	Active	4,500,000,000	mxn	4,500,000,000	4,500,000,000	-
SDT668	17/03/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDT691	06/02/2026	Active	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDT636	15/01/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT639	23/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT573	04/02/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT603	17/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT512	20/03/2026	Active	45,000,000	mxn	45,000,000	45,000,000	-
SDT554	17/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT561	10/03/2026	Active	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT483	17/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT496	04/02/2026	Active	135,000,000	mxn	135,000,000	135,000,000	-
SDT432	10/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT448	17/03/2026	Active	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDT407	17/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT322	27/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT328	27/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT366	30/01/2026	Active	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
SDT367	30/01/2026	Active	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
SDT245	20/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT264	30/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT181	25/03/2026	Active	95,000,000	mxn	95,000,000	95,000,000	-
SDT092	23/03/2026	Active	95,000,000	mxn	95,000,000	95,000,000	-
SDT109	18/03/2026	Active	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SDS993	19/03/2026	Active	302,437,938	mxn	302,437,938	302,437,938	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDS926	19/03/2026	Active	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDS938	18/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDS942	18/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDS732	12/01/2026	Active	2,697,369	mxn	2,697,369	2,697,369	-
SDS681	12/01/2026	Active	2,697,369	mxn	2,697,369	2,697,369	-
SDS702	19/02/2026	Active	350,000,000	mxn	350,000,000	350,000,000	-
SDS644	11/03/2026	Active	35,000,000	mxn	35,000,000	35,000,000	-
SDS519	06/03/2026	Active	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDS378	05/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS276	03/03/2026	Active	125,000,000	mxn	125,000,000	125,000,000	-
SDS285	04/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS312	04/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS232	03/03/2026	Active	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS192	02/03/2026	Active	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDS076	25/02/2026	Active	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SDS053	24/02/2026	Active	75,000,000	mxn	75,000,000	75,000,000	-
C66007	22/01/2026	Active	-	cop/usd	177,500,000,000	50,000,000	-
C65978	22/01/2026	Active	-	usd/cop	50,000,000	177,500,000,000	-

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	03/18/2026	USD	1,370,000	MXN	(24,677,810)
FWD	03/18/2026	USD	630,000	MXN	(11,308,500)
FWD	03/18/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,600,000
FWD	03/18/2026	USD	100,000	MXN	(1,758,060)
FWD	03/18/2026	USD	(100,000)	MXN	1,784,000
FWD	03/18/2026	USD	2,400,000	MXN	(42,048,000)
FWD	03/18/2026	USD	(2,400,000)	MXN	42,346,800
FWD	03/03/2026	USD	20,000,000	MXN	(431,040,000)
FWD	03/27/2026	USD	(8,000,000)	MXN	169,280,000
FWD	01/16/2026	USD	1,900,000	MXN	(39,938,000)
FWD	01/23/2026	USD	135,000	MXN	(2,880,090)
FWD	02/13/2026	USD	160,000	MXN	(3,525,280)
FWD	03/20/2026	USD	115,000	MXN	(2,488,255)
FWD	01/23/2026	USD	(10,000,000)	MXN	219,035,000
FWD	02/03/2026	USD	(495,300)	MXN	10,767,822
FWD	03/02/2026	USD	(512,200)	MXN	11,174,667
FWD	02/10/2026	USD	(11,800,000)	MXN	254,986,200
FWD	02/24/2026	USD	30,000,000	MXN	(639,840,000)
FWD	03/18/2026	USD	50,000,000	MXN	(1,071,000,000)
FWD	02/27/2026	USD	(50,000,000)	MXN	1,071,050,000
FWD	03/03/2026	USD	20,000,000	MXN	(429,030,000)
FWD	03/03/2026	USD	10,000,000	MXN	(214,515,000)
FWD	03/03/2026	USD	30,000,000	MXN	(642,315,000)
FWD	03/13/2026	USD	(10,000,000)	MXN	213,000,000
FWD	03/19/2026	USD	25,000,000	MXN	(522,000,000)
FWD	03/24/2026	USD	15,000,000	MXN	(315,817,500)
FWD	01/07/2026	USD	(30,000,000)	MXN	619,770,000
FWD	01/15/2026	USD	10,000,000	MXN	(210,660,000)
FWD	01/15/2026	USD	20,000,000	MXN	(421,310,000)
FWD	01/23/2026	USD	100,000,000	MXN	(2,033,500,000)
FWD	01/26/2026	USD	(40,000,000)	MXN	813,360,000
FWD	01/26/2026	USD	(30,000,000)	MXN	609,900,000
FWD	03/05/2026	USD	20,000,000	MXN	(397,560,000)
FWD	03/13/2026	USD	20,000,000	MXN	(390,720,000)
FWD	02/04/2026	USD	30,000,000	MXN	(575,340,000)
FWD	02/05/2026	USD	(20,000,000)	MXN	385,950,000
FWD	02/05/2026	USD	(10,000,000)	MXN	192,975,000
FWD	02/06/2026	USD	30,000,000	MXN	(576,360,000)
FWD	02/09/2026	USD	(15,000,000)	MXN	287,025,000
FWD	02/11/2026	USD	(30,000,000)	MXN	570,330,000
FWD	03/18/2026	USD	49,600,000	MXN	(946,616,000)
FWD	03/18/2026	USD	49,700,000	MXN	(948,549,350)
FWD	03/05/2026	USD	(50,000,000)	MXN	953,600,000
FWD	03/05/2026	USD	(20,000,000)	MXN	381,690,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	03/18/2026	USD	(10,000,000)	MXN	187,265,000
FWD	03/18/2026	USD	99,100,000	MXN	(1,848,611,400)
FWD	03/23/2026	USD	(25,000,000)	MXN	467,550,000
FWD	03/23/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,495,440,000
FWD	01/07/2026	USD	(16,000,000)	MXN	297,216,000
FWD	01/26/2026	USD	(30,000,000)	MXN	557,745,000
FWD	03/31/2026	USD	12,000,000	MXN	(224,706,000)
FWD	01/05/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,854,700,000
FWD	03/18/2026	USD	(50,000,000)	MXN	943,300,000
FWD	01/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	933,900,000
FWD	01/14/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,842,000,000)
FWD	03/17/2026	USD	(30,000,000)	MXN	556,065,000
FWD	02/17/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,848,050,000)
FWD	01/07/2026	EUR	65,000,000	USD	(75,448,100)
FWD	01/26/2026	USD	20,000,000	MXN	(372,770,000)
FWD	03/31/2026	USD	50,000,000	MXN	(932,200,000)
FWD	03/18/2026	USD	(58,032,310)	MXN	1,076,093,117
FWD	01/12/2026	USD	25,000,000	MXN	(457,875,000)
FWD	03/17/2026	USD	25,000,000	MXN	(455,312,500)
FWD	03/17/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,453,888,000
FWD	03/17/2026	USD	50,000,000	MXN	(907,530,000)
FWD	03/18/2026	USD	30,000,000	MXN	(543,435,000)
FWD	03/18/2026	USD	30,000,000	MXN	(543,735,000)
FWD	03/18/2026	USD	161,736,912	MXN	(2,935,848,419)
FWD	01/23/2026	USD	(45,000,000)	MXN	812,700,000
FWD	02/27/2026	USD	(35,000,000)	MXN	631,102,500
FWD	02/27/2026	USD	35,000,000	MXN	(631,102,500)
FWD	03/30/2026	USD	(50,000,000)	MXN	902,625,000
FWD	01/05/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,794,600,000)
FWD	01/30/2026	USD	(100,257,000)	MXN	1,803,202,351
FWD	01/06/2026	USD	100,067,519	MXN	(1,796,412,092)
FWD	02/27/2026	USD	(100,598,519)	MXN	1,814,696,675
FWD	01/30/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,802,700,000)
FWD	01/02/2026	USD	(20,000,000)	MXN	359,066,400
FWD	01/02/2026	USD	20,000,000	MXN	(359,060,000)
FWD	01/02/2026	USD	(50,000,000)	MXN	898,150,000
FWD	02/03/2026	USD	50,000,000	MXN	(901,100,000)
FWD	01/02/2026	USD	(20,000,000)	MXN	359,190,000
FWD	01/02/2026	USD	20,000,000	MXN	(359,190,000)
FWD	01/16/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,797,500,000
FWD	02/03/2026	USD	100,184,000	MXN	(1,804,383,969)
FWD	01/02/2026	USD	6,535,308	MXN	(117,772,135)
FWD	01/05/2026	USD	(6,535,308)	MXN	117,763,633
FWD	01/05/2026	USD	94,301,112	MXN	(1,690,347,428)
FWD	01/06/2026	USD	(94,293,747)	MXN	1,690,347,428
FWD	01/05/2026	USD	(91,000,000)	MXN	1,630,556,200
FWD	01/06/2026	USD	91,000,000	MXN	(1,630,692,700)
FWD	01/05/2026	USD	64,403	MXN	(1,153,969)
FWD	01/06/2026	USD	(64,403)	MXN	1,154,013
FWD	01/06/2026	USD	(159,331)	MXN	2,848,273
FWD	01/06/2026	USD	(15,366)	MXN	274,695
FWD	01/06/2026	USD	(127,000)	MXN	2,271,166
FWD	01/06/2026	USD	(214,000)	MXN	3,833,382
FWD	01/06/2026	USD	1,670,135	MXN	(29,936,502)
FWD	01/06/2026	USD	497,893	MXN	(8,925,778)
FWD	01/06/2026	USD	155,616	MXN	(2,786,787)
FWD	01/06/2026	USD	(105,872)	MXN	1,895,420
FWD	01/05/2026	USD	(23,000,000)	MXN	412,620,000
FWD	01/06/2026	USD	23,000,000	MXN	(412,640,700)
FWD	01/05/2026	USD	23,000,000	MXN	(412,055,212)
FWD	01/06/2026	USD	(23,000,000)	MXN	412,078,212
FWD	01/06/2026	USD	(55,000,000)	MXN	983,644,750
FWD	01/07/2026	USD	55,000,000	MXN	(983,708,000)
FWD	01/06/2026	USD	(114,001)	MXN	2,039,010
FWD	01/07/2026	USD	114,001	MXN	(2,039,164)
FWD	01/07/2026	USD	31,980	MXN	(572,286)
FWD	01/07/2026	USD	28,287	MXN	(506,238)
FWD	01/07/2026	USD	76,260	MXN	(1,364,810)
FWD	01/07/2026	USD	556,482	MXN	(9,961,907)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/07/2026	USD	(21,676)	MXN	387,869
FWD	01/07/2026	USD	(29,578)	MXN	529,734
FWD	01/07/2026	USD	300,000	MXN	(5,375,567)
FWD	01/06/2026	USD	(48,000,000)	MXN	861,204,240
FWD	01/07/2026	USD	48,000,000	MXN	(861,240,240)
FWD	01/06/2026	USD	48,000,000	MXN	(861,204,240)
FWD	01/07/2026	USD	(48,000,000)	MXN	861,240,240
FWD	01/07/2026	USD	76,000,000	MXN	(1,362,965,000)
FWD	01/08/2026	USD	(76,000,000)	MXN	1,363,029,600
FWD	01/07/2026	USD	728,473	MXN	(13,088,614)
FWD	01/08/2026	USD	(728,473)	MXN	13,088,984
FWD	02/09/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,803,100,000)
FWD	01/07/2026	EUR	(65,000,000)	USD	75,998,000
FWD	01/08/2026	USD	(10,000,000)	MXN	179,650,000
FWD	03/09/2026	USD	10,000,000	MXN	(180,690,000)
FWD	01/06/2026	USD	(30,000,000)	MXN	538,866,720
FWD	01/07/2026	USD	30,000,000	MXN	(538,902,720)
FWD	01/07/2026	USD	(13,000)	MXN	233,382
FWD	01/08/2026	USD	13,000	MXN	(233,403)
FWD	01/08/2026	USD	(7,112)	MXN	127,729
FWD	01/08/2026	USD	(269,694)	MXN	4,844,372
FWD	01/08/2026	USD	171,468,788	MXN	(3,079,065,022)
FWD	03/18/2026	USD	(170,283,432)	MXN	3,079,065,022
FWD	01/09/2026	USD	(1,185,000)	MXN	21,304,570
FWD	01/09/2026	USD	40,000,000	MXN	(718,200,000)
FWD	01/09/2026	USD	(173,440)	MXN	3,115,192
FWD	01/09/2026	USD	(92,594)	MXN	1,663,105
FWD	01/09/2026	USD	(40,000,000)	MXN	718,200,000
FWD	01/09/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,258,810,000
FWD	01/09/2026	USD	(30,000,000)	MXN	539,490,000
FWD	01/09/2026	USD	(81,887)	MXN	1,471,278
FWD	01/09/2026	USD	191,000	MXN	(3,433,028)
FWD	01/12/2026	USD	(18,192)	MXN	327,080
FWD	01/12/2026	USD	(57,324)	MXN	1,031,015
FWD	01/12/2026	USD	(90,409)	MXN	1,626,701
FWD	01/12/2026	USD	(66,132)	MXN	1,189,694
FWD	01/12/2026	USD	(189,327)	MXN	3,405,550
FWD	01/12/2026	USD	250,000	MXN	(4,498,220)
FWD	01/12/2026	USD	(76,661)	MXN	1,379,129
FWD	01/12/2026	USD	1,078,000	MXN	(19,406,954)
FWD	01/12/2026	USD	(7,800,000)	MXN	140,357,880
FWD	01/12/2026	USD	216,000	MXN	(3,887,568)
FWD	01/12/2026	USD	(85,297)	MXN	1,534,976
FWD	01/12/2026	USD	19,200	MXN	(345,192)
FWD	01/13/2026	USD	(206,047)	MXN	3,705,463
FWD	01/13/2026	USD	(111,689)	MXN	2,010,543
FWD	01/13/2026	USD	(175,000,000)	MXN	3,147,550,000
FWD	01/20/2026	USD	175,000,000	MXN	(3,149,387,500)
FWD	01/13/2026	USD	175,000,000	MXN	(3,147,550,000)
FWD	01/20/2026	USD	(175,000,000)	MXN	3,149,387,500
FWD	01/13/2026	USD	50,000,000	MXN	(899,350,000)
FWD	01/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	899,875,000
FWD	01/13/2026	USD	(251,734)	MXN	4,526,088
FWD	01/13/2026	USD	(35,161)	MXN	632,047
FWD	01/13/2026	USD	(35,161)	MXN	632,259
FWD	01/13/2026	USD	(256,031)	MXN	4,603,601
FWD	01/13/2026	USD	150,000	MXN	(2,698,502)
FWD	01/13/2026	USD	8,738	MXN	(157,175)
FWD	01/13/2026	USD	(29,329)	MXN	527,256
FWD	01/13/2026	USD	19,200	MXN	(345,228)
FWD	01/14/2026	USD	(40,000,000)	MXN	717,000,000
FWD	03/17/2026	USD	40,000,000	MXN	(721,240,000)
FWD	01/14/2026	USD	30,000,000	MXN	(537,750,000)
FWD	01/14/2026	USD	106,974	MXN	(1,914,114)
FWD	01/14/2026	USD	66,945	MXN	(1,197,892)
FWD	01/14/2026	USD	330,307	MXN	(5,916,892)
FWD	01/14/2026	USD	(50,000,000)	MXN	895,650,000
FWD	01/14/2026	USD	146,671	MXN	(2,629,442)
FWD	01/21/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,792,900,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/28/2026	USD	100,072,000	MXN	(1,795,361,730)
FWD	01/15/2026	USD	992,195	MXN	(17,728,292)
FWD	01/15/2026	USD	(50,000,000)	MXN	893,000,000
FWD	02/05/2026	USD	50,000,000	MXN	(894,650,000)
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,640,340
FWD	01/15/2026	USD	1,000,000	MXN	(17,826,170)
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,681,000
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,686,000
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,686,200
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,688,200
FWD	01/15/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,683,020
FWD	01/15/2026	USD	(992,195)	MXN	17,699,598
FWD	01/15/2026	USD	158,700	MXN	(2,831,206)
FWD	01/16/2026	USD	20,000,000	MXN	(356,300,000)
FWD	01/16/2026	USD	10,000,000	MXN	(178,000,000)
FWD	01/16/2026	USD	(14,000,000)	MXN	249,200,000
FWD	01/16/2026	USD	30,000,000	MXN	(534,420,000)
FWD	01/16/2026	USD	50,000,000	MXN	(890,750,000)
FWD	02/17/2026	USD	(50,000,000)	MXN	893,300,000
FWD	01/16/2026	USD	(20,000,000)	MXN	356,300,000
FWD	01/16/2026	USD	74,400	MXN	(1,324,838)
FWD	01/14/2026	USD	5,000,000	MXN	(89,065,000)
FWD	01/15/2026	USD	(5,000,000)	MXN	89,071,250
FWD	01/15/2026	EUR	10,000,000	MXN	(207,566,060)
FWD	01/14/2026	USD	(5,000,000)	MXN	89,038,315
FWD	01/15/2026	USD	5,000,000	MXN	(89,044,815)
FWD	01/16/2026	USD	15,000,000	MXN	(267,382,500)
FWD	02/17/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,787,000,000
FWD	03/17/2026	USD	100,286,000	MXN	(1,797,074,977)
FWD	01/16/2026	USD	(655,000)	MXN	11,669,532
FWD	01/16/2026	USD	20,000,000	MXN	(356,300,000)
FWD	01/16/2026	USD	(20,000,000)	MXN	356,300,000
FWD	01/16/2026	USD	(10,000,000)	MXN	178,150,000
FWD	01/16/2026	USD	40,805	MXN	(726,681)
FWD	01/20/2026	USD	202,064,168	MXN	(3,598,762,837)
FWD	01/27/2026	USD	(202,206,168)	MXN	3,603,374,581
FWD	01/20/2026	USD	142,000	MXN	(2,520,402)
FWD	01/20/2026	USD	20,000,000	MXN	(353,100,000)
FWD	01/20/2026	USD	(20,000,000)	MXN	353,100,000
FWD	01/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	881,950,000
FWD	02/10/2026	USD	50,000,000	MXN	(883,615,000)
FWD	01/20/2026	USD	731,552	MXN	(12,919,567)
FWD	01/21/2026	USD	132,616	MXN	(2,339,752)
FWD	01/21/2026	USD	95,892	MXN	(1,692,984)
FWD	01/21/2026	USD	148,320	MXN	(2,615,416)
FWD	01/21/2026	USD	64,288	MXN	(1,130,364)
FWD	01/21/2026	USD	118,224	MXN	(2,078,420)
FWD	01/22/2026	USD	(125,000,000)	MXN	2,203,750,000
FWD	02/23/2026	USD	125,000,000	MXN	(2,210,625,000)
FWD	01/29/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,759,500,000)
FWD	02/23/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,763,860,000
FWD	01/22/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,764,000,000
FWD	01/29/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,765,150,000)
FWD	01/22/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,764,000,000)
FWD	01/29/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,765,150,000
FWD	01/22/2026	EUR	2,000,000	USD	(2,346,220)
FWD	01/22/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,195,820
FWD	01/21/2026	EUR	2,000,000	MXN	(41,308,000)
FWD	02/23/2026	EUR	(2,000,000)	MXN	41,504,800
FWD	01/22/2026	USD	95,915	MXN	(1,689,754)
FWD	01/23/2026	USD	(20,000,000)	MXN	348,640,000
FWD	01/23/2026	USD	(30,000,000)	MXN	524,580,000
FWD	03/23/2026	USD	30,000,000	MXN	(527,580,000)
FWD	01/23/2026	USD	(30,000,000)	MXN	524,580,000
FWD	03/23/2026	USD	30,000,000	MXN	(527,580,000)
FWD	01/23/2026	USD	(30,000,000)	MXN	524,490,000
FWD	01/23/2026	USD	10,000,000	MXN	(174,570,000)
FWD	01/23/2026	USD	5,000,000	MXN	(87,157,500)
FWD	01/23/2026	USD	10,000,000	MXN	(174,345,000)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/23/2026	USD	17,673	MXN	(309,220)
FWD	01/22/2026	USD	5,000,000	MXN	(87,361,240)
FWD	01/26/2026	USD	6,500	MXN	(113,748)
FWD	01/26/2026	USD	(231,586)	MXN	4,047,466
FWD	01/26/2026	USD	40,000,000	MXN	(698,920,000)
FWD	01/26/2026	USD	(30,000,000)	MXN	524,190,000
FWD	01/26/2026	USD	1,168	MXN	(20,418)
FWD	01/26/2026	USD	84,255	MXN	(1,472,085)
FWD	03/26/2026	USD	(101,573,356)	MXN	1,763,922,894
FWD	01/28/2026	USD	20,000,000	MXN	(345,880,000)
FWD	01/28/2026	USD	30,000,000	MXN	(518,820,000)
FWD	01/28/2026	USD	66,761	MXN	(1,159,800)
FWD	01/29/2026	USD	15,000,000	MXN	(259,425,000)
FWD	01/29/2026	USD	15,000,000	MXN	(259,425,000)
FWD	01/29/2026	USD	30,000,000	MXN	(518,760,000)
FWD	02/27/2026	USD	(30,000,000)	MXN	520,155,000
FWD	01/29/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,501,200
FWD	01/29/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,478,200
FWD	01/29/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,466,400
FWD	01/29/2026	USD	(449,329)	MXN	7,740,101
FWD	03/18/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,452,766
FWD	01/29/2026	USD	24,098	MXN	(413,470)
FWD	03/18/2026	USD	2,000,000	MXN	(34,518,366)
FWD	01/30/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,500,000
FWD	02/27/2026	USD	50,000,000	MXN	(863,750,000)
FWD	01/30/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,300,000
FWD	01/30/2026	USD	(50,000,000)	MXN	860,350,000
FWD	02/27/2026	USD	50,000,000	MXN	(862,600,000)
FWD	01/30/2026	USD	(245,995)	MXN	4,229,102
FWD	02/03/2026	USD	155,504	MXN	(2,681,973)
FWD	01/29/2026	USD	(8,000,000)	MXN	137,664,000
FWD	01/30/2026	USD	8,000,000	MXN	(137,676,000)
FWD	01/29/2026	USD	16,279,450	MXN	(280,413,526)
FWD	01/30/2026	USD	(16,279,450)	MXN	280,435,829
FWD	02/03/2026	USD	441,042	MXN	(7,604,451)
FWD	02/03/2026	USD	(15,000,000)	MXN	258,345,000
FWD	02/03/2026	USD	(5,000,000)	MXN	86,168,000
FWD	02/03/2026	USD	(5,000,000)	MXN	86,225,000
FWD	02/03/2026	USD	(5,000,000)	MXN	86,182,150
FWD	02/03/2026	USD	(1,269,000)	MXN	21,876,291
FWD	02/03/2026	USD	(148,187)	MXN	2,553,247
FWD	01/30/2026	USD	5,000,000	MXN	(86,134,975)
FWD	02/04/2026	USD	30,000,000	MXN	(518,790,000)
FWD	02/04/2026	USD	10,000,000	MXN	(174,192,000)
FWD	02/04/2026	USD	(10,000,000)	MXN	174,192,000
FWD	02/04/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,395,840,000
FWD	02/04/2026	USD	100,000	MXN	(1,740,717)
FWD	02/04/2026	USD	30,000,000	MXN	(522,450,000)
FWD	02/04/2026	USD	(30,000,000)	MXN	522,450,000
FWD	02/05/2026	USD	(94,617)	MXN	1,632,159
FWD	02/05/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,570,000
FWD	02/05/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,750,000
FWD	02/05/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,750,000
FWD	02/05/2026	USD	20,000,000	MXN	(345,680,000)
FWD	02/05/2026	USD	20,000,000	MXN	(345,160,000)
FWD	02/05/2026	USD	1,207,954	MXN	(20,827,929)
FWD	02/05/2026	USD	93,532	MXN	(1,611,430)
FWD	02/06/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,600,000)
FWD	02/06/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,570,000)
FWD	02/06/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,920,000
FWD	02/06/2026	USD	30,000,000	MXN	(517,650,000)
FWD	02/06/2026	USD	(30,000,000)	MXN	517,650,000
FWD	02/05/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,728,000,000
FWD	02/06/2026	USD	20,000,000	MXN	(345,980,000)
FWD	02/06/2026	USD	(20,000,000)	MXN	345,980,000
FWD	02/06/2026	USD	(30,000,000)	MXN	518,910,000
FWD	02/06/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,725,000,000
FWD	02/13/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,725,960,000)
FWD	02/06/2026	USD	(177,315)	MXN	3,072,738

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	02/06/2026	USD	(1,335,745)	MXN	23,151,319
FWD	02/06/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,733,000,000
FWD	02/13/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,733,960,000)
FWD	02/06/2026	USD	250,000,000	MXN	(4,333,750,000)
FWD	02/13/2026	USD	(250,000,000)	MXN	4,336,150,000
FWD	02/06/2026	USD	(40,000,000)	MXN	694,380,000
FWD	02/06/2026	USD	(20,000,000)	MXN	347,280,000
FWD	02/06/2026	USD	(20,000,000)	MXN	347,390,000
FWD	02/06/2026	USD	20,000,000	MXN	(347,280,000)
FWD	02/06/2026	USD	20,000,000	MXN	(347,390,000)
FWD	02/06/2026	USD	(367,933)	MXN	6,376,998
FWD	02/09/2026	USD	(50,000,000)	MXN	870,650,000
FWD	03/09/2026	USD	50,000,000	MXN	(872,725,000)
FWD	02/09/2026	USD	50,000,000	MXN	(870,650,000)
FWD	03/09/2026	USD	(50,000,000)	MXN	872,725,000
FWD	02/09/2026	USD	(5,000,000)	MXN	87,000,000
FWD	02/09/2026	USD	30,000,000	MXN	(522,168,000)
FWD	02/09/2026	USD	(30,000,000)	MXN	522,168,000
FWD	02/09/2026	USD	(15,000,000)	MXN	260,835,000
FWD	02/09/2026	USD	(2,400,000)	MXN	41,814,480
FWD	02/09/2026	USD	(375,119)	MXN	6,538,583
FWD	02/09/2026	USD	501,349	MXN	(8,743,577)
FWD	02/09/2026	USD	(15,000,000)	MXN	261,525,000
FWD	02/09/2026	USD	39,565	MXN	(691,169)
FWD	02/24/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,735,200,000
FWD	03/03/2026	USD	100,071,000	MXN	(1,737,482,738)
FWD	02/10/2026	USD	(71,842)	MXN	1,244,565
FWD	03/10/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,736,300,000
FWD	02/10/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,731,000,000
FWD	02/17/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,731,900,000)
FWD	02/10/2026	USD	(33,005)	MXN	571,763
FWD	02/10/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,731,000,000)
FWD	02/10/2026	USD	50,000,000	MXN	(864,750,000)
FWD	03/10/2026	USD	(50,000,000)	MXN	866,760,000
FWD	02/24/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,728,800,000)
FWD	02/10/2026	USD	25,000,000	MXN	(431,850,000)
FWD	02/10/2026	USD	(25,000,000)	MXN	431,850,000
FWD	02/10/2026	USD	(120,000,000)	MXN	2,078,400,000
FWD	02/10/2026	USD	80,000,000	MXN	(1,385,600,000)
FWD	02/10/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,588,475,000
FWD	02/10/2026	USD	(622,637)	MXN	10,751,272
FWD	02/10/2026	USD	223,901	MXN	(3,866,403)
FWD	02/10/2026	USD	(101,404)	MXN	1,750,618
FWD	02/11/2026	USD	(500,000)	MXN	8,581,170
FWD	02/11/2026	USD	70,000,000	MXN	(1,204,700,000)
FWD	02/11/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,204,700,000
FWD	02/11/2026	USD	(584,417)	MXN	10,052,735
FWD	02/11/2026	USD	202,954	MXN	(3,492,033)
FWD	02/12/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,150,000
FWD	03/12/2026	USD	50,000,000	MXN	(863,215,000)
FWD	02/12/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,525,000
FWD	02/13/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,723,200,000
FWD	02/26/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,725,080,000)
FWD	02/12/2026	USD	(1,023,331)	MXN	17,587,163
FWD	02/13/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,600,000
FWD	02/13/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,540,000
FWD	02/13/2026	USD	20,000,000	MXN	(344,460,000)
FWD	02/13/2026	USD	(140,000,000)	MXN	2,410,380,000
FWD	02/27/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,413,320,000)
FWD	02/13/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,410,380,000)
FWD	02/27/2026	USD	(140,000,000)	MXN	2,413,320,000
FWD	02/13/2026	USD	50,000,000	MXN	(863,000,000)
FWD	02/13/2026	USD	(50,000,000)	MXN	863,000,000
FWD	02/27/2026	USD	50,000,000	MXN	(864,055,000)
FWD	02/13/2026	USD	50,000,000	MXN	(863,000,000)
FWD	02/27/2026	USD	(50,000,000)	MXN	864,055,000
FWD	02/13/2026	USD	(50,000,000)	MXN	863,000,000
FWD	02/13/2026	USD	(30,000,000)	MXN	515,880,000
FWD	02/13/2026	USD	(17,554)	MXN	301,570

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	02/13/2026	USD	(27,510)	MXN	472,589
FWD	02/17/2026	USD	(246,110)	MXN	4,242,213
FWD	02/17/2026	USD	39,770	MXN	(685,844)
FWD	02/17/2026	USD	(212,911)	MXN	3,670,581
FWD	02/17/2026	USD	(14,464)	MXN	249,261
FWD	02/17/2026	USD	10,000,000	MXN	(172,600,000)
FWD	02/17/2026	USD	30,000,000	MXN	(517,500,000)
FWD	02/17/2026	USD	30,000,000	MXN	(517,950,000)
FWD	02/17/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,650,000
FWD	02/17/2026	USD	(50,000,000)	MXN	863,250,000
FWD	02/17/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,600,000
FWD	02/17/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,840,000
FWD	02/17/2026	USD	(30,000,000)	MXN	517,500,000
FWD	02/17/2026	USD	50,000,000	MXN	(860,750,000)
FWD	03/17/2026	USD	(50,000,000)	MXN	862,925,000
FWD	02/17/2026	USD	50,000,000	MXN	(860,500,000)
FWD	02/17/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,180,000)
FWD	03/17/2026	USD	(30,000,000)	MXN	517,485,000
FWD	02/17/2026	USD	(3,000,000)	MXN	51,648,270
FWD	02/17/2026	USD	(377,086)	MXN	6,496,296
FWD	02/18/2026	USD	216,087	MXN	(3,705,917)
FWD	02/18/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,714,200,000
FWD	02/25/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,715,300,000)
FWD	02/18/2026	USD	71,445	MXN	(1,226,704)
FWD	02/18/2026	USD	(30,090)	MXN	516,542
FWD	02/18/2026	USD	(11,362)	MXN	194,868
FWD	02/18/2026	USD	456	MXN	(7,829)
FWD	02/19/2026	USD	80,000,000	MXN	(1,376,000,000)
FWD	03/19/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,379,600,000
FWD	02/18/2026	USD	89,000,000	MXN	(1,530,800,000)
FWD	02/19/2026	USD	(89,000,000)	MXN	1,530,944,625
FWD	02/19/2026	USD	(14,024)	MXN	241,333
FWD	02/19/2026	USD	(624,923)	MXN	10,701,677
FWD	02/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	856,050,000
FWD	03/20/2026	USD	50,000,000	MXN	(858,275,000)
FWD	02/20/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,210,000)
FWD	02/20/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,210,000
FWD	02/20/2026	USD	(152,013)	MXN	2,616,742
FWD	02/23/2026	USD	(50,000,000)	MXN	864,000,000
FWD	03/23/2026	USD	50,000,000	MXN	(866,250,000)
FWD	02/23/2026	USD	(50,000,000)	MXN	864,000,000
FWD	03/23/2026	USD	50,000,000	MXN	(866,250,000)
FWD	02/23/2026	USD	(791,228)	MXN	13,667,196
FWD	02/23/2026	USD	(70,054)	MXN	1,208,647
FWD	02/23/2026	USD	(30,000,000)	MXN	517,680,000
FWD	02/23/2026	USD	(10,000,000)	MXN	172,530,000
FWD	02/23/2026	USD	(3,000,000)	MXN	51,765,000
FWD	02/23/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,519,800
FWD	02/23/2026	USD	(2,000,000)	MXN	34,528,000
FWD	02/23/2026	USD	(46,994)	MXN	811,514
FWD	02/23/2026	USD	(21,849)	MXN	377,073
FWD	02/24/2026	USD	(160,778)	MXN	2,753,479
FWD	02/25/2026	USD	(87,406)	MXN	1,506,773
FWD	02/25/2026	USD	(38,967)	MXN	672,596
FWD	02/25/2026	USD	143,270	MXN	(2,474,324)
FWD	02/25/2026	USD	(28,338)	MXN	489,301
FWD	02/25/2026	USD	238,704	MXN	(4,122,420)
FWD	02/26/2026	USD	(205,887)	MXN	3,557,398
FWD	02/26/2026	USD	(464,005)	MXN	8,016,893
FWD	02/26/2026	USD	(30,000,000)	MXN	518,460,000
FWD	02/26/2026	USD	(45,834)	MXN	789,802
FWD	02/26/2026	USD	(193,000)	MXN	3,326,259
FWD	02/26/2026	USD	(30,626)	MXN	527,276
FWD	02/26/2026	USD	(473,679)	MXN	8,147,208
FWD	02/25/2026	EUR	2,000,000	MXN	(40,567,200)
FWD	03/25/2026	EUR	(2,000,000)	MXN	40,725,800
FWD	02/26/2026	USD	(72,828)	MXN	1,252,255
FWD	02/26/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,200,000)
FWD	02/26/2026	USD	(65,573)	MXN	1,126,045

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	02/26/2026	USD	(163,000)	MXN	2,797,406
FWD	02/26/2026	USD	(145,000)	MXN	2,489,483
FWD	02/26/2026	USD	(46,793)	MXN	803,272
FWD	02/26/2026	USD	(14,176)	MXN	243,347
FWD	02/26/2026	USD	38,409	MXN	(660,236)
FWD	02/26/2026	USD	107,000	MXN	(1,837,634)
FWD	02/26/2026	USD	40,489	MXN	(695,334)
FWD	02/27/2026	USD	(70,191)	MXN	1,205,532
FWD	02/27/2026	USD	(125,395)	MXN	2,153,603
FWD	02/27/2026	USD	(123,000)	MXN	2,114,438
FWD	02/27/2026	USD	30,000,000	MXN	(515,415,000)
FWD	02/27/2026	USD	20,000,000	MXN	(343,960,000)
FWD	02/27/2026	USD	30,000,000	MXN	(515,940,000)
FWD	02/27/2026	USD	(173,989)	MXN	2,982,184
FWD	02/27/2026	USD	19,200	MXN	(329,358)
FWD	02/27/2026	USD	(206,546)	MXN	3,541,686
FWD	02/27/2026	USD	(36,465)	MXN	625,411
FWD	02/27/2026	USD	(99,945)	MXN	1,713,789
FWD	02/27/2026	USD	1,900,000	MXN	(32,591,517)
FWD	02/27/2026	USD	512,676	MXN	(8,794,880)
FWD	02/27/2026	USD	40,508	MXN	(694,836)
FWD	02/27/2026	USD	(717,000)	MXN	12,312,647
FWD	02/27/2026	USD	(200,000)	MXN	3,433,582
FWD	03/02/2026	USD	50,000,000	MXN	(859,910,000)
FWD	03/02/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,725,000)
FWD	03/02/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,725,000
FWD	03/02/2026	USD	(50,000,000)	MXN	859,910,000
FWD	03/02/2026	USD	(334,000)	MXN	5,751,797
FWD	03/02/2026	USD	334,000	MXN	(5,752,866)
FWD	03/02/2026	USD	(32,140)	MXN	553,592
FWD	03/02/2026	USD	(118,446)	MXN	2,040,979
FWD	03/02/2026	USD	(410,056)	MXN	7,067,069
FWD	03/02/2026	USD	(50,759)	MXN	875,623
FWD	03/02/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,000,000)
FWD	03/09/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,527,500
FWD	03/02/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,000,000
FWD	03/09/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,527,500)
FWD	03/02/2026	USD	(122,660)	MXN	2,118,032
FWD	03/02/2026	USD	(120,185)	MXN	2,073,954
FWD	03/02/2026	USD	39,565	MXN	(681,011)
FWD	03/02/2026	USD	(785,000)	MXN	13,506,396
FWD	03/02/2026	USD	(4,400,000)	MXN	75,700,240
FWD	03/17/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,724,500,000)
FWD	03/24/2026	USD	(100,071,000)	MXN	1,726,775,141
FWD	03/03/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,800,000)
FWD	03/03/2026	USD	50,000,000	MXN	(861,500,000)
FWD	03/03/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,723,000,000
FWD	03/03/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,625,000
FWD	03/03/2026	USD	(50,000,000)	MXN	861,800,000
FWD	03/03/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,720,700,000
FWD	03/24/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,723,890,000)
FWD	03/03/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,150,000)
FWD	03/03/2026	USD	(40,000,000)	MXN	688,200,000
FWD	03/03/2026	USD	36,737	MXN	(632,997)
FWD	03/04/2026	USD	(699,999)	MXN	12,123,218
FWD	03/02/2026	USD	(50,000,000)	MXN	865,908,150
FWD	03/03/2026	USD	50,000,000	MXN	(865,980,650)
FWD	03/02/2026	USD	50,000,000	MXN	(865,908,150)
FWD	03/03/2026	USD	(50,000,000)	MXN	865,980,650
FWD	03/04/2026	USD	484,600	MXN	(8,374,300)
FWD	03/04/2026	USD	(333,853)	MXN	5,788,024
FWD	03/04/2026	USD	380,042	MXN	(6,581,624)
FWD	03/04/2026	USD	700,000	MXN	(12,123,790)
FWD	03/27/2026	USD	98,646,574	MXN	(1,745,156,535)
FWD	03/05/2026	USD	(1,080,938)	MXN	19,074,124
FWD	03/05/2026	USD	(4,933,000)	MXN	87,092,115
FWD	03/05/2026	USD	1,189,816	MXN	(21,029,617)
FWD	03/05/2026	USD	38,950	MXN	(687,007)
FWD	03/06/2026	USD	222,450	MXN	(3,937,690)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	03/06/2026	USD	(50,000,000)	MXN	877,000,000
FWD	03/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	879,510,000
FWD	03/09/2026	USD	10,000,000	MXN	(176,480,000)
FWD	03/18/2026	USD	128,800,000	MXN	(2,268,168,000)
FWD	03/09/2026	USD	15,000,000	MXN	(266,325,000)
FWD	03/18/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,659,725,000
FWD	03/09/2026	USD	(314,855)	MXN	5,572,300
FWD	03/09/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,774,000,000)
FWD	03/17/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,775,170,000
FWD	03/09/2026	USD	20,000,000	MXN	(355,100,000)
FWD	03/09/2026	USD	50,000,000	MXN	(887,250,000)
FWD	03/17/2026	USD	(50,000,000)	MXN	887,840,000
FWD	03/09/2026	USD	(1,117,426)	MXN	19,874,714
FWD	03/09/2026	USD	80,000,000	MXN	(1,421,984,000)
FWD	03/17/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,422,880,000
FWD	03/09/2026	USD	(80,000,000)	MXN	1,421,984,000
FWD	03/17/2026	USD	80,000,000	MXN	(1,422,880,000)
FWD	03/09/2026	USD	131,676	MXN	(2,334,780)
FWD	03/10/2026	USD	10,000,000	MXN	(178,500,000)
FWD	03/10/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,667,600,000)
FWD	03/17/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,668,965,000
FWD	03/10/2026	USD	30,000,000	MXN	(533,610,000)
FWD	03/10/2026	USD	71,281	MXN	(1,267,129)
FWD	03/10/2026	USD	150,000	MXN	(2,671,343)
FWD	03/10/2026	USD	229,981	MXN	(4,094,597)
FWD	03/10/2026	USD	77,900	MXN	(1,387,771)
FWD	03/10/2026	USD	149,792	MXN	(2,665,712)
FWD	03/11/2026	USD	10,000,000	MXN	(178,050,000)
FWD	03/11/2026	USD	10,000,000	MXN	(178,080,000)
FWD	03/11/2026	USD	15,000,000	MXN	(267,075,000)
FWD	03/11/2026	USD	5,000,000	MXN	(89,052,500)
FWD	03/10/2026	USD	5,000,000	MXN	(88,314,800)
FWD	03/12/2026	USD	10,000,000	MXN	(174,800,000)
FWD	03/12/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,625,450,000
FWD	03/12/2026	USD	(17,698)	MXN	310,741
FWD	03/12/2026	USD	475,000	MXN	(8,346,776)
FWD	03/12/2026	USD	(17,656)	MXN	310,178
FWD	03/12/2026	USD	841,000	MXN	(14,797,479)
FWD	03/12/2026	USD	763,000	MXN	(13,419,324)
FWD	03/12/2026	USD	300,000	MXN	(5,277,558)
FWD	03/12/2026	USD	544,000	MXN	(9,567,225)
FWD	03/12/2026	USD	556,856	MXN	(9,795,587)
FWD	03/12/2026	USD	600,000	MXN	(10,564,086)
FWD	03/12/2026	USD	(364,025)	MXN	6,412,162
FWD	03/12/2026	USD	1,717	MXN	(30,221)
FWD	03/12/2026	USD	(11,000,000)	MXN	193,474,820
FWD	03/12/2026	USD	(288,970)	MXN	5,083,897
FWD	03/18/2026	USD	(99,900,585)	MXN	1,763,445,126
FWD	03/13/2026	USD	(30,000,000)	MXN	529,440,000
FWD	03/13/2026	USD	30,000,000	MXN	(529,440,000)
FWD	03/13/2026	USD	(15,000,000)	MXN	264,750,000
FWD	03/17/2026	USD	50,000,000	MXN	(892,750,000)
FWD	03/17/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,678,250,000)
FWD	03/17/2026	USD	(30,000,000)	MXN	535,305,000
FWD	03/17/2026	USD	(10,000,000)	MXN	178,250,000
FWD	03/17/2026	USD	(10,000,000)	MXN	178,240,000
FWD	03/17/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,691,200
FWD	03/18/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,777,200,000)
FWD	03/18/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,253,770,000
FWD	03/18/2026	USD	(15,000,000)	MXN	268,800,000
FWD	03/18/2026	USD	(15,000,000)	MXN	268,920,000
FWD	03/18/2026	USD	(20,000,000)	MXN	357,800,000
FWD	03/18/2026	USD	(26,846)	MXN	482,259
FWD	03/18/2026	USD	40,180	MXN	(722,032)
FWD	03/19/2026	USD	198,804	MXN	(3,502,022)
FWD	03/19/2026	USD	(40,000,000)	MXN	707,800,000
FWD	03/19/2026	USD	53,000,000	MXN	(937,835,000)
FWD	03/19/2026	USD	(40,000,000)	MXN	708,400,000
FWD	03/19/2026	USD	(10,000,000)	MXN	177,250,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	03/19/2026	USD	(10,000,000)	MXN	177,100,000
FWD	03/19/2026	USD	(30,000,000)	MXN	530,910,000
FWD	03/19/2026	USD	(10,000,000)	MXN	176,970,000
FWD	03/19/2026	USD	(5,000,000)	MXN	88,271,500
FWD	03/19/2026	USD	(162,158)	MXN	2,862,566
FWD	03/26/2026	USD	95,541,669	MXN	(1,695,673,535)
FWD	03/20/2026	USD	2,000,000	MXN	(35,436,200)
FWD	03/20/2026	USD	1,982,257	MXN	(35,133,622)
FWD	03/20/2026	USD	(10,000,000)	MXN	176,950,000
FWD	03/20/2026	USD	(5,000,000)	MXN	88,450,000
FWD	03/20/2026	USD	(35,000,000)	MXN	619,745,000
FWD	03/20/2026	USD	(35,000,000)	MXN	619,850,000
FWD	03/20/2026	USD	(35,000,000)	MXN	618,905,000
FWD	03/20/2026	USD	(30,000,000)	MXN	529,590,000
FWD	03/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	882,900,000
FWD	03/20/2026	USD	(10,000,000)	MXN	176,610,000
FWD	03/23/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,249,850,000
FWD	03/23/2026	USD	(10,000,000)	MXN	179,120,000
FWD	03/23/2026	USD	(2,000,000)	MXN	35,580,800
FWD	03/23/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,780,830
FWD	03/23/2026	USD	25,000,000	MXN	(443,250,000)
FWD	03/23/2026	USD	(434,041)	MXN	7,700,735
FWD	03/24/2026	USD	(15,000,000)	MXN	267,975,000
FWD	03/24/2026	USD	335,072	MXN	(6,006,400)
FWD	03/25/2026	USD	(15,000,000)	MXN	265,590,000
FWD	03/25/2026	USD	(10,000,000)	MXN	177,100,000
FWD	03/25/2026	USD	319,873	MXN	(5,680,684)
FWD	03/25/2026	USD	(200,000)	MXN	3,555,154
FWD	03/25/2026	USD	333,774	MXN	(5,937,582)
FWD	03/26/2026	USD	(280,000)	MXN	4,979,814
FWD	03/26/2026	USD	500,000	MXN	(8,893,825)
FWD	03/26/2026	USD	500,000	MXN	(8,895,775)
FWD	03/26/2026	USD	128,069	MXN	(2,278,559)
FWD	03/26/2026	USD	(180,781)	MXN	3,212,718
FWD	03/26/2026	USD	(295,755)	MXN	5,265,187
FWD	03/27/2026	USD	(20,000,000)	MXN	355,120,000
FWD	03/27/2026	USD	30,000,000	MXN	(532,020,000)
FWD	03/27/2026	USD	149,313	MXN	(2,654,250)
FWD	03/26/2026	USD	(19,000,000)	MXN	338,608,254
FWD	03/30/2026	USD	50,000,000	MXN	(890,460,000)
FWD	03/27/2026	USD	(1,700,000)	MXN	30,323,325
FWD	03/30/2026	USD	(300,000)	MXN	5,351,880
FWD	03/30/2026	USD	(10,000,000)	MXN	178,900,000
FWD	03/30/2026	USD	50,000,000	MXN	(895,000,000)
FWD	03/30/2026	USD	483,759	MXN	(8,676,073)
FWD	03/30/2026	USD	(274,000)	MXN	4,917,889
FWD	03/30/2026	USD	10,000,000	MXN	(178,950,000)
FWD	03/30/2026	USD	20,000	MXN	(358,674)
FWD	03/31/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,808,000,000)
FWD	03/31/2026	USD	993,673	MXN	(17,951,797)
FWD	03/31/2026	USD	(221,463)	MXN	3,998,331
FWD	03/31/2026	USD	158,000	MXN	(2,863,632)
FWD	03/31/2026	USD	(200,000)	MXN	3,604,163
FWD	03/31/2026	USD	100,000	MXN	(1,803,019)
FWD	01/08/2026	USD	(260,000)	MXN	5,559,580
FWD	02/12/2026	USD	(2,600,000)	MXN	54,243,800
FWD	02/12/2026	USD	(260,000)	MXN	5,424,380
FWD	01/21/2026	USD	(1,634,308)	MXN	34,571,988
FWD	02/18/2026	USD	(300,892)	MXN	6,365,039
FWD	01/21/2026	USD	(298,419)	MXN	6,312,726
FWD	02/18/2026	USD	(1,228,441)	MXN	25,986,318
FWD	02/18/2026	USD	(687,312)	MXN	14,477,952
FWD	01/21/2026	USD	(691,430)	MXN	14,564,696
FWD	02/20/2026	USD	(25,000,000)	MXN	533,350,000
FWD	02/18/2026	USD	(687,500)	MXN	14,463,144
FWD	01/21/2026	USD	(766,000)	MXN	16,114,572
FWD	02/18/2026	USD	(980,000)	MXN	20,616,554
FWD	01/21/2026	USD	(1,032,000)	MXN	21,710,494
FWD	02/18/2026	USD	(280,000)	MXN	5,890,444

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/21/2026	USD	(331,000)	MXN	6,963,346
FWD	01/21/2026	USD	(175,000)	MXN	3,681,528
FWD	02/18/2026	USD	(325,500)	MXN	6,847,641
FWD	01/21/2026	USD	(325,500)	MXN	6,847,641
FWD	02/18/2026	USD	(211,000)	MXN	4,438,870
FWD	01/21/2026	USD	(215,000)	MXN	4,523,020
FWD	02/18/2026	USD	(175,500)	MXN	3,692,046
FWD	02/26/2026	USD	(14,000,000)	MXN	300,090,000
FWD	02/26/2026	USD	(25,000,000)	MXN	535,275,000
FWD	02/26/2026	USD	(200,000)	MXN	4,280,600
FWD	03/13/2026	USD	(50,000,000)	MXN	1,041,050,000
FWD	03/12/2026	USD	(2,800,000)	MXN	58,366,000
FWD	03/12/2026	USD	(700,000)	MXN	14,591,500
FWD	03/24/2026	USD	(15,430,581)	MXN	325,000,000
FWD	03/27/2026	USD	(17,000,000)	MXN	360,842,000
FWD	03/11/2026	USD	(400,000)	MXN	7,756,440
FWD	02/11/2026	USD	(400,000)	MXN	7,756,440
FWD	01/14/2026	USD	(650,000)	MXN	12,604,215
FWD	02/11/2026	USD	(150,000)	MXN	2,918,850
FWD	01/14/2026	USD	(250,000)	MXN	4,864,750
FWD	03/11/2026	USD	(625,000)	MXN	12,241,625
FWD	02/11/2026	USD	(675,000)	MXN	13,220,955
FWD	01/14/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,586,600
FWD	03/11/2026	USD	(800,000)	MXN	15,348,000
FWD	02/11/2026	USD	(850,000)	MXN	16,307,250
FWD	01/14/2026	USD	(1,400,000)	MXN	26,859,000
FWD	02/25/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,152,600)
FWD	02/11/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,152,600)
FWD	01/28/2026	USD	1,250,000	MXN	(23,940,750)
FWD	01/13/2026	USD	2,000,000	MXN	(38,305,200)
FWD	03/11/2026	USD	2,750,000	MXN	(52,669,650)
FWD	01/16/2026	USD	(500,000)	MXN	9,499,750
FWD	02/06/2026	USD	(641,169)	MXN	12,416,236
FWD	01/09/2026	USD	(250,000)	MXN	4,834,575
FWD	02/13/2026	USD	(250,000)	MXN	4,834,575
FWD	03/13/2026	USD	(250,000)	MXN	4,834,575
FWD	01/08/2026	USD	20,000,000	MXN	(382,840,000)
FWD	01/16/2026	USD	(23,581)	MXN	450,161
FWD	01/09/2026	USD	(23,581)	MXN	449,777
FWD	01/16/2026	USD	(23,360)	MXN	445,942
FWD	01/09/2026	USD	(23,360)	MXN	445,562
FWD	03/11/2026	USD	(1,250,000)	MXN	24,020,500
FWD	02/11/2026	USD	(1,375,000)	MXN	26,422,550
FWD	01/28/2026	USD	(375,000)	MXN	7,206,150
FWD	01/14/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,216,400
FWD	01/30/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,235,000
FWD	03/25/2026	USD	(575,000)	MXN	11,153,505
FWD	02/25/2026	USD	(850,000)	MXN	16,487,790
FWD	01/28/2026	USD	(250,000)	MXN	4,849,350
FWD	01/09/2026	USD	500,000	MXN	(9,542,500)
FWD	03/25/2026	USD	(200,000)	MXN	3,841,380
FWD	01/22/2026	USD	(46,448,000)	MXN	879,678,672
FWD	03/11/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	02/25/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	02/11/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	01/28/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	01/13/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	03/27/2026	USD	3,000,000	MXN	(57,502,500)
FWD	01/28/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,201,800
FWD	03/18/2026	USD	(400,000)	MXN	7,720,360
FWD	03/18/2026	USD	(115,000)	MXN	2,219,604
FWD	03/18/2026	USD	(300,000)	MXN	5,790,270
FWD	02/18/2026	USD	(500,000)	MXN	9,650,450
FWD	02/18/2026	USD	(130,000)	MXN	2,509,117
FWD	02/18/2026	USD	(350,000)	MXN	6,755,315
FWD	01/21/2026	USD	(450,000)	MXN	8,685,405
FWD	01/21/2026	USD	(120,000)	MXN	2,316,108
FWD	01/21/2026	USD	(300,000)	MXN	5,790,270
FWD	01/26/2026	USD	(100,000)	MXN	1,893,590

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/20/2026	USD	(100,000)	MXN	1,893,590
FWD	01/12/2026	USD	(100,000)	MXN	1,893,590
FWD	01/05/2026	USD	(100,000)	MXN	1,893,590
FWD	02/20/2026	USD	(250,000)	MXN	4,773,275
FWD	03/20/2026	USD	(250,000)	MXN	4,773,275
FWD	01/12/2026	USD	(500,000)	MXN	9,419,000
FWD	01/12/2026	USD	(600,000)	MXN	11,290,800
FWD	01/26/2026	USD	(200,000)	MXN	3,711,580
FWD	01/20/2026	USD	(200,000)	MXN	3,711,580
FWD	01/12/2026	USD	(200,000)	MXN	3,711,580
FWD	01/05/2026	USD	(200,000)	MXN	3,711,580
FWD	01/05/2026	USD	25,000,000	MXN	(462,787,500)
FWD	03/27/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	03/20/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	03/13/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	03/06/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	02/27/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	02/20/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	02/13/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	02/06/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	01/30/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	01/23/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	01/16/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	01/09/2026	USD	167,000	MXN	(3,111,995)
FWD	03/03/2026	USD	(33,592)	MXN	631,960
FWD	01/06/2026	USD	(32,977)	MXN	620,390
FWD	03/17/2026	USD	(600,000)	MXN	11,231,400
FWD	03/26/2026	USD	(287,000)	MXN	5,366,757
FWD	03/19/2026	USD	(287,000)	MXN	5,362,882
FWD	03/12/2026	USD	(287,000)	MXN	5,359,008
FWD	03/05/2026	USD	(287,000)	MXN	5,355,133
FWD	02/26/2026	USD	(278,000)	MXN	5,183,171
FWD	02/19/2026	USD	(278,000)	MXN	5,179,001
FWD	02/12/2026	USD	(278,000)	MXN	5,174,831
FWD	02/05/2026	USD	(278,000)	MXN	5,170,522
FWD	01/29/2026	USD	(330,000)	MXN	6,132,885
FWD	01/22/2026	USD	(330,000)	MXN	6,128,100
FWD	01/15/2026	USD	(330,000)	MXN	6,123,315
FWD	01/08/2026	USD	(330,000)	MXN	6,118,530
FWD	03/10/2026	USD	(800,000)	MXN	14,935,200
FWD	02/10/2026	USD	(800,000)	MXN	14,890,400
FWD	01/09/2026	USD	(800,000)	MXN	14,838,000
FWD	02/05/2026	USD	50,000	MXN	(927,690)
FWD	01/29/2026	USD	50,000	MXN	(927,690)
FWD	01/22/2026	USD	50,000	MXN	(927,690)
FWD	01/15/2026	USD	50,000	MXN	(927,690)
FWD	01/08/2026	USD	50,000	MXN	(927,690)
FWD	03/30/2026	USD	(1,021,261)	MXN	19,141,495
FWD	01/05/2026	USD	(25,000,000)	MXN	463,975,000
FWD	03/27/2026	USD	(750,000)	MXN	14,033,625
FWD	03/20/2026	USD	(750,000)	MXN	14,021,625
FWD	02/27/2026	USD	(750,000)	MXN	13,989,750
FWD	02/13/2026	USD	(750,000)	MXN	13,968,000
FWD	01/30/2026	USD	(700,000)	MXN	13,016,850
FWD	01/23/2026	USD	(700,000)	MXN	13,006,350
FWD	01/07/2026	USD	(44,912)	MXN	838,278
FWD	01/14/2026	USD	(44,912)	MXN	838,907
FWD	01/21/2026	USD	(44,912)	MXN	839,540
FWD	01/28/2026	USD	(44,912)	MXN	840,178
FWD	02/04/2026	USD	(44,912)	MXN	840,811
FWD	02/11/2026	USD	(44,912)	MXN	841,673
FWD	02/18/2026	USD	(44,912)	MXN	842,307
FWD	02/25/2026	USD	(44,912)	MXN	842,940
FWD	03/04/2026	USD	(44,912)	MXN	844,027
FWD	03/11/2026	USD	(44,912)	MXN	844,660
FWD	03/18/2026	USD	(44,912)	MXN	845,289
FWD	03/25/2026	USD	(44,912)	MXN	845,931
FWD	01/16/2026	USD	(650,000)	MXN	12,102,935
FWD	03/24/2026	USD	(1,400,000)	MXN	25,984,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	03/09/2026	USD	(1,400,000)	MXN	25,984,000
FWD	02/24/2026	USD	(1,960,000)	MXN	36,377,600
FWD	02/09/2026	USD	(1,960,000)	MXN	36,377,600
FWD	01/23/2026	USD	(3,140,000)	MXN	58,278,400
FWD	01/09/2026	USD	(3,140,000)	MXN	58,278,400
FWD	02/12/2026	USD	(300,000)	MXN	5,603,160
FWD	01/08/2026	USD	(300,000)	MXN	5,581,650
FWD	03/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	03/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	03/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	03/06/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	02/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	02/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	02/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	02/06/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	01/30/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	01/23/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	01/16/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	01/09/2026	USD	67,000	MXN	(1,254,307)
FWD	02/26/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	02/19/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	02/12/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	02/05/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	01/29/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	01/22/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	01/15/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	01/08/2026	USD	25,000	MXN	(467,273)
FWD	03/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	03/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	03/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	03/06/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	02/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	02/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	02/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	02/06/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	01/30/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	01/23/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	01/16/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	01/09/2026	USD	67,000	MXN	(1,259,305)
FWD	01/08/2026	USD	100,000	MXN	(1,881,170)
FWD	01/16/2026	USD	(80,000)	MXN	1,500,800
FWD	02/23/2026	USD	(100,000)	MXN	1,859,770
FWD	02/17/2026	USD	(100,000)	MXN	1,859,770
FWD	02/09/2026	USD	(100,000)	MXN	1,859,770
FWD	02/03/2026	USD	(100,000)	MXN	1,859,770
FWD	03/27/2026	USD	(100,000)	MXN	1,867,600
FWD	03/20/2026	USD	(100,000)	MXN	1,866,200
FWD	03/13/2026	USD	(100,000)	MXN	1,864,850
FWD	03/06/2026	USD	(100,000)	MXN	1,863,400
FWD	02/27/2026	USD	(50,000)	MXN	931,025
FWD	02/20/2026	USD	(50,000)	MXN	930,350
FWD	02/13/2026	USD	(50,000)	MXN	929,665
FWD	02/06/2026	USD	(50,000)	MXN	928,800
FWD	01/23/2026	USD	(80,000)	MXN	1,478,800
FWD	01/05/2026	USD	(40,000)	MXN	737,460
FWD	01/12/2026	USD	(40,000)	MXN	738,000
FWD	01/20/2026	USD	(40,000)	MXN	738,620
FWD	01/26/2026	USD	(40,000)	MXN	739,080
FWD	01/08/2026	USD	(1,000,000)	MXN	18,388,600
FWD	01/07/2026	USD	(50,000,000)	MXN	921,680,000
FWD	02/26/2026	USD	(310,000)	MXN	5,771,115
FWD	01/07/2026	EUR	(65,000,000)	USD	75,452,000
FWD	01/16/2026	USD	(50,000)	MXN	923,800
FWD	01/21/2026	USD	(17,600)	MXN	325,283
FWD	01/21/2026	USD	(17,600)	MXN	325,283
FWD	01/07/2026	USD	(18,400)	MXN	339,498
FWD	01/14/2026	USD	(18,400)	MXN	339,756
FWD	01/21/2026	USD	(18,400)	MXN	340,014
FWD	01/07/2026	USD	(18,400)	MXN	339,498

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/07/2026	USD	(46,300)	MXN	854,559
FWD	01/22/2026	USD	(50,000)	MXN	923,900
FWD	01/15/2026	USD	(50,000)	MXN	923,215
FWD	01/08/2026	USD	(50,000)	MXN	922,530
FWD	01/29/2026	USD	(50,000)	MXN	924,585
FWD	02/05/2026	USD	(100,000)	MXN	1,841,600
FWD	01/08/2026	USD	(1,000,000)	MXN	18,355,800
FWD	01/07/2026	USD	(17,200)	MXN	316,437
FWD	01/23/2026	USD	(80,000)	MXN	1,472,800
FWD	01/15/2026	USD	(134,784)	MXN	2,473,691
FWD	01/08/2026	USD	(72,561)	MXN	1,332,133
FWD	01/22/2026	USD	(72,561)	MXN	1,334,121
FWD	01/07/2026	USD	(17,600)	MXN	323,594
FWD	02/10/2026	USD	(68,223)	MXN	1,256,975
FWD	02/26/2026	USD	(68,223)	MXN	1,259,131
FWD	03/26/2026	USD	(74,999)	MXN	1,388,509
FWD	03/10/2026	USD	(74,999)	MXN	1,386,072
FWD	03/25/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	03/18/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	03/11/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	03/04/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	02/25/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	02/18/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	02/11/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	02/04/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	01/28/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	01/21/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	01/14/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	01/07/2026	USD	(40,000)	MXN	737,384
FWD	01/15/2026	USD	(1,000,000)	MXN	18,316,600
FWD	03/02/2026	USD	(2,186,300)	MXN	40,221,525
FWD	03/30/2026	USD	(100,000)	MXN	1,840,290
FWD	03/23/2026	USD	(100,000)	MXN	1,840,290
FWD	03/17/2026	USD	(100,000)	MXN	1,840,290
FWD	03/09/2026	USD	(100,000)	MXN	1,840,290
FWD	03/02/2026	USD	(100,000)	MXN	1,840,290
FWD	03/06/2026	USD	(500,000)	MXN	9,276,900
FWD	02/06/2026	USD	(500,000)	MXN	9,249,550
FWD	01/09/2026	USD	(250,000)	MXN	4,610,950
FWD	03/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	110,220,000
FWD	02/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,902,000
FWD	01/21/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,557,600
FWD	02/18/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	02/11/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	02/04/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	01/28/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	01/21/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	01/14/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	01/07/2026	USD	(116,500)	MXN	2,130,832
FWD	02/18/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	02/11/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	02/04/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	01/28/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	01/21/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	01/14/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	01/07/2026	USD	(1,293,000)	MXN	23,649,487
FWD	02/18/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	02/11/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	02/04/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	01/28/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	01/21/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	01/14/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	01/07/2026	USD	(21,500)	MXN	393,244
FWD	02/18/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	02/11/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	02/04/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	01/28/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	01/21/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	01/14/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/07/2026	USD	(69,000)	MXN	1,262,038
FWD	01/07/2026	USD	(214,085)	MXN	3,911,975
FWD	03/25/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	03/18/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	03/11/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	03/04/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	02/25/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	02/18/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	02/11/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	02/04/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	01/28/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	01/21/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	01/14/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	01/07/2026	USD	(15,000)	MXN	275,088
FWD	01/07/2026	USD	(52,500)	MXN	959,569
FWD	02/13/2026	USD	(250,000)	MXN	4,576,175
FWD	02/12/2026	USD	(250,000)	MXN	4,575,675
FWD	02/10/2026	USD	(250,000)	MXN	4,574,700
FWD	01/08/2026	USD	(20,100)	MXN	369,076
FWD	01/15/2026	USD	(750,000)	MXN	13,692,750
FWD	01/22/2026	USD	(750,000)	MXN	13,702,950
FWD	01/06/2026	USD	(42,500)	MXN	776,747
FWD	01/13/2026	USD	(37,500)	MXN	685,868
FWD	01/15/2026	USD	(37,500)	MXN	686,018
FWD	01/20/2026	USD	(37,500)	MXN	686,389
FWD	01/29/2026	USD	(37,500)	MXN	687,064
FWD	02/12/2026	USD	(60,000)	MXN	1,100,976
FWD	03/10/2026	USD	(25,000)	MXN	460,015
FWD	03/12/2026	USD	(25,000)	MXN	460,115
FWD	03/17/2026	USD	(25,000)	MXN	460,373
FWD	03/24/2026	USD	(25,000)	MXN	460,730
FWD	01/22/2026	USD	(37,500)	MXN	686,539
FWD	01/27/2026	USD	(37,500)	MXN	686,914
FWD	01/15/2026	USD	(750,000)	MXN	13,671,150
FWD	03/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,680,000
FWD	02/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,356,000
FWD	01/21/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,026,000
FWD	01/06/2026	USD	(42,500)	MXN	773,424
FWD	01/13/2026	USD	(37,500)	MXN	682,924
FWD	01/15/2026	USD	(37,500)	MXN	683,066
FWD	01/20/2026	USD	(37,500)	MXN	683,430
FWD	01/22/2026	USD	(37,500)	MXN	683,576
FWD	01/27/2026	USD	(37,500)	MXN	683,940
FWD	01/29/2026	USD	(37,500)	MXN	684,086
FWD	02/12/2026	USD	(60,000)	MXN	1,096,176
FWD	03/10/2026	USD	(25,000)	MXN	458,013
FWD	03/12/2026	USD	(25,000)	MXN	458,113
FWD	03/17/2026	USD	(25,000)	MXN	458,358
FWD	03/24/2026	USD	(25,000)	MXN	458,713
FWD	01/15/2026	USD	(500,000)	MXN	9,066,400
FWD	01/22/2026	USD	(500,000)	MXN	9,073,150
FWD	03/10/2026	USD	(1,336,621)	MXN	24,305,793
FWD	03/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	109,126,800
FWD	02/18/2026	USD	(6,000,000)	MXN	108,802,200
FWD	01/21/2026	USD	(6,000,000)	MXN	108,475,200
FWD	02/13/2026	USD	(100,000)	MXN	1,811,300
FWD	01/09/2026	USD	(200,000)	MXN	3,613,560
FWD	01/14/2026	USD	(101,650)	MXN	1,836,612
FWD	01/21/2026	USD	(44,650)	MXN	807,227
FWD	03/23/2026	USD	(40,000)	MXN	729,200
FWD	03/17/2026	USD	(40,000)	MXN	728,700
FWD	03/09/2026	USD	(40,000)	MXN	728,080
FWD	03/02/2026	USD	(40,000)	MXN	727,528
FWD	02/23/2026	USD	(40,000)	MXN	726,980
FWD	02/17/2026	USD	(40,000)	MXN	726,500
FWD	02/09/2026	USD	(40,000)	MXN	725,880
FWD	02/03/2026	USD	(40,000)	MXN	725,420
FWD	01/26/2026	USD	(40,000)	MXN	724,792
FWD	01/20/2026	USD	(40,000)	MXN	724,320

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/12/2026	USD	(40,000)	MXN	723,720
FWD	01/05/2026	USD	(40,000)	MXN	723,200
FWD	02/06/2026	USD	(1,188,339)	MXN	21,435,255
FWD	03/17/2026	USD	(1,292,937)	MXN	23,418,328
FWD	02/27/2026	USD	(112,971)	MXN	2,042,563
FWD	01/14/2026	USD	(47,438)	MXN	856,398
FWD	01/07/2026	USD	(45,510)	MXN	821,005
FWD	01/07/2026	USD	(47,560)	MXN	857,987
FWD	01/07/2026	USD	(18,600)	MXN	335,546
FWD	01/07/2026	USD	(18,600)	MXN	335,546
FWD	01/07/2026	USD	(16,800)	MXN	303,074
FWD	01/07/2026	USD	(16,800)	MXN	303,074
FWD	01/07/2026	USD	(48,380)	MXN	872,780
FWD	01/07/2026	USD	(48,380)	MXN	872,780
FWD	01/07/2026	USD	(48,380)	MXN	872,780
FWD	01/07/2026	USD	(48,380)	MXN	872,780
FWD	01/07/2026	USD	(48,380)	MXN	872,780
FWD	03/13/2026	USD	(2,152,833)	MXN	39,148,184
FWD	01/15/2026	USD	(163,608)	MXN	2,957,624
FWD	01/23/2026	USD	(500,000)	MXN	9,049,300
FWD	02/17/2026	USD	(23,000,000)	MXN	416,990,000
FWD	03/20/2026	USD	(800,000)	MXN	14,554,320
FWD	02/20/2026	USD	(600,000)	MXN	10,915,740
FWD	01/23/2026	USD	(500,000)	MXN	9,096,450
FWD	02/13/2026	USD	(1,919,055)	MXN	34,727,034
FWD	03/17/2026	USD	(733,009)	MXN	13,309,236
FWD	03/13/2026	USD	(388,153)	MXN	7,045,373
FWD	03/18/2026	USD	(2,000,000)	MXN	36,410,800
FWD	02/18/2026	USD	(2,000,000)	MXN	36,295,600
FWD	01/21/2026	USD	(2,000,000)	MXN	36,180,600
FWD	02/17/2026	USD	(100,000)	MXN	1,811,500
FWD	01/21/2026	USD	(5,000,000)	MXN	90,308,000
FWD	03/06/2026	USD	(100,000)	MXN	1,816,800
FWD	03/26/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	03/19/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	03/12/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	03/05/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	02/26/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	02/19/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	02/12/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	02/05/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	01/29/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	01/22/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	01/15/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	01/08/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)
FWD	01/12/2026	USD	140,000	MXN	(2,520,980)
FWD	01/12/2026	USD	120,000	MXN	(2,160,840)
FWD	01/12/2026	USD	183,000	MXN	(3,295,281)
FWD	01/12/2026	USD	166,000	MXN	(2,989,162)
FWD	01/12/2026	USD	148,000	MXN	(2,665,036)
FWD	01/12/2026	USD	183,000	MXN	(3,299,906)
FWD	01/30/2026	USD	(250,000)	MXN	4,521,750
FWD	01/14/2026	USD	(49,610)	MXN	895,411
FWD	01/14/2026	USD	(45,510)	MXN	821,410
FWD	01/14/2026	USD	(47,970)	MXN	865,811
FWD	01/14/2026	USD	(47,970)	MXN	865,811
FWD	01/14/2026	USD	(38,000)	MXN	685,862
FWD	01/14/2026	USD	(38,000)	MXN	685,862
FWD	01/07/2026	USD	(44,760)	MXN	807,247
FWD	01/07/2026	USD	(44,760)	MXN	807,247
FWD	01/20/2026	USD	158,000	MXN	(2,834,836)
FWD	01/20/2026	USD	140,000	MXN	(2,511,880)
FWD	01/20/2026	USD	183,000	MXN	(3,283,386)
FWD	01/20/2026	USD	148,000	MXN	(2,655,416)
FWD	01/20/2026	USD	166,000	MXN	(2,978,372)
FWD	01/20/2026	USD	183,000	MXN	(3,283,386)
FWD	01/28/2026	USD	(68,400)	MXN	1,233,731
FWD	01/21/2026	USD	(52,697)	MXN	949,757
FWD	02/06/2026	USD	(250,000)	MXN	4,509,875

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD	01/07/2026	USD	(17,600)	MXN	315,832
FWD	01/07/2026	USD	(47,970)	MXN	859,862
FWD	01/07/2026	USD	(45,100)	MXN	808,418
FWD	01/07/2026	USD	(45,100)	MXN	808,418
FWD	02/03/2026	USD	(35,361)	MXN	635,968
FWD	03/02/2026	USD	(35,361)	MXN	637,673
FWD	01/07/2026	USD	(40,795)	MXN	731,658
FWD	01/07/2026	USD	(40,795)	MXN	731,658
FWD	01/07/2026	USD	(45,920)	MXN	823,575
FWD	01/07/2026	USD	(45,920)	MXN	823,575
FWD	01/07/2026	USD	(45,920)	MXN	823,575
FWD	01/07/2026	USD	(45,920)	MXN	823,575
FWD	01/06/2026	USD	(40,000,000)	MXN	718,204,000
FWD	02/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,713,200
FWD	01/22/2026	USD	183,000	MXN	(3,288,876)
FWD	01/23/2026	USD	183,000	MXN	(3,288,876)
FWD	01/23/2026	USD	140,000	MXN	(2,516,080)
FWD	01/21/2026	USD	152,000	MXN	(2,731,744)
FWD	03/27/2026	USD	(504,453)	MXN	9,150,024
FWD	01/14/2026	USD	(40,590)	MXN	731,265
FWD	01/14/2026	USD	(40,590)	MXN	731,265
FWD	01/14/2026	USD	(40,590)	MXN	731,265
FWD	01/14/2026	USD	(35,644)	MXN	642,159
FWD	01/14/2026	USD	(35,644)	MXN	642,159
FWD	01/14/2026	USD	(35,644)	MXN	642,159
FWD	01/14/2026	USD	(35,712)	MXN	643,384
FWD	02/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,716,350
FWD	02/23/2026	USD	(50,000)	MXN	902,450
FWD	02/17/2026	USD	(50,000)	MXN	902,450
FWD	02/09/2026	USD	(50,000)	MXN	902,450
FWD	02/03/2026	USD	(50,000)	MXN	902,450
FWD	03/30/2026	USD	(2,222,411)	MXN	40,353,431
FWD	02/27/2026	USD	(1,089,872)	MXN	19,726,132
FWD	01/26/2026	USD	863,000	MXN	(15,538,488)
FWD	02/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,719,725
FWD	02/17/2026	USD	(1,000,000)	MXN	18,045,700
FWD	01/15/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,980,400
FWD	02/20/2026	USD	(50,000)	MXN	900,250
FWD	01/02/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,890,000
FWD	01/15/2026	USD	1,000,000	MXN	(17,920,000)
FWD	03/02/2026	USD	(1,670,135)	MXN	30,081,637
FWD	01/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,983,500
FWD	02/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,707,575
FWD	01/21/2026	USD	(38,904)	MXN	699,455
FWD	01/21/2026	USD	(38,904)	MXN	699,455
FWD	01/21/2026	USD	(38,904)	MXN	699,455
FWD	01/21/2026	USD	(38,904)	MXN	699,455
FWD	02/04/2026	USD	(15,990)	MXN	287,518
FWD	02/04/2026	USD	(15,990)	MXN	287,518
FWD	02/20/2026	USD	(150,000)	MXN	2,704,050
FWD	01/05/2026	USD	125,000	MXN	(2,236,250)
FWD	01/05/2026	USD	(10,000)	MXN	183,581
FWD	01/13/2026	USD	(40,000)	MXN	734,524
FWD	01/21/2026	USD	(38,130)	MXN	684,891
FWD	01/21/2026	USD	(38,130)	MXN	684,891
FWD	01/05/2026	USD	300,000	MXN	(5,627,040)
SPOT	01/07/2026	EUR	65,000,000	USD	(75,985,000)
SPOT	02/20/2026	USD	(150,000)	MXN	2,711,475
SPOT	02/26/2026	USD	(137,000)	MXN	2,479,097
SPOT	03/26/2026	USD	(180,000)	MXN	3,266,406
SPOT	01/21/2026	USD	(42,435)	MXN	764,424
SPOT	01/21/2026	USD	(38,130)	MXN	686,874
SPOT	01/21/2026	USD	(81,480)	MXN	1,467,781
SPOT	02/20/2026	USD	(150,000)	MXN	2,713,200
SPOT	01/08/2026	USD	(100,000)	MXN	1,797,500
SPOT	01/07/2026	USD	200,000	MXN	(3,740,900)
SPOT	01/29/2026	USD	178,000	MXN	(3,199,906)
SPOT	02/03/2026	USD	521,000	MXN	(9,366,017)
SPOT	01/28/2026	USD	(52,610)	MXN	949,058

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/04/2026	USD	(127,125)	MXN	2,294,988
SPOT	02/27/2026	USD	(150,000)	MXN	2,715,900
SPOT	01/30/2026	USD	(250,000)	MXN	4,583,750
SPOT	01/08/2026	USD	50,000	MXN	(895,650)
SPOT	02/11/2026	USD	(70,300)	MXN	1,270,251
SPOT	01/28/2026	USD	(19,200)	MXN	346,499
SPOT	01/13/2026	USD	20,000,000	MXN	(360,000,000)
SPOT	01/29/2026	USD	(20,000,000)	MXN	360,546,000
SPOT	01/21/2026	USD	(1,000,000)	MXN	18,004,700
SPOT	02/03/2026	USD	139,000	MXN	(2,502,375)
SPOT	02/05/2026	USD	178,000	MXN	(3,204,481)
SPOT	02/03/2026	USD	178,000	MXN	(3,204,481)
SPOT	01/09/2026	USD	125,000	MXN	(2,246,250)
SPOT	01/09/2026	USD	(600,000)	MXN	10,994,910
SPOT	01/09/2026	USD	(200,000)	MXN	3,672,950
SPOT	01/09/2026	USD	(130,000)	MXN	2,387,255
SPOT	01/15/2026	USD	(120,000)	MXN	2,204,040
SPOT	02/27/2026	USD	(150,000)	MXN	2,715,600
SPOT	01/28/2026	USD	(19,200)	MXN	346,426
SPOT	01/23/2026	USD	(550,000)	MXN	9,875,250
SPOT	01/21/2026	USD	(1,500,000)	MXN	26,904,450
SPOT	02/27/2026	USD	(150,000)	MXN	2,703,075
SPOT	03/11/2026	USD	(969,126)	MXN	17,455,413
SPOT	02/11/2026	USD	(70,000)	MXN	1,260,350
SPOT	01/28/2026	USD	(38,335)	MXN	689,302
SPOT	01/28/2026	USD	(38,335)	MXN	689,302
SPOT	02/27/2026	USD	(150,000)	MXN	2,695,950
SPOT	01/21/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,914,300
SPOT	03/06/2026	USD	(611,468)	MXN	10,951,692
SPOT	01/23/2026	USD	(200,000)	MXN	3,571,860
SPOT	01/13/2026	USD	(50,000)	MXN	933,350
SPOT	02/18/2026	USD	(64,800)	MXN	1,161,799
SPOT	02/18/2026	USD	(39,200)	MXN	702,817
SPOT	02/18/2026	USD	(39,200)	MXN	702,817
SPOT	02/18/2026	USD	(39,200)	MXN	702,817
SPOT	02/18/2026	USD	(39,200)	MXN	702,817
SPOT	01/28/2026	USD	(38,130)	MXN	682,260
SPOT	01/28/2026	USD	(66,400)	MXN	1,188,095
SPOT	01/28/2026	USD	(66,400)	MXN	1,188,095
SPOT	01/28/2026	USD	(36,464)	MXN	652,450
SPOT	01/28/2026	USD	(36,464)	MXN	652,450
SPOT	01/28/2026	USD	(36,464)	MXN	652,450
SPOT	01/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,797,650
SPOT	01/29/2026	USD	(240,000)	MXN	4,292,904
SPOT	01/28/2026	USD	(240,000)	MXN	4,292,520
SPOT	01/27/2026	USD	(240,000)	MXN	4,292,112
SPOT	01/26/2026	USD	(240,000)	MXN	4,291,728
SPOT	02/11/2026	USD	(37,200)	MXN	665,582
SPOT	02/11/2026	USD	(37,200)	MXN	665,582
SPOT	03/26/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	03/19/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	03/12/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	03/05/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	02/26/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	02/19/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	02/12/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	02/05/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	01/29/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	01/22/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
SPOT	01/14/2026	USD	(150,000)	MXN	2,781,000
SPOT	01/14/2026	USD	(150,000)	MXN	2,777,550
SPOT	01/14/2026	USD	(100,000)	MXN	1,866,700
SPOT	01/14/2026	USD	200,000	MXN	(3,715,000)
SPOT	02/09/2026	USD	147,000	MXN	(2,619,834)
SPOT	02/09/2026	USD	178,000	MXN	(3,172,316)
SPOT	02/09/2026	USD	44,000	MXN	(784,168)
SPOT	02/11/2026	USD	(79,450)	MXN	1,422,155
SPOT	02/26/2026	USD	(250,000)	MXN	4,465,300
SPOT	03/12/2026	USD	(250,000)	MXN	4,471,525

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/05/2026	USD	(250,000)	MXN	4,468,425
SPOT	02/19/2026	USD	(250,000)	MXN	4,462,200
SPOT	02/12/2026	USD	(250,000)	MXN	4,459,225
SPOT	02/05/2026	USD	(250,000)	MXN	4,456,250
SPOT	02/20/2026	USD	(240,000)	MXN	4,287,600
SPOT	02/19/2026	USD	(240,000)	MXN	4,287,192
SPOT	02/18/2026	USD	(240,000)	MXN	4,286,784
SPOT	02/17/2026	USD	(480,000)	MXN	8,572,752
SPOT	03/12/2026	USD	(250,000)	MXN	4,439,200
SPOT	03/05/2026	USD	(250,000)	MXN	4,436,075
SPOT	02/26/2026	USD	(250,000)	MXN	4,432,975
SPOT	02/19/2026	USD	(250,000)	MXN	4,429,875
SPOT	02/13/2026	USD	(20,000)	MXN	354,700
SPOT	01/15/2026	USD	200,000	MXN	(3,713,200)
SPOT	01/20/2026	USD	(45,000)	MXN	810,000
SPOT	03/13/2026	USD	(500,000)	MXN	8,882,500
SPOT	01/21/2026	USD	(100,000)	MXN	1,800,000
SPOT	01/23/2026	USD	(200,000)	MXN	3,667,520
SPOT	01/16/2026	USD	(400,000)	MXN	7,333,440
SPOT	02/04/2026	USD	(38,540)	MXN	682,698
SPOT	02/04/2026	USD	(38,950)	MXN	689,960
SPOT	01/28/2026	USD	(18,400)	MXN	325,719
SPOT	02/04/2026	USD	(37,080)	MXN	656,205
SPOT	02/04/2026	USD	(37,080)	MXN	656,205
SPOT	02/04/2026	USD	(37,080)	MXN	656,205
SPOT	02/04/2026	USD	(37,080)	MXN	656,205
SPOT	02/18/2026	USD	(53,900)	MXN	956,105
SPOT	02/25/2026	USD	(35,100)	MXN	623,007
SPOT	02/04/2026	USD	(200,000)	MXN	3,526,260
SPOT	02/13/2026	USD	139,000	MXN	(2,446,539)
SPOT	02/13/2026	USD	179,000	MXN	(3,150,579)
SPOT	02/04/2026	USD	(39,408)	MXN	695,197
SPOT	02/04/2026	USD	(39,408)	MXN	695,197
SPOT	02/04/2026	USD	(39,408)	MXN	695,197
SPOT	03/20/2026	USD	(250,000)	MXN	4,439,250
SPOT	03/13/2026	USD	(2,759,842)	MXN	48,817,468
SPOT	03/30/2026	USD	(25,743)	MXN	457,624
SPOT	03/23/2026	USD	(25,743)	MXN	457,300
SPOT	03/17/2026	USD	(25,743)	MXN	457,027
SPOT	03/09/2026	USD	(25,743)	MXN	456,664
SPOT	03/02/2026	USD	(25,743)	MXN	456,345
SPOT	02/23/2026	USD	(25,743)	MXN	456,026
SPOT	02/17/2026	USD	(25,743)	MXN	455,755
SPOT	02/09/2026	USD	(25,743)	MXN	455,392
SPOT	02/03/2026	USD	(25,743)	MXN	455,122
SPOT	02/03/2026	USD	(18,515)	MXN	327,336
SPOT	02/09/2026	USD	(18,515)	MXN	327,530
SPOT	02/17/2026	USD	(18,515)	MXN	327,791
SPOT	02/23/2026	USD	(18,515)	MXN	327,986
SPOT	03/02/2026	USD	(18,515)	MXN	328,215
SPOT	03/09/2026	USD	(18,515)	MXN	328,445
SPOT	03/17/2026	USD	(18,515)	MXN	328,706
SPOT	03/23/2026	USD	(18,515)	MXN	328,902
SPOT	03/30/2026	USD	(18,515)	MXN	329,136
SPOT	02/27/2026	USD	(103,156)	MXN	1,809,350
SPOT	02/18/2026	USD	(800,000)	MXN	14,017,040
SPOT	02/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,807,450
SPOT	01/21/2026	USD	(950,000)	MXN	18,909,750
SPOT	01/23/2026	USD	950,000	MXN	(18,909,750)
SPOT	02/05/2026	USD	(500,000)	MXN	8,808,950
SPOT	02/26/2026	USD	(400,000)	MXN	7,019,200
SPOT	01/23/2026	USD	(70,000)	MXN	1,260,000
SPOT	01/21/2026	USD	400,000	MXN	(7,224,800)
SPOT	01/21/2026	USD	200,000	MXN	(3,649,800)
SPOT	01/21/2026	USD	(250,000)	MXN	4,530,550
SPOT	02/17/2026	USD	325,000	MXN	(5,684,250)
SPOT	03/20/2026	USD	(1,175,583)	MXN	20,673,214
SPOT	02/04/2026	USD	(18,400)	MXN	322,938
SPOT	03/23/2026	USD	(1,137,763)	MXN	19,996,754

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/20/2026	USD	(139,178)	MXN	2,438,461
SPOT	03/20/2026	USD	(319,228)	MXN	5,608,194
SPOT	01/26/2026	USD	(320,000)	MXN	5,760,000
SPOT	01/22/2026	USD	50,000	MXN	(870,000)
SPOT	02/04/2026	USD	(42,845)	MXN	750,859
SPOT	02/04/2026	USD	(41,410)	MXN	725,710
SPOT	01/28/2026	USD	25,000,000	MXN	(437,125,000)
SPOT	02/04/2026	USD	(25,000,000)	MXN	437,400,000
SPOT	01/27/2026	USD	(65,000)	MXN	1,170,000
SPOT	01/23/2026	USD	250,000	MXN	(4,976,250)
SPOT	03/18/2026	USD	(250,000)	MXN	5,005,450
SPOT	03/20/2026	USD	(2,032,784)	MXN	35,521,892
SPOT	03/05/2026	USD	254,018	MXN	(4,426,434)
SPOT	02/05/2026	USD	224,254	MXN	(3,897,781)
SPOT	01/23/2026	USD	(65,000)	MXN	1,188,463
SPOT	02/09/2026	USD	(185,000)	MXN	3,384,908
SPOT	03/27/2026	USD	(300,000)	MXN	5,258,100
SPOT	02/25/2026	USD	(1,650,000)	MXN	28,872,855
SPOT	02/11/2026	USD	(39,660)	MXN	691,512
SPOT	02/11/2026	USD	(39,660)	MXN	691,512
SPOT	02/11/2026	USD	(39,660)	MXN	691,512
SPOT	02/04/2026	USD	(20,500)	MXN	357,192
SPOT	02/04/2026	USD	(41,410)	MXN	721,528
SPOT	03/05/2026	USD	590,323	MXN	(10,286,783)
SPOT	03/05/2026	USD	590,323	MXN	(10,286,783)
SPOT	02/05/2026	USD	520,590	MXN	(9,048,420)
SPOT	02/05/2026	USD	578,433	MXN	(10,053,800)
SPOT	02/25/2026	USD	(81,000)	MXN	1,413,936
SPOT	03/04/2026	USD	(69,350)	MXN	1,211,406
SPOT	03/19/2026	USD	(500,000)	MXN	8,728,450
SPOT	03/19/2026	USD	(250,000)	MXN	4,363,350
SPOT	02/20/2026	USD	319,000	MXN	(5,521,890)
SPOT	03/25/2026	USD	(168,103)	MXN	2,940,626
SPOT	02/25/2026	USD	(21,600)	MXN	376,769
SPOT	02/27/2026	USD	100,000	MXN	(1,762,630)
SPOT	03/20/2026	USD	(777,090)	MXN	13,465,023
SPOT	02/04/2026	USD	(41,410)	MXN	715,565
SPOT	03/26/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	03/19/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	03/12/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	03/05/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	02/26/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	02/19/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	02/12/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
SPOT	03/26/2026	USD	(287,000)	MXN	4,981,402
SPOT	03/19/2026	USD	(287,000)	MXN	4,977,929
SPOT	03/12/2026	USD	(287,000)	MXN	4,974,456
SPOT	03/05/2026	USD	(287,000)	MXN	4,970,984
SPOT	02/26/2026	USD	(278,000)	MXN	4,811,763
SPOT	02/19/2026	USD	(278,000)	MXN	4,808,455
SPOT	02/12/2026	USD	(278,000)	MXN	4,805,174
SPOT	02/05/2026	USD	(278,000)	MXN	4,801,922
SPOT	02/05/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,235,000
SPOT	02/23/2026	USD	601,000	MXN	(10,361,240)
SPOT	02/18/2026	USD	(40,180)	MXN	695,194
SPOT	02/18/2026	USD	(39,975)	MXN	691,647
SPOT	03/18/2026	USD	(156,000)	MXN	2,749,094
SPOT	02/18/2026	USD	(144,000)	MXN	2,537,626
SPOT	03/06/2026	USD	(62,920)	MXN	1,087,371
SPOT	01/30/2026	USD	300,000	MXN	(5,971,500)
SPOT	02/06/2026	USD	(300,000)	MXN	5,984,190
SPOT	01/29/2026	USD	(650,000)	MXN	12,938,250
SPOT	01/30/2026	USD	650,000	MXN	(12,938,250)
SPOT	01/30/2026	USD	(104,000)	MXN	1,919,664
SPOT	02/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,602,100
SPOT	02/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,594,600
SPOT	02/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,589,600
SPOT	02/12/2026	USD	(500,000)	MXN	8,582,100
SPOT	01/29/2026	USD	(5,220,418)	MXN	90,000,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/13/2026	USD	5,213,251	MXN	(90,000,000)
SPOT	01/30/2026	USD	650,000	MXN	(12,938,250)
SPOT	02/23/2026	USD	(650,000)	MXN	12,982,385
SPOT	01/29/2026	USD	(650,000)	MXN	12,938,250
SPOT	01/30/2026	USD	650,000	MXN	(12,938,250)
SPOT	02/18/2026	USD	(18,400)	MXN	318,559
SPOT	01/29/2026	USD	(180,000)	MXN	3,219,894
SPOT	01/30/2026	USD	(60,000)	MXN	1,073,328
SPOT	03/25/2026	USD	(73,600)	MXN	1,275,562
SPOT	03/25/2026	USD	(73,600)	MXN	1,275,562
SPOT	03/25/2026	USD	(20,800)	MXN	360,485
SPOT	03/25/2026	USD	(20,800)	MXN	360,485
SPOT	02/25/2026	USD	(68,800)	MXN	1,189,139
SPOT	02/25/2026	USD	(68,800)	MXN	1,189,139
SPOT	02/25/2026	USD	(68,800)	MXN	1,189,139
SPOT	02/25/2026	USD	(68,800)	MXN	1,189,139
SPOT	01/29/2026	USD	50,000	MXN	(859,385)
SPOT	02/23/2026	USD	530,000	MXN	(9,229,950)
SPOT	01/30/2026	USD	(200,000)	MXN	3,667,080
SPOT	02/03/2026	USD	(400,000)	MXN	7,334,760
SPOT	03/27/2026	USD	(1,181,531)	MXN	20,689,201
SPOT	02/18/2026	USD	178,000	MXN	(3,109,660)
SPOT	02/17/2026	USD	178,000	MXN	(3,109,660)
SPOT	02/18/2026	USD	(39,948)	MXN	692,379
SPOT	02/18/2026	USD	(39,948)	MXN	692,379
SPOT	02/18/2026	USD	(39,948)	MXN	692,379
SPOT	02/18/2026	USD	(39,948)	MXN	692,379
SPOT	02/18/2026	USD	(41,820)	MXN	724,824
SPOT	02/18/2026	USD	(39,360)	MXN	682,188
SPOT	03/18/2026	USD	(239,000)	MXN	4,214,741
SPOT	02/18/2026	USD	(218,500)	MXN	3,853,226
SPOT	02/03/2026	USD	(1,100,000)	MXN	18,942,000
SPOT	02/13/2026	USD	1,100,000	MXN	(18,951,900)
SPOT	03/18/2026	USD	(595,000)	MXN	10,426,483
SPOT	03/18/2026	USD	(68,000)	MXN	1,191,598
SPOT	02/18/2026	USD	(582,000)	MXN	10,198,677
SPOT	02/18/2026	USD	(67,500)	MXN	1,182,836
SPOT	03/18/2026	USD	(1,176,000)	MXN	20,613,869
SPOT	03/18/2026	USD	(97,000)	MXN	1,700,294
SPOT	03/18/2026	USD	(28,000)	MXN	490,806
SPOT	02/18/2026	USD	(1,232,000)	MXN	21,595,482
SPOT	02/18/2026	USD	(114,000)	MXN	1,998,283
SPOT	02/18/2026	USD	(36,600)	MXN	641,554
SPOT	02/03/2026	USD	(70,000)	MXN	1,283,681
SPOT	02/04/2026	USD	(530,000)	MXN	9,719,564
SPOT	03/17/2026	USD	(125,000)	MXN	2,169,638
SPOT	03/02/2026	USD	(125,000)	MXN	2,166,600
SPOT	02/17/2026	USD	(110,000)	MXN	1,904,375
SPOT	03/31/2026	USD	(778,815)	MXN	13,502,705
SPOT	02/25/2026	USD	(40,590)	MXN	701,801
SPOT	02/25/2026	USD	(40,590)	MXN	701,801
SPOT	02/25/2026	USD	(40,590)	MXN	701,801
SPOT	02/05/2026	USD	25,000,000	MXN	(432,375,000)
SPOT	02/12/2026	USD	(25,000,000)	MXN	432,627,500
SPOT	02/04/2026	USD	200,000	MXN	(3,612,100)
SPOT	03/25/2026	USD	(145,000)	MXN	2,530,265
SPOT	03/18/2026	USD	(29,930)	MXN	521,934
SPOT	03/11/2026	USD	(155,000)	MXN	2,701,185
SPOT	03/27/2026	USD	(180,000)	MXN	3,147,858
SPOT	03/20/2026	USD	(180,000)	MXN	3,145,806
SPOT	03/13/2026	USD	(180,000)	MXN	3,143,754
SPOT	03/06/2026	USD	(180,000)	MXN	3,141,738
SPOT	02/27/2026	USD	(180,000)	MXN	3,139,758
SPOT	02/20/2026	USD	(180,000)	MXN	3,137,814
SPOT	02/13/2026	USD	(180,000)	MXN	3,135,978
SPOT	02/25/2026	USD	(39,565)	MXN	692,498
SPOT	03/04/2026	USD	185,000	MXN	(3,220,850)
SPOT	02/27/2026	USD	751,000	MXN	(13,074,910)
SPOT	02/25/2026	USD	185,000	MXN	(3,220,850)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/19/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,314,800
SPOT	02/19/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,304,800
SPOT	03/18/2026	USD	(720,000)	MXN	12,717,000
SPOT	03/18/2026	USD	(55,500)	MXN	980,269
SPOT	03/18/2026	USD	(642,000)	MXN	11,339,325
SPOT	03/18/2026	USD	(879,500)	MXN	15,534,169
SPOT	02/06/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,905,000)
SPOT	02/06/2026	USD	150,000	MXN	(2,985,750)
SPOT	03/18/2026	USD	(150,000)	MXN	2,999,160
SPOT	02/25/2026	USD	(19,200)	MXN	332,671
SPOT	02/06/2026	USD	300,000	MXN	(5,386,050)
SPOT	02/25/2026	USD	(40,180)	MXN	696,203
SPOT	02/25/2026	USD	(39,604)	MXN	685,387
SPOT	02/25/2026	USD	(39,604)	MXN	685,387
SPOT	02/25/2026	USD	(39,604)	MXN	685,387
SPOT	02/25/2026	USD	(39,604)	MXN	685,387
SPOT	02/09/2026	USD	500,000	MXN	(8,609,150)
SPOT	03/05/2026	USD	(14,554,026)	MXN	250,848,834
SPOT	03/31/2026	USD	(300,000)	MXN	5,201,670
SPOT	02/19/2026	USD	(200,000)	MXN	3,444,300
SPOT	03/04/2026	USD	(19,200)	MXN	331,308
SPOT	02/20/2026	USD	(200,000)	MXN	3,444,740
SPOT	02/23/2026	USD	(200,000)	MXN	3,445,760
SPOT	03/04/2026	USD	(39,770)	MXN	686,390
SPOT	03/04/2026	USD	(39,770)	MXN	686,390
SPOT	03/04/2026	USD	(39,770)	MXN	686,390
SPOT	03/04/2026	USD	(39,770)	MXN	686,390
SPOT	02/25/2026	USD	(38,860)	MXN	670,335
SPOT	02/25/2026	USD	(38,860)	MXN	670,335
SPOT	02/25/2026	USD	(38,860)	MXN	670,335
SPOT	02/10/2026	USD	300,000	MXN	(5,394,450)
SPOT	02/10/2026	USD	(130,000)	MXN	2,379,000
SPOT	02/11/2026	USD	(120,000)	MXN	2,196,096
SPOT	03/11/2026	USD	(41,200)	MXN	710,700
SPOT	03/11/2026	USD	(41,200)	MXN	710,700
SPOT	03/11/2026	USD	(41,200)	MXN	710,700
SPOT	03/11/2026	USD	(41,200)	MXN	710,700
SPOT	02/25/2026	USD	(77,200)	MXN	1,329,770
SPOT	02/25/2026	USD	(56,800)	MXN	978,380
SPOT	03/19/2026	USD	(500,000)	MXN	8,611,900
SPOT	03/19/2026	USD	(500,000)	MXN	8,602,650
SPOT	02/11/2026	USD	300,000	MXN	(5,340,900)
SPOT	02/27/2026	USD	(200,000)	MXN	3,434,540
SPOT	03/04/2026	USD	(103,050)	MXN	1,778,385
SPOT	03/11/2026	USD	(167,050)	MXN	2,884,786
SPOT	02/25/2026	USD	(28,100)	MXN	484,613
SPOT	03/18/2026	USD	(150,000)	MXN	2,629,095
SPOT	03/18/2026	USD	(1,000,000)	MXN	17,527,300
SPOT	02/13/2026	USD	4,986,615	MXN	(85,685,000)
SPOT	03/13/2026	USD	(6,627,391)	MXN	114,182,000
SPOT	02/24/2026	USD	(200,000)	MXN	3,430,740
SPOT	02/27/2026	USD	(200,000)	MXN	3,431,420
SPOT	03/02/2026	USD	(200,000)	MXN	3,432,660
SPOT	02/13/2026	USD	250,000	MXN	(4,277,500)
SPOT	03/04/2026	USD	(39,770)	MXN	687,981
SPOT	02/12/2026	USD	50,000	MXN	(859,000)
SPOT	03/11/2026	USD	(20,400)	MXN	352,410
SPOT	03/04/2026	USD	(40,180)	MXN	693,386
SPOT	03/06/2026	USD	239,000	MXN	(4,117,970)
SPOT	02/13/2026	USD	250,000	MXN	(4,976,250)
SPOT	02/19/2026	USD	(250,000)	MXN	4,979,775
SPOT	02/13/2026	USD	750,000	MXN	(14,928,750)
SPOT	02/17/2026	USD	(750,000)	MXN	14,937,000
SPOT	02/13/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,905,000)
SPOT	02/16/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,915,100
SPOT	02/13/2026	USD	150,000	MXN	(2,985,750)
SPOT	03/18/2026	USD	(150,000)	MXN	2,998,035
SPOT	03/25/2026	USD	(1,293,000)	MXN	22,312,525
SPOT	03/25/2026	USD	(116,500)	MXN	2,010,371

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/25/2026	USD	(21,500)	MXN	371,013
SPOT	03/25/2026	USD	(69,000)	MXN	1,190,692
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,171,613
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,171,613
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,171,613
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,171,613
SPOT	03/18/2026	USD	(21,600)	MXN	371,917
SPOT	02/25/2026	USD	(27,200)	MXN	467,481
SPOT	02/25/2026	USD	(61,200)	MXN	1,051,832
SPOT	02/25/2026	USD	(38,400)	MXN	659,973
SPOT	02/25/2026	USD	(74,000)	MXN	1,272,134
SPOT	02/16/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,915,100)
SPOT	03/02/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,967,200
SPOT	03/11/2026	USD	(39,770)	MXN	685,321
SPOT	03/11/2026	USD	(39,770)	MXN	685,321
SPOT	03/11/2026	USD	(39,770)	MXN	685,321
SPOT	03/11/2026	USD	(39,770)	MXN	685,321
SPOT	03/04/2026	USD	(39,152)	MXN	673,923
SPOT	03/04/2026	USD	(39,152)	MXN	673,923
SPOT	03/04/2026	USD	(39,152)	MXN	673,923
SPOT	03/12/2026	USD	320,000	MXN	(5,500,800)
SPOT	02/17/2026	USD	(477,400)	MXN	8,455,757
SPOT	02/17/2026	USD	(500,000)	MXN	9,952,500
SPOT	02/20/2026	USD	500,000	MXN	(9,952,500)
SPOT	03/02/2026	USD	(200,000)	MXN	3,429,600
SPOT	03/03/2026	USD	(200,000)	MXN	3,429,740
SPOT	03/05/2026	USD	(200,000)	MXN	3,430,980
SPOT	03/11/2026	USD	(39,770)	MXN	683,746
SPOT	02/25/2026	USD	(41,200)	MXN	707,062
SPOT	02/25/2026	USD	(15,600)	MXN	267,723
SPOT	02/25/2026	USD	(15,600)	MXN	267,723
SPOT	02/27/2026	EUR	(144,039)	MXN	2,921,810
SPOT	02/25/2026	EUR	(65,833)	MXN	1,334,359
SPOT	03/11/2026	USD	(115,000)	MXN	2,237,785
SPOT	02/25/2026	USD	(35,000)	MXN	680,551
SPOT	02/18/2026	USD	750,000	MXN	(12,897,000)
SPOT	03/13/2026	USD	334,000	MXN	(5,744,800)
SPOT	02/20/2026	USD	25,000,000	MXN	(431,750,000)
SPOT	03/11/2026	USD	136,000	MXN	(2,339,200)
SPOT	03/11/2026	USD	197,000	MXN	(3,388,400)
SPOT	03/11/2026	USD	184,000	MXN	(3,164,800)
SPOT	03/06/2026	USD	184,000	MXN	(3,164,800)
SPOT	03/06/2026	USD	197,000	MXN	(3,388,400)
SPOT	03/06/2026	USD	146,000	MXN	(2,511,200)
SPOT	03/26/2026	USD	50,000	MXN	(864,885)
SPOT	03/19/2026	USD	50,000	MXN	(864,885)
SPOT	03/12/2026	USD	50,000	MXN	(864,885)
SPOT	03/05/2026	USD	50,000	MXN	(864,885)
SPOT	02/19/2026	USD	(26,000,000)	MXN	449,020,000
SPOT	02/26/2026	USD	26,000,000	MXN	(449,290,400)
SPOT	02/20/2026	USD	250,000	MXN	(4,306,250)
SPOT	03/25/2026	USD	(42,230)	MXN	733,155
SPOT	03/11/2026	USD	(40,180)	MXN	696,319
SPOT	02/25/2026	USD	(42,230)	MXN	730,706
SPOT	03/02/2026	USD	(2,000)	MXN	34,371
SPOT	02/20/2026	USD	500,000	MXN	(9,952,500)
SPOT	02/24/2026	USD	(500,000)	MXN	9,957,950
SPOT	02/20/2026	USD	100,000	MXN	(1,990,500)
SPOT	03/18/2026	USD	(100,000)	MXN	1,997,680
SPOT	02/20/2026	USD	200,000	MXN	(3,515,800)
SPOT	03/11/2026	USD	(38,896)	MXN	668,078
SPOT	03/11/2026	USD	(38,896)	MXN	668,078
SPOT	03/11/2026	USD	(38,896)	MXN	668,078
SPOT	03/11/2026	USD	(38,896)	MXN	668,078
SPOT	03/18/2026	USD	185,000	MXN	(3,182,000)
SPOT	03/17/2026	USD	198,000	MXN	(3,405,600)
SPOT	03/17/2026	USD	184,000	MXN	(3,164,800)
SPOT	02/26/2026	USD	25,000,000	MXN	(431,875,000)
SPOT	02/26/2026	USD	14,000,000	MXN	(241,850,000)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/19/2026	USD	136,000	MXN	(2,344,640)
SPOT	03/18/2026	USD	(39,388)	MXN	682,594
SPOT	03/18/2026	USD	(39,388)	MXN	682,594
SPOT	03/18/2026	USD	(39,388)	MXN	682,594
SPOT	03/18/2026	USD	(40,180)	MXN	696,319
SPOT	03/18/2026	USD	(40,180)	MXN	696,319
SPOT	03/18/2026	USD	(40,180)	MXN	696,319
SPOT	03/18/2026	USD	(27,000)	MXN	471,863
SPOT	03/18/2026	USD	(94,500)	MXN	1,651,520
SPOT	03/18/2026	USD	(639,500)	MXN	11,176,158
SPOT	02/24/2026	USD	(200,000)	MXN	3,457,300
SPOT	03/18/2026	USD	(19,200)	MXN	330,989
SPOT	03/18/2026	USD	(20,800)	MXN	358,571
SPOT	02/24/2026	USD	200,000	MXN	(3,522,600)
SPOT	03/18/2026	USD	(40,180)	MXN	692,462
SPOT	03/25/2026	USD	(19,200)	MXN	330,624
SPOT	02/25/2026	USD	(130,000)	MXN	2,247,661
SPOT	02/27/2026	USD	(70,000)	MXN	1,210,349
SPOT	02/25/2026	USD	(200,000)	MXN	3,457,680
SPOT	02/25/2026	USD	300,000	MXN	(5,236,800)
SPOT	03/25/2026	USD	(300,000)	MXN	5,175,000
SPOT	03/20/2026	USD	150,000	MXN	(2,581,500)
SPOT	03/20/2026	USD	184,000	MXN	(3,166,640)
SPOT	03/18/2026	USD	(39,565)	MXN	682,892
SPOT	02/26/2026	USD	(180,000)	MXN	3,134,862
SPOT	03/11/2026	USD	(91,400)	MXN	1,576,193
SPOT	03/18/2026	USD	(169,300)	MXN	2,921,272
SPOT	03/25/2026	USD	(128,200)	MXN	2,213,617
SPOT	02/27/2026	USD	100,000	MXN	(1,990,500)
SPOT	03/27/2026	USD	(100,000)	MXN	1,997,760
SPOT	02/27/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,905,000)
SPOT	02/27/2026	USD	1,000,000	MXN	(19,905,000)
SPOT	02/27/2026	USD	(45,000)	MXN	783,749
SPOT	03/02/2026	USD	(175,000)	MXN	3,048,220
SPOT	03/18/2026	USD	(39,770)	MXN	687,146
SPOT	03/23/2026	USD	517,000	MXN	(8,913,080)
SPOT	03/02/2026	USD	700,000	MXN	(12,103,000)
SPOT	03/02/2026	USD	(500,000)	MXN	8,665,000
SPOT	03/13/2026	USD	500,000	MXN	(8,670,000)
SPOT	03/25/2026	USD	(29,200)	MXN	507,452
SPOT	03/25/2026	USD	(29,200)	MXN	507,452
SPOT	03/25/2026	USD	(60,800)	MXN	1,056,613
SPOT	03/25/2026	USD	(60,800)	MXN	1,056,613
SPOT	03/25/2026	USD	(60,800)	MXN	1,056,613
SPOT	03/25/2026	USD	(60,800)	MXN	1,056,613
SPOT	03/02/2026	USD	(150,000)	MXN	2,663,325
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	676,717
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	676,717
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	676,717
SPOT	03/18/2026	USD	(37,748)	MXN	655,419
SPOT	03/18/2026	USD	(37,748)	MXN	655,419
SPOT	03/18/2026	USD	(37,748)	MXN	655,419
SPOT	03/18/2026	USD	(37,748)	MXN	655,419
SPOT	03/18/2026	USD	(37,400)	MXN	649,376
SPOT	03/18/2026	USD	(37,400)	MXN	649,376
SPOT	03/18/2026	USD	(37,400)	MXN	649,376
SPOT	03/02/2026	USD	(700,000)	MXN	14,857,150
SPOT	03/25/2026	USD	186,000	MXN	(3,230,820)
SPOT	03/25/2026	USD	168,000	MXN	(2,918,160)
SPOT	03/25/2026	USD	186,000	MXN	(3,230,820)
SPOT	03/04/2026	USD	200,000	MXN	(3,595,760)
SPOT	03/25/2026	USD	200,000	MXN	(3,595,760)
SPOT	03/18/2026	USD	200,000	MXN	(3,595,760)
SPOT	03/11/2026	USD	200,000	MXN	(3,595,760)
SPOT	03/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,186,269)
SPOT	03/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,186,269)
SPOT	03/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,186,269)
SPOT	03/03/2026	USD	(300,000)	MXN	5,226,390
SPOT	03/27/2026	USD	67,000	MXN	(1,188,480)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/20/2026	USD	67,000	MXN	(1,188,480)
SPOT	03/13/2026	USD	67,000	MXN	(1,188,480)
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	688,870
SPOT	03/27/2026	USD	(570,000)	MXN	10,115,220
SPOT	03/17/2026	USD	(160,000)	MXN	2,836,800
SPOT	03/27/2026	USD	(50,000)	MXN	890,150
SPOT	03/20/2026	USD	(50,000)	MXN	890,150
SPOT	03/04/2026	USD	(150,000)	MXN	2,613,435
SPOT	03/05/2026	USD	(100,000)	MXN	1,742,340
SPOT	03/06/2026	USD	50,000,000	MXN	(879,500,000)
SPOT	03/13/2026	USD	(50,000,000)	MXN	880,045,000
SPOT	03/05/2026	USD	50,000	MXN	(883,500)
SPOT	03/05/2026	USD	(115,000)	MXN	2,003,829
SPOT	03/06/2026	USD	(135,000)	MXN	2,352,389
SPOT	03/25/2026	USD	(39,770)	MXN	707,934
SPOT	03/10/2026	USD	(50,000,000)	MXN	895,000,000
SPOT	03/17/2026	USD	50,000,000	MXN	(895,490,000)
SPOT	03/06/2026	USD	200,000	MXN	(3,981,000)
SPOT	03/18/2026	USD	(200,000)	MXN	3,987,120
SPOT	03/31/2026	USD	100,000	MXN	(1,786,010)
SPOT	03/06/2026	USD	100,000	MXN	(1,990,500)
SPOT	03/17/2026	USD	(100,000)	MXN	1,993,310
SPOT	03/06/2026	USD	200,000	MXN	(3,981,000)
SPOT	03/31/2026	USD	(200,000)	MXN	3,992,900
SPOT	03/06/2026	USD	1,100,000	MXN	(21,895,500)
SPOT	03/23/2026	USD	(1,100,000)	MXN	21,950,610
SPOT	03/06/2026	USD	400,000	MXN	(7,962,000)
SPOT	03/09/2026	USD	(400,000)	MXN	7,966,800
SPOT	03/06/2026	USD	(150,000)	MXN	2,656,155
SPOT	03/25/2026	USD	(39,900)	MXN	711,816
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,213,120
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,213,120
SPOT	03/25/2026	USD	(68,000)	MXN	1,213,120
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	696,192
SPOT	03/25/2026	USD	(38,950)	MXN	696,192
SPOT	03/25/2026	USD	(37,448)	MXN	668,671
SPOT	03/25/2026	USD	(37,448)	MXN	668,671
SPOT	03/25/2026	USD	(37,448)	MXN	668,671
SPOT	03/25/2026	USD	(37,448)	MXN	668,671
SPOT	03/30/2026	USD	168,000	MXN	(2,993,760)
SPOT	03/30/2026	USD	186,000	MXN	(3,314,520)
SPOT	03/27/2026	USD	164,000	MXN	(2,922,480)
SPOT	03/27/2026	USD	190,000	MXN	(3,385,800)
SPOT	03/23/2026	USD	(6,075)	MXN	108,369
SPOT	03/11/2026	USD	(600,000)	MXN	10,335,900
SPOT	03/25/2026	USD	(38,588)	MXN	683,123
SPOT	03/25/2026	USD	(38,588)	MXN	683,123
SPOT	03/25/2026	USD	(38,588)	MXN	683,123
SPOT	03/25/2026	USD	(40,500)	MXN	709,941
SPOT	03/13/2026	USD	50,000,000	MXN	(882,500,000)
SPOT	03/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	882,990,000
SPOT	03/13/2026	USD	50,000,000	MXN	(880,000,000)
SPOT	03/12/2026	USD	50,000	MXN	(886,875)
SPOT	03/23/2026	USD	(3,000)	MXN	53,595
SPOT	03/13/2026	USD	300,000	MXN	(5,971,500)
SPOT	03/17/2026	USD	(300,000)	MXN	5,975,730
SPOT	03/13/2026	USD	750,000	MXN	(14,928,750)
SPOT	03/17/2026	USD	(750,000)	MXN	14,939,325
SPOT	03/20/2026	USD	50,000	MXN	(891,950)
SPOT	03/27/2026	USD	50,000	MXN	(892,500)
SPOT	03/13/2026	USD	750,000	MXN	(14,928,750)
SPOT	03/31/2026	USD	(750,000)	MXN	14,965,725
SPOT	03/23/2026	EUR	(77,000)	MXN	1,568,644
SPOT	03/25/2026	USD	(20,800)	MXN	368,222
SPOT	03/25/2026	USD	(20,800)	MXN	368,222
SPOT	03/18/2026	USD	200,000	MXN	(3,987,120)
SPOT	03/27/2026	USD	(200,000)	MXN	3,993,080
SPOT	03/20/2026	USD	250,000	MXN	(4,445,000)
SPOT	03/19/2026	USD	50,000	MXN	(888,250)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/20/2026	USD	(250,000)	MXN	4,407,400
SPOT	03/27/2026	USD	(250,000)	MXN	4,409,650
SPOT	03/20/2026	USD	(120,000)	MXN	2,128,764
SPOT	03/20/2026	USD	(227,500)	MXN	4,051,502
SPOT	03/23/2026	USD	200,000	MXN	(3,489,800)
SPOT	03/23/2026	USD	(185,000)	MXN	3,240,247
SPOT	03/24/2026	USD	(115,000)	MXN	2,014,283
SPOT	03/24/2026	USD	(300,000)	MXN	5,255,550
SPOT	03/25/2026	USD	(65,000)	MXN	1,138,956
SPOT	03/26/2026	USD	(235,000)	MXN	4,117,905
SPOT	03/27/2026	USD	17,000,000	MXN	(302,600,000)
SPOT	03/26/2026	USD	300,000	MXN	(5,244,300)
SPOT	03/26/2026	USD	50,000	MXN	(892,000)
SPOT	03/30/2026	USD	(150,000)	MXN	2,646,075
SPOT	03/31/2026	USD	(100,000)	MXN	1,741,000
SPOT	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(864,635)
SPOT	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(904,760)
SPOT	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(893,155)
SPOT	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(863,855)
SPOT	03/31/2026	USD	350,000	MXN	(6,984,005)
SPOT	01/07/2026	USD	(20,000,000)	MXN	437,000,000
SPOT	01/07/2026	USD	(15,000,000)	MXN	327,570,000
SPOT	01/27/2026	USD	(15,000,000)	MXN	323,640,000
SPOT	01/30/2026	USD	15,000,000	MXN	(324,750,000)
SPOT	01/30/2026	USD	10,000,000	MXN	(216,518,000)
SPOT	01/30/2026	USD	15,000,000	MXN	(324,750,000)
SPOT	02/10/2026	USD	(10,000,000)	MXN	215,120,000
SPOT	02/11/2026	USD	35,000,000	MXN	(754,887,000)
SPOT	02/11/2026	USD	(20,000,000)	MXN	431,600,000
SPOT	02/11/2026	USD	(10,000,000)	MXN	216,175,000
SPOT	02/17/2026	USD	20,000,000	MXN	(430,380,000)
SPOT	02/18/2026	USD	25,000,000	MXN	(536,075,000)
SPOT	03/05/2026	USD	(2,320,000)	MXN	49,882,320
SPOT	03/06/2026	USD	(20,000,000)	MXN	437,360,000
SPOT	03/06/2026	USD	(35,000,000)	MXN	763,035,000
SPOT	03/06/2026	USD	30,000,000	MXN	(653,640,000)
SPOT	03/09/2026	USD	(10,000,000)	MXN	213,920,000
SPOT	03/10/2026	USD	30,000,000	MXN	(637,500,000)
SPOT	03/18/2026	USD	100,000,000	MXN	(2,104,200,000)
SPOT	03/18/2026	USD	(50,000,000)	MXN	1,050,600,000
SPOT	03/19/2026	USD	(50,000,000)	MXN	1,040,850,000
SPOT	03/19/2026	USD	(20,000,000)	MXN	415,740,000
SPOT	03/19/2026	USD	(15,000,000)	MXN	312,112,500
SPOT	03/24/2026	USD	(20,000,000)	MXN	420,900,000
SPOT	03/30/2026	USD	(15,000,000)	MXN	315,315,000
SPOT	01/07/2026	USD	(20,000,000)	MXN	413,180,000
SPOT	01/12/2026	USD	25,000,000	MXN	(536,900,000)
SPOT	01/12/2026	USD	15,000,000	MXN	(322,155,000)
SPOT	01/26/2026	USD	(30,000,000)	MXN	609,225,000
SPOT	01/26/2026	USD	50,200,000	MXN	(1,019,968,620)
SPOT	01/28/2026	USD	10,000,000	MXN	(202,875,000)
SPOT	01/28/2026	USD	20,000,000	MXN	(405,750,000)
SPOT	01/28/2026	USD	10,000,000	MXN	(202,690,000)
SPOT	01/28/2026	USD	30,000,000	MXN	(608,160,000)
SPOT	01/28/2026	USD	(58,162,461)	MXN	1,180,000,000
SPOT	01/28/2026	USD	15,000,000	MXN	(304,192,500)
SPOT	01/28/2026	USD	20,000,000	MXN	(405,500,000)
SPOT	02/03/2026	USD	(30,000,000)	MXN	608,280,000
SPOT	02/03/2026	USD	(20,000,000)	MXN	405,520,000
SPOT	02/05/2026	USD	100,000,000	MXN	(2,028,600,000)
SPOT	02/05/2026	USD	(100,000,000)	MXN	2,029,800,000
SPOT	02/09/2026	USD	10,000,000	MXN	(203,420,000)
SPOT	02/12/2026	USD	(30,000,000)	MXN	606,600,000
SPOT	02/27/2026	USD	20,000,000	MXN	(398,870,000)
SPOT	03/06/2026	USD	(16,000,000)	MXN	316,536,000
SPOT	03/09/2026	USD	30,000,000	MXN	(593,100,000)
SPOT	03/10/2026	USD	15,000,000	MXN	(296,640,000)
SPOT	03/13/2026	USD	(15,000,000)	MXN	292,950,000
SPOT	03/13/2026	USD	(10,000,000)	MXN	195,310,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/18/2026	USD	50,000,000	MXN	(975,810,000)
SPOT	03/24/2026	USD	20,000,000	MXN	(395,230,000)
SPOT	03/26/2026	USD	(50,000,000)	MXN	981,800,000
SPOT	03/27/2026	USD	20,000,000	MXN	(389,880,000)
SPOT	03/27/2026	USD	(20,000,000)	MXN	390,010,000
SPOT	03/27/2026	USD	(20,000,000)	MXN	390,220,000
SPOT	01/16/2026	USD	30,000,000	MXN	(573,174,000)
SPOT	01/21/2026	USD	50,000,000	MXN	(958,450,000)
SPOT	01/07/2026	USD	(75,000,000)	MXN	1,346,250,000
SPOT	01/08/2026	USD	75,000,000	MXN	(1,346,377,500)
SPOT	01/08/2026	USD	(115,000,000)	MXN	2,065,779,500
SPOT	01/09/2026	USD	115,000,000	MXN	(2,065,940,500)
SPOT	01/07/2026	USD	(46,000,000)	MXN	826,620,000
SPOT	01/08/2026	USD	46,000,000	MXN	(826,675,200)
SPOT	01/07/2026	USD	46,000,000	MXN	(826,528,000)
SPOT	01/08/2026	USD	(46,000,000)	MXN	826,587,800
SPOT	01/08/2026	USD	(629,958)	MXN	11,319,770
SPOT	01/09/2026	USD	629,958	MXN	(11,320,715)
SPOT	01/08/2026	USD	(10,300,000)	MXN	185,286,700
SPOT	01/09/2026	USD	10,300,000	MXN	(185,299,060)
SPOT	01/08/2026	USD	(19,000,000)	MXN	341,791,000
SPOT	01/09/2026	USD	19,000,000	MXN	(341,813,800)
SPOT	01/08/2026	USD	(20,000,000)	MXN	359,200,000
SPOT	01/09/2026	USD	20,000,000	MXN	(359,224,000)
SPOT	01/08/2026	USD	49,300,000	MXN	(885,921,000)
SPOT	01/09/2026	USD	(49,300,000)	MXN	885,975,230
SPOT	01/09/2026	USD	(162,000,000)	MXN	2,911,950,000
SPOT	01/12/2026	USD	162,000,000	MXN	(2,912,630,400)
SPOT	01/09/2026	USD	110,000,000	MXN	(1,977,800,000)
SPOT	01/12/2026	USD	(110,000,000)	MXN	1,978,248,250
SPOT	01/09/2026	USD	(76,680)	MXN	1,377,656
SPOT	01/12/2026	USD	76,680	MXN	(1,378,059)
SPOT	01/08/2026	USD	11,000,000	MXN	(197,725,000)
SPOT	01/09/2026	USD	(11,000,000)	MXN	197,735,450
SPOT	01/08/2026	USD	(11,000,000)	MXN	197,725,000
SPOT	01/09/2026	USD	11,000,000	MXN	(197,734,900)
SPOT	01/09/2026	USD	(10,300,000)	MXN	185,245,500
SPOT	01/12/2026	USD	10,300,000	MXN	(185,286,700)
SPOT	01/09/2026	USD	10,050,000	MXN	(180,699,000)
SPOT	01/12/2026	USD	(10,050,000)	MXN	180,738,949
SPOT	01/12/2026	USD	(175,000,000)	MXN	3,146,850,000
SPOT	01/13/2026	USD	175,000,000	MXN	(3,147,077,500)
SPOT	01/12/2026	USD	57,000,000	MXN	(1,024,860,000)
SPOT	01/13/2026	USD	(57,000,000)	MXN	1,024,934,100
SPOT	01/12/2026	USD	(131,619)	MXN	2,366,629
SPOT	01/13/2026	USD	131,619	MXN	(2,366,860)
SPOT	01/13/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,685,945,000
SPOT	01/14/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,686,125,000)
SPOT	01/13/2026	USD	(685,585)	MXN	12,280,508
SPOT	01/14/2026	USD	685,585	MXN	(12,281,570)
SPOT	01/13/2026	USD	(92,000,000)	MXN	1,647,904,000
SPOT	01/14/2026	USD	92,000,000	MXN	(1,648,019,920)
SPOT	01/14/2026	USD	(165,000,000)	MXN	2,946,900,000
SPOT	01/15/2026	USD	165,000,000	MXN	(2,947,114,500)
SPOT	01/14/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,679,000,000
SPOT	01/15/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,679,195,000)
SPOT	01/14/2026	USD	(453,576)	MXN	8,100,297
SPOT	01/15/2026	USD	453,576	MXN	(8,100,921)
SPOT	01/15/2026	USD	(210,000,000)	MXN	3,739,260,000
SPOT	01/16/2026	USD	210,000,000	MXN	(3,739,512,000)
SPOT	01/15/2026	USD	(240,948)	MXN	4,291,537
SPOT	01/16/2026	USD	240,948	MXN	(4,291,899)
SPOT	01/15/2026	USD	20,000,000	MXN	(355,840,000)
SPOT	01/16/2026	USD	(20,000,000)	MXN	355,873,000
SPOT	01/15/2026	USD	(40,000,000)	MXN	709,340,080
SPOT	01/16/2026	USD	40,000,000	MXN	(709,408,080)
SPOT	01/16/2026	USD	(74,000,000)	MXN	1,316,822,600
SPOT	01/20/2026	USD	74,000,000	MXN	(1,317,237,000)
SPOT	01/16/2026	USD	(22,643,646)	MXN	400,000,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	01/20/2026	USD	22,635,957	MXN	(400,000,000)
SPOT	01/16/2026	USD	(32,833,286)	MXN	580,000,000
SPOT	01/20/2026	USD	32,822,138	MXN	(580,000,000)
SPOT	01/16/2026	USD	(9,626,819)	MXN	170,000,000
SPOT	01/20/2026	USD	9,623,549	MXN	(170,000,000)
SPOT	01/16/2026	USD	(1,380,871)	MXN	24,337,824
SPOT	01/20/2026	USD	1,380,871	MXN	(24,346,696)
SPOT	01/20/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,646,150,000
SPOT	01/21/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,646,382,500)
SPOT	01/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	882,150,000
SPOT	01/21/2026	USD	50,000,000	MXN	(882,227,500)
SPOT	01/16/2026	USD	(56,609,114)	MXN	1,000,000,000
SPOT	01/20/2026	USD	56,589,893	MXN	(1,000,000,000)
SPOT	01/20/2026	USD	(125,091,964)	MXN	2,210,375,000
SPOT	01/21/2026	USD	125,080,638	MXN	(2,210,375,000)
SPOT	01/20/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,474,360,000)
SPOT	01/21/2026	USD	(140,000,000)	MXN	2,474,584,000
SPOT	01/20/2026	USD	880,880	MXN	(15,560,593)
SPOT	01/21/2026	USD	(880,880)	MXN	15,561,985
SPOT	01/20/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,238,510,000
SPOT	01/21/2026	USD	70,000,000	MXN	(1,238,625,500)
SPOT	01/21/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,764,200,000
SPOT	01/22/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,764,365,000)
SPOT	01/20/2026	USD	50,000,000	MXN	(881,500,000)
SPOT	01/21/2026	USD	(50,000,000)	MXN	881,582,500
SPOT	01/20/2026	USD	56,691,271	MXN	(1,000,000,000)
SPOT	01/21/2026	USD	(56,685,808)	MXN	1,000,000,000
SPOT	01/20/2026	USD	(106,691,271)	MXN	1,881,468,557
SPOT	01/21/2026	USD	106,685,808	MXN	(1,881,550,917)
SPOT	01/20/2026	USD	119,250,000	MXN	(2,102,973,750)
SPOT	01/21/2026	USD	(119,250,000)	MXN	2,103,170,513
SPOT	01/20/2026	USD	(119,250,000)	MXN	2,102,973,750
SPOT	01/21/2026	USD	119,250,000	MXN	(2,103,170,513)
SPOT	01/20/2026	USD	(7,202,862)	MXN	126,683,933
SPOT	01/21/2026	USD	7,202,862	MXN	(126,695,458)
SPOT	01/20/2026	USD	(24,516,000)	MXN	431,457,084
SPOT	01/21/2026	USD	24,516,000	MXN	(431,498,761)
SPOT	01/21/2026	USD	(82,000,000)	MXN	1,444,676,000
SPOT	01/22/2026	USD	82,000,000	MXN	(1,444,815,400)
SPOT	01/21/2026	USD	(765,757)	MXN	13,485,703
SPOT	01/22/2026	USD	765,757	MXN	(13,487,042)
SPOT	01/21/2026	USD	(20,000,000)	MXN	352,040,000
SPOT	01/22/2026	USD	20,000,000	MXN	(352,075,000)
SPOT	01/21/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,745,000,000
SPOT	01/22/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,745,160,000)
SPOT	01/21/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,745,000,000)
SPOT	01/22/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,745,160,000
SPOT	01/21/2026	USD	(16,000,000)	MXN	279,040,000
SPOT	01/22/2026	USD	16,000,000	MXN	(279,065,600)
SPOT	01/21/2026	USD	16,000,000	MXN	(279,335,440)
SPOT	01/22/2026	USD	(16,000,000)	MXN	279,361,040
SPOT	01/22/2026	USD	(13,000,000)	MXN	226,850,000
SPOT	01/23/2026	USD	13,000,000	MXN	(226,871,450)
SPOT	01/22/2026	USD	(341,271)	MXN	5,948,928
SPOT	01/23/2026	USD	341,271	MXN	(5,949,507)
SPOT	01/22/2026	USD	(97,000,000)	MXN	1,694,590,000
SPOT	01/23/2026	USD	97,000,000	MXN	(1,694,745,200)
SPOT	01/23/2026	USD	(45,000,000)	MXN	786,600,000
SPOT	01/26/2026	USD	45,000,000	MXN	(786,813,750)
SPOT	01/26/2026	USD	(50,000,000)	MXN	874,250,000
SPOT	01/27/2026	USD	50,000,000	MXN	(874,327,500)
SPOT	01/22/2026	USD	97,000,000	MXN	(1,694,323,250)
SPOT	01/23/2026	USD	(97,000,000)	MXN	1,694,478,450
SPOT	01/22/2026	USD	(27,000,000)	MXN	472,203,000
SPOT	01/23/2026	USD	27,000,000	MXN	(472,246,200)
SPOT	01/23/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,049,460,000)
SPOT	01/26/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,049,745,000
SPOT	01/23/2026	USD	640,576	MXN	(11,199,068)
SPOT	01/26/2026	USD	(640,576)	MXN	11,201,887

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	01/22/2026	USD	11,000,000	MXN	(192,335,286)
SPOT	01/23/2026	USD	(11,000,000)	MXN	192,352,886
SPOT	01/22/2026	USD	16,000,000	MXN	(279,735,680)
SPOT	01/23/2026	USD	(16,000,000)	MXN	279,761,280
SPOT	01/26/2026	USD	32,625,494	MXN	(570,000,000)
SPOT	01/27/2026	USD	(32,622,506)	MXN	570,000,000
SPOT	01/23/2026	USD	(50,000,000)	MXN	873,850,000
SPOT	01/26/2026	USD	50,000,000	MXN	(874,092,500)
SPOT	01/26/2026	USD	966,000	MXN	(16,886,514)
SPOT	01/27/2026	USD	(966,000)	MXN	16,887,896
SPOT	01/26/2026	USD	65,000,000	MXN	(1,136,408,000)
SPOT	01/27/2026	USD	(65,000,000)	MXN	1,136,505,500
SPOT	01/27/2026	USD	125,431,962	MXN	(2,180,634,666)
SPOT	01/28/2026	USD	(125,420,420)	MXN	2,180,634,666
SPOT	01/27/2026	USD	26,601,897	MXN	(460,000,000)
SPOT	01/29/2026	USD	(26,596,821)	MXN	460,000,000
SPOT	01/26/2026	USD	(8,200,000)	MXN	141,983,000
SPOT	01/27/2026	USD	8,200,000	MXN	(141,996,120)
SPOT	01/26/2026	USD	18,200,000	MXN	(315,272,121)
SPOT	01/27/2026	USD	(18,200,000)	MXN	315,301,241
SPOT	01/27/2026	USD	110,000,000	MXN	(1,906,300,000)
SPOT	01/28/2026	USD	(110,000,000)	MXN	1,906,474,900
SPOT	01/27/2026	USD	(22,608)	MXN	391,942
SPOT	01/28/2026	USD	22,608	MXN	(391,983)
SPOT	01/28/2026	USD	(13,300,000)	MXN	229,850,600
SPOT	01/29/2026	USD	13,300,000	MXN	(229,871,215)
SPOT	01/28/2026	USD	63,891,518	MXN	(1,101,937,010)
SPOT	01/29/2026	USD	(63,885,591)	MXN	1,101,937,010
SPOT	01/28/2026	USD	(36,000,000)	MXN	620,764,200
SPOT	01/29/2026	USD	36,000,000	MXN	(620,823,600)
SPOT	01/28/2026	USD	(614,204)	MXN	10,592,725
SPOT	01/29/2026	USD	614,204	MXN	(10,593,723)
SPOT	01/29/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,723,000,000
SPOT	01/30/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,723,155,000)
SPOT	01/29/2026	USD	1,077,805	MXN	(18,565,122)
SPOT	01/30/2026	USD	(1,077,805)	MXN	18,566,804
SPOT	01/30/2026	USD	(77,000,000)	MXN	1,323,630,000
SPOT	02/03/2026	USD	77,000,000	MXN	(1,324,103,550)
SPOT	02/03/2026	USD	(90,000,000)	MXN	1,548,000,000
SPOT	02/04/2026	USD	90,000,000	MXN	(1,548,135,000)
SPOT	01/30/2026	USD	41,000,000	MXN	(706,544,800)
SPOT	02/03/2026	USD	(41,000,000)	MXN	706,799,000
SPOT	01/30/2026	USD	632,865	MXN	(10,915,387)
SPOT	02/03/2026	USD	(632,865)	MXN	10,919,200
SPOT	01/29/2026	USD	5,220,418	MXN	(90,007,498)
SPOT	02/03/2026	USD	(5,220,418)	MXN	90,046,468
SPOT	01/30/2026	USD	9,000,000	MXN	(156,375,000)
SPOT	02/03/2026	USD	(9,000,000)	MXN	156,433,500
SPOT	01/30/2026	USD	(24,000,000)	MXN	417,090,000
SPOT	02/03/2026	USD	24,000,000	MXN	(417,253,200)
SPOT	02/03/2026	USD	1,104,077	MXN	(19,205,262)
SPOT	02/04/2026	USD	(1,104,077)	MXN	19,206,311
SPOT	02/04/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,727,000,000
SPOT	02/05/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,727,137,500)
SPOT	02/05/2026	USD	(67,000,000)	MXN	1,157,090,000
SPOT	02/06/2026	USD	67,000,000	MXN	(1,157,183,800)
SPOT	02/04/2026	USD	41,000,000	MXN	(706,430,000)
SPOT	02/05/2026	USD	(41,000,000)	MXN	706,488,220
SPOT	02/04/2026	USD	845,640	MXN	(14,565,100)
SPOT	02/05/2026	USD	(845,640)	MXN	14,566,242
SPOT	02/05/2026	USD	(82,000,000)	MXN	1,413,680,000
SPOT	02/06/2026	USD	82,000,000	MXN	(1,413,790,700)
SPOT	02/05/2026	USD	17,000,000	MXN	(293,543,675)
SPOT	02/06/2026	USD	(17,000,000)	MXN	293,566,200
SPOT	02/05/2026	USD	55,000,000	MXN	(954,615,750)
SPOT	02/06/2026	USD	(55,000,000)	MXN	954,690,000
SPOT	02/05/2026	USD	441,013	MXN	(7,654,512)
SPOT	02/06/2026	USD	(441,013)	MXN	7,655,053
SPOT	02/06/2026	USD	(56,000,000)	MXN	972,440,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/09/2026	USD	56,000,000	MXN	(972,658,400)
SPOT	02/06/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,219,036,000
SPOT	02/09/2026	USD	70,000,000	MXN	(1,219,309,000)
SPOT	02/06/2026	USD	(249,438)	MXN	4,336,458
SPOT	02/09/2026	USD	249,438	MXN	(4,337,477)
SPOT	02/09/2026	USD	(5,000,000)	MXN	86,550,000
SPOT	02/10/2026	USD	5,000,000	MXN	(86,556,000)
SPOT	02/09/2026	USD	(167,000,000)	MXN	2,890,770,000
SPOT	02/10/2026	USD	167,000,000	MXN	(2,891,003,800)
SPOT	02/09/2026	USD	(361,118)	MXN	6,251,429
SPOT	02/10/2026	USD	361,118	MXN	(6,251,935)
SPOT	02/10/2026	USD	(45,000,000)	MXN	773,190,000
SPOT	02/11/2026	USD	45,000,000	MXN	(773,248,500)
SPOT	02/11/2026	USD	(45,000,000)	MXN	774,045,000
SPOT	02/12/2026	USD	45,000,000	MXN	(774,103,500)
SPOT	02/10/2026	USD	(663,908)	MXN	11,425,471
SPOT	02/11/2026	USD	663,908	MXN	(11,426,390)
SPOT	02/10/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,032,216,000
SPOT	02/11/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,032,300,000)
SPOT	02/11/2026	USD	(23,000,000)	MXN	395,830,000
SPOT	02/12/2026	USD	23,000,000	MXN	(395,859,900)
SPOT	02/12/2026	USD	(44,000,000)	MXN	757,240,000
SPOT	02/13/2026	USD	44,000,000	MXN	(757,297,200)
SPOT	02/11/2026	USD	(866,911)	MXN	14,913,205
SPOT	02/12/2026	USD	866,911	MXN	(14,914,677)
SPOT	02/11/2026	USD	(25,000,000)	MXN	429,986,250
SPOT	02/12/2026	USD	25,000,000	MXN	(430,022,500)
SPOT	02/10/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,000,000
SPOT	02/11/2026	USD	20,000,000	MXN	(344,030,000)
SPOT	02/10/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,150,000
SPOT	02/11/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,198,000)
SPOT	02/12/2026	USD	(41,000,000)	MXN	705,815,000
SPOT	02/13/2026	USD	41,000,000	MXN	(705,878,550)
SPOT	02/12/2026	USD	129,000,000	MXN	(2,221,122,000)
SPOT	02/13/2026	USD	(129,000,000)	MXN	2,221,315,500
SPOT	02/12/2026	USD	321,467	MXN	(5,531,775)
SPOT	02/13/2026	USD	(321,467)	MXN	5,532,252
SPOT	02/13/2026	USD	(25,000,000)	MXN	431,150,000
SPOT	02/18/2026	USD	25,000,000	MXN	(431,340,000)
SPOT	02/12/2026	USD	(40,000,000)	MXN	689,280,000
SPOT	02/13/2026	USD	40,000,000	MXN	(689,344,000)
SPOT	02/13/2026	USD	845,488	MXN	(14,591,490)
SPOT	02/17/2026	USD	(845,488)	MXN	14,596,585
SPOT	02/13/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,410,562,000)
SPOT	02/17/2026	USD	(140,000,000)	MXN	2,411,430,000
SPOT	02/13/2026	USD	(20,000,000)	MXN	343,720,000
SPOT	02/17/2026	USD	20,000,000	MXN	(343,847,000)
SPOT	02/17/2026	USD	97,000,000	MXN	(1,669,855,000)
SPOT	02/18/2026	USD	(97,000,000)	MXN	1,670,010,200
SPOT	02/13/2026	USD	89,712,222	MXN	(1,540,000,000)
SPOT	02/17/2026	USD	(89,678,787)	MXN	1,540,000,000
SPOT	02/13/2026	USD	(89,712,222)	MXN	1,540,000,000
SPOT	02/17/2026	USD	89,678,787	MXN	(1,540,000,000)
SPOT	02/18/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,402,400,000)
SPOT	02/18/2026	USD	(70,000,000)	MXN	1,201,200,000
SPOT	02/18/2026	USD	(45,000,000)	MXN	772,200,000
SPOT	02/18/2026	USD	20,000,000	MXN	(343,200,000)
SPOT	02/17/2026	USD	(393,050)	MXN	6,743,119
SPOT	02/18/2026	USD	393,050	MXN	(6,743,753)
SPOT	02/13/2026	USD	(20,000,000)	MXN	342,600,000
SPOT	02/17/2026	USD	20,000,000	MXN	(342,772,000)
SPOT	02/17/2026	USD	(50,000,000)	MXN	860,500,000
SPOT	02/18/2026	USD	50,000,000	MXN	(860,581,250)
SPOT	02/18/2026	USD	72,600,000	MXN	(1,245,932,160)
SPOT	02/19/2026	USD	(72,600,000)	MXN	1,246,048,320
SPOT	02/18/2026	USD	47,335	MXN	(811,979)
SPOT	02/19/2026	USD	(47,335)	MXN	812,054
SPOT	02/18/2026	USD	4,847,138	MXN	(83,104,184)
SPOT	02/19/2026	USD	(4,847,138)	MXN	83,112,182

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/19/2026	USD	85,000,000	MXN	(1,456,475,000)
SPOT	02/20/2026	USD	(85,000,000)	MXN	1,456,615,250
SPOT	02/18/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,028,280,000
SPOT	02/19/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,028,376,000)
SPOT	02/18/2026	USD	152,862	MXN	(2,619,624)
SPOT	02/19/2026	USD	(152,862)	MXN	2,619,848
SPOT	02/20/2026	USD	(50,000,000)	MXN	856,975,000
SPOT	02/20/2026	USD	50,000,000	MXN	(856,975,000)
SPOT	02/19/2026	USD	(36,000,000)	MXN	617,430,600
SPOT	02/20/2026	USD	36,000,000	MXN	(617,490,000)
SPOT	02/18/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,460,000
SPOT	02/19/2026	USD	20,000,000	MXN	(344,490,000)
SPOT	02/18/2026	USD	20,000,000	MXN	(344,481,380)
SPOT	02/19/2026	USD	(20,000,000)	MXN	344,511,380
SPOT	02/20/2026	USD	(8,000,000)	MXN	138,192,000
SPOT	02/23/2026	USD	8,000,000	MXN	(138,229,600)
SPOT	02/20/2026	USD	126,000,000	MXN	(2,175,642,000)
SPOT	02/23/2026	USD	(126,000,000)	MXN	2,176,234,200
SPOT	02/20/2026	USD	376,419	MXN	(6,498,607)
SPOT	02/23/2026	USD	(376,419)	MXN	6,500,373
SPOT	02/19/2026	USD	(299,577)	MXN	5,138,963
SPOT	02/20/2026	USD	299,577	MXN	(5,139,448)
SPOT	02/23/2026	USD	(7,000,000)	MXN	120,281,000
SPOT	02/24/2026	USD	7,000,000	MXN	(120,291,850)
SPOT	02/23/2026	USD	170,000,000	MXN	(2,918,900,000)
SPOT	02/24/2026	USD	(170,000,000)	MXN	2,919,163,500
SPOT	02/23/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,716,600,000)
SPOT	02/24/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,716,755,000
SPOT	02/23/2026	USD	95,519	MXN	(1,639,676)
SPOT	02/24/2026	USD	(95,519)	MXN	1,639,824
SPOT	02/24/2026	USD	(30,000,000)	MXN	514,650,000
SPOT	02/23/2026	USD	(25,000,000)	MXN	429,662,500
SPOT	02/24/2026	USD	25,000,000	MXN	(429,701,250)
SPOT	02/23/2026	USD	25,000,000	MXN	(429,662,500)
SPOT	02/24/2026	USD	(25,000,000)	MXN	429,701,250
SPOT	02/24/2026	USD	(3,000,000)	MXN	51,621,000
SPOT	02/25/2026	USD	3,000,000	MXN	(51,625,650)
SPOT	02/24/2026	USD	107,000,000	MXN	(1,840,373,250)
SPOT	02/25/2026	USD	(107,000,000)	MXN	1,840,539,100
SPOT	02/24/2026	USD	(61,573)	MXN	1,059,148
SPOT	02/25/2026	USD	61,573	MXN	(1,059,248)
SPOT	02/25/2026	USD	(12,000,000)	MXN	207,372,000
SPOT	02/26/2026	USD	12,000,000	MXN	(207,390,600)
SPOT	02/25/2026	USD	110,000,000	MXN	(1,900,360,000)
SPOT	02/26/2026	USD	(110,000,000)	MXN	1,900,530,500
SPOT	02/26/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,724,700,000)
SPOT	03/26/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,729,130,000
SPOT	02/26/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,724,700,000
SPOT	03/26/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,729,130,000)
SPOT	02/25/2026	USD	13,072	MXN	(225,177)
SPOT	02/26/2026	USD	(13,072)	MXN	225,197
SPOT	02/24/2026	USD	(25,000,000)	MXN	429,326,875
SPOT	02/25/2026	USD	25,000,000	MXN	(429,368,125)
SPOT	02/26/2026	USD	(50,000,000)	MXN	858,750,000
SPOT	03/26/2026	USD	50,000,000	MXN	(860,960,000)
SPOT	02/26/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,575,800,000)
SPOT	02/27/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,576,040,000
SPOT	02/26/2026	USD	16,000,000	MXN	(274,816,000)
SPOT	02/27/2026	USD	(16,000,000)	MXN	274,841,920
SPOT	02/27/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,030,200,000
SPOT	03/31/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,033,140,000)
SPOT	02/27/2026	USD	30,000,000	MXN	(515,100,000)
SPOT	03/31/2026	USD	(30,000,000)	MXN	516,570,000
SPOT	02/26/2026	USD	(244,000,000)	MXN	4,198,453,100
SPOT	02/27/2026	USD	244,000,000	MXN	(4,198,849,600)
SPOT	02/26/2026	USD	(51,887)	MXN	892,287
SPOT	02/27/2026	USD	51,887	MXN	(892,371)
SPOT	02/27/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,033,500,000)
SPOT	03/02/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,033,776,000

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	02/27/2026	USD	(121,000,000)	MXN	2,083,801,500
SPOT	03/02/2026	USD	121,000,000	MXN	(2,084,370,200)
SPOT	02/27/2026	USD	(660,060)	MXN	11,377,925
SPOT	03/02/2026	USD	660,060	MXN	(11,381,092)
SPOT	03/02/2026	USD	18,000,000	MXN	(310,320,000)
SPOT	03/03/2026	USD	(18,000,000)	MXN	310,350,600
SPOT	03/02/2026	USD	(6,422,270)	MXN	110,526,269
SPOT	03/03/2026	USD	6,422,270	MXN	(110,536,904)
SPOT	03/03/2026	USD	30,000,000	MXN	(516,780,000)
SPOT	03/03/2026	USD	150,000,000	MXN	(2,601,000,000)
SPOT	03/04/2026	USD	(150,000,000)	MXN	2,601,240,000
SPOT	03/03/2026	USD	(120,000,000)	MXN	2,080,200,000
SPOT	03/04/2026	USD	120,000,000	MXN	(2,080,386,000)
SPOT	03/03/2026	USD	10,000,000	MXN	(173,392,250)
SPOT	03/04/2026	USD	(10,000,000)	MXN	173,408,000
SPOT	03/03/2026	USD	48,040	MXN	(833,814)
SPOT	03/04/2026	USD	(48,040)	MXN	833,889
SPOT	03/04/2026	USD	(115,000,000)	MXN	2,053,325,000
SPOT	03/05/2026	USD	115,000,000	MXN	(2,053,503,250)
SPOT	03/04/2026	USD	209,000,000	MXN	(3,697,210,000)
SPOT	03/05/2026	USD	(209,000,000)	MXN	3,697,533,950
SPOT	03/04/2026	USD	534,741	MXN	(9,467,071)
SPOT	03/05/2026	USD	(534,741)	MXN	9,467,855
SPOT	03/05/2026	USD	250,000,000	MXN	(4,391,250,000)
SPOT	03/06/2026	USD	(250,000,000)	MXN	4,391,650,000
SPOT	03/05/2026	USD	(85,000,000)	MXN	1,495,150,000
SPOT	03/06/2026	USD	85,000,000	MXN	(1,495,281,750)
SPOT	03/05/2026	USD	124,000,000	MXN	(2,182,400,000)
SPOT	03/06/2026	USD	(124,000,000)	MXN	2,182,592,200
SPOT	03/05/2026	USD	431,177	MXN	(7,590,281)
SPOT	03/06/2026	USD	(431,177)	MXN	7,590,954
SPOT	03/06/2026	USD	(25,000,000)	MXN	441,025,000
SPOT	03/09/2026	USD	25,000,000	MXN	(441,138,750)
SPOT	03/06/2026	USD	200,000,000	MXN	(3,528,620,000)
SPOT	03/09/2026	USD	(200,000,000)	MXN	3,529,480,000
SPOT	03/06/2026	USD	184,000,000	MXN	(3,249,440,000)
SPOT	03/09/2026	USD	(184,000,000)	MXN	3,250,240,400
SPOT	03/06/2026	USD	(82,478)	MXN	1,457,555
SPOT	03/09/2026	USD	82,478	MXN	(1,457,932)
SPOT	03/09/2026	USD	(27,000,000)	MXN	480,330,000
SPOT	03/10/2026	USD	27,000,000	MXN	(480,348,900)
SPOT	03/09/2026	USD	(22,732,024)	MXN	404,971,000
SPOT	03/10/2026	USD	22,730,492	MXN	(404,971,000)
SPOT	03/09/2026	USD	50,000,000	MXN	(889,000,000)
SPOT	03/10/2026	USD	(50,000,000)	MXN	889,055,000
SPOT	03/09/2026	USD	140,000,000	MXN	(2,489,900,000)
SPOT	03/10/2026	USD	(140,000,000)	MXN	2,490,054,000
SPOT	03/09/2026	USD	337,211	MXN	(6,003,354)
SPOT	03/10/2026	USD	(337,211)	MXN	6,003,193
SPOT	03/10/2026	USD	200,000,000	MXN	(3,552,600,000)
SPOT	03/10/2026	USD	189,620,038	MXN	(3,379,029,081)
SPOT	03/11/2026	USD	(189,608,334)	MXN	3,379,029,081
SPOT	03/10/2026	USD	20,000,000	MXN	(356,000,000)
SPOT	03/11/2026	USD	(20,000,000)	MXN	356,022,000
SPOT	03/10/2026	USD	(316,000,000)	MXN	5,616,505,000
SPOT	03/11/2026	USD	316,000,000	MXN	(5,616,868,400)
SPOT	03/10/2026	USD	(375,930)	MXN	6,681,404
SPOT	03/11/2026	USD	375,930	MXN	(6,681,930)
SPOT	03/11/2026	USD	(40,000,000)	MXN	712,160,000
SPOT	03/11/2026	USD	22,000,000	MXN	(385,220,000)
SPOT	03/12/2026	USD	(22,000,000)	MXN	385,243,100
SPOT	03/11/2026	USD	(99,000,000)	MXN	1,731,851,550
SPOT	03/12/2026	USD	99,000,000	MXN	(1,731,955,500)
SPOT	03/11/2026	USD	(8,303)	MXN	145,307
SPOT	03/12/2026	USD	8,303	MXN	(145,318)
SPOT	03/12/2026	USD	112,900	MXN	(1,976,094)
SPOT	03/12/2026	USD	(30,000,000)	MXN	527,610,000
SPOT	03/12/2026	USD	30,000,000	MXN	(527,640,000)
SPOT	03/12/2026	USD	40,000,000	MXN	(704,400,000)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/13/2026	USD	(40,000,000)	MXN	704,446,000
SPOT	03/12/2026	USD	(45,000,000)	MXN	792,204,750
SPOT	03/13/2026	USD	45,000,000	MXN	(792,256,500)
SPOT	03/12/2026	USD	182,693	MXN	(3,215,901)
SPOT	03/13/2026	USD	(182,693)	MXN	3,216,097
SPOT	03/13/2026	USD	100,115,040	MXN	(1,774,539,081)
SPOT	03/17/2026	USD	(100,082,291)	MXN	1,774,539,081
SPOT	03/13/2026	USD	15,000,000	MXN	(267,720,000)
SPOT	03/17/2026	USD	(15,000,000)	MXN	267,816,000
SPOT	03/13/2026	USD	(74,000,000)	MXN	1,321,924,900
SPOT	03/17/2026	USD	74,000,000	MXN	(1,322,394,800)
SPOT	03/13/2026	USD	261,513	MXN	(4,668,274)
SPOT	03/17/2026	USD	(261,513)	MXN	4,669,837
SPOT	03/17/2026	USD	30,000,000	MXN	(534,300,000)
SPOT	03/17/2026	USD	(15,000,000)	MXN	267,150,000
SPOT	03/17/2026	USD	(25,000,000)	MXN	444,000,000
SPOT	03/18/2026	USD	25,000,000	MXN	(444,040,000)
SPOT	03/17/2026	USD	41,000,000	MXN	(731,519,950)
SPOT	03/18/2026	USD	(41,000,000)	MXN	731,583,500
SPOT	03/17/2026	USD	349,661	MXN	(6,232,459)
SPOT	03/18/2026	USD	(349,661)	MXN	6,232,983
SPOT	03/18/2026	USD	15,000,000	MXN	(268,350,000)
SPOT	03/19/2026	USD	(15,000,000)	MXN	264,300,000
SPOT	03/20/2026	USD	49,932,019	MXN	(882,498,500)
SPOT	03/18/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,061,400,000
SPOT	03/19/2026	USD	60,000,000	MXN	(1,061,496,000)
SPOT	03/18/2026	USD	(75,000,000)	MXN	1,327,500,000
SPOT	03/19/2026	USD	75,000,000	MXN	(1,327,625,250)
SPOT	03/18/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,770,095,000
SPOT	03/19/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,770,260,000)
SPOT	03/18/2026	USD	(686,703)	MXN	12,170,736
SPOT	03/19/2026	USD	686,703	MXN	(12,171,882)
SPOT	03/17/2026	USD	(30,000,000)	MXN	529,800,000
SPOT	03/18/2026	USD	30,000,000	MXN	(529,854,300)
SPOT	03/19/2026	USD	(27,000,000)	MXN	478,305,000
SPOT	03/20/2026	USD	27,000,000	MXN	(478,346,850)
SPOT	03/19/2026	USD	(23,000,000)	MXN	406,634,250
SPOT	03/20/2026	USD	23,000,000	MXN	(406,672,200)
SPOT	03/19/2026	USD	439,623	MXN	(7,779,663)
SPOT	03/20/2026	USD	(439,623)	MXN	7,780,366
SPOT	03/20/2026	USD	(27,000,000)	MXN	482,355,000
SPOT	03/23/2026	USD	27,000,000	MXN	(482,487,300)
SPOT	03/20/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,791,000,000)
SPOT	03/23/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,791,493,000
SPOT	03/20/2026	USD	87,000,000	MXN	(1,559,179,200)
SPOT	03/23/2026	USD	(87,000,000)	MXN	1,559,605,500
SPOT	03/20/2026	USD	304,878	MXN	(5,452,511)
SPOT	03/23/2026	USD	(304,878)	MXN	5,453,878
SPOT	03/20/2026	USD	(609,757)	MXN	10,899,028
SPOT	03/23/2026	USD	609,757	MXN	(10,902,330)
SPOT	03/23/2026	USD	15,000,000	MXN	(267,825,000)
SPOT	03/23/2026	USD	(30,000,000)	MXN	535,650,000
SPOT	03/23/2026	USD	36,000,000	MXN	(645,660,000)
SPOT	03/24/2026	USD	(36,000,000)	MXN	645,721,200
SPOT	03/23/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,792,000,000)
SPOT	03/24/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,792,161,000
SPOT	03/23/2026	USD	9,000,000	MXN	(160,920,000)
SPOT	03/24/2026	USD	(9,000,000)	MXN	160,934,400
SPOT	03/24/2026	USD	(30,000,000)	MXN	539,130,000
SPOT	03/24/2026	USD	37,000,000	MXN	(657,675,000)
SPOT	03/25/2026	USD	(37,000,000)	MXN	657,737,900
SPOT	03/24/2026	USD	84,000,000	MXN	(1,496,040,000)
SPOT	03/25/2026	USD	(84,000,000)	MXN	1,496,168,520
SPOT	03/24/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,782,775,000)
SPOT	03/25/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,782,930,000
SPOT	03/24/2026	USD	(166,541)	MXN	2,966,244
SPOT	03/25/2026	USD	166,541	MXN	(2,966,518)
SPOT	03/25/2026	USD	15,000,000	MXN	(266,850,000)
SPOT	03/25/2026	USD	35,000,000	MXN	(624,925,000)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
SPOT	03/26/2026	USD	(35,000,000)	MXN	624,984,500
SPOT	03/25/2026	USD	99,000,000	MXN	(1,765,170,000)
SPOT	03/26/2026	USD	(99,000,000)	MXN	1,765,327,410
SPOT	03/25/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,783,150,000)
SPOT	03/26/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,783,310,000
SPOT	03/25/2026	USD	(110,145)	MXN	1,962,659
SPOT	03/26/2026	USD	110,145	MXN	(1,962,846)
SPOT	03/26/2026	USD	(118,000,000)	MXN	2,099,810,000
SPOT	03/27/2026	USD	118,000,000	MXN	(2,099,989,950)
SPOT	03/26/2026	USD	200,000,000	MXN	(3,558,000,000)
SPOT	03/27/2026	USD	(200,000,000)	MXN	3,558,310,000
SPOT	03/26/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,779,295,000)
SPOT	03/27/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,779,450,000
SPOT	03/26/2026	USD	56,000,000	MXN	(995,176,000)
SPOT	03/27/2026	USD	(56,000,000)	MXN	995,261,400
SPOT	03/26/2026	USD	567,052	MXN	(10,064,628)
SPOT	03/27/2026	USD	(567,052)	MXN	10,065,506
SPOT	03/27/2026	USD	(99,000,000)	MXN	1,760,715,000
SPOT	03/30/2026	USD	99,000,000	MXN	(1,761,150,600)
SPOT	03/30/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,777,500,000
SPOT	03/26/2026	USD	(20,000,000)	MXN	355,803,920
SPOT	03/27/2026	USD	20,000,000	MXN	(355,838,920)
SPOT	03/27/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,778,815,000)
SPOT	03/30/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,779,270,000
SPOT	03/27/2026	USD	98,000,000	MXN	(1,746,360,000)
SPOT	03/30/2026	USD	(98,000,000)	MXN	1,746,793,160
SPOT	03/27/2026	USD	536,068	MXN	(9,550,674)
SPOT	03/30/2026	USD	(536,068)	MXN	9,553,006
SPOT	03/30/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,781,500,000)
SPOT	03/30/2026	USD	20,000,000	MXN	(357,900,000)
SPOT	03/30/2026	USD	250,000,000	MXN	(4,518,750,000)
SPOT	03/31/2026	USD	(250,000,000)	MXN	4,519,112,500
SPOT	03/27/2026	USD	(15,000,000)	MXN	270,664,980
SPOT	03/30/2026	USD	15,000,000	MXN	(270,735,480)
SPOT	03/27/2026	USD	(10,000,000)	MXN	180,215,460
SPOT	03/30/2026	USD	10,000,000	MXN	(180,262,460)
SPOT	03/30/2026	USD	(82,000,000)	MXN	1,476,000,000
SPOT	03/31/2026	USD	82,000,000	MXN	(1,476,129,560)
SPOT	03/30/2026	USD	(100,000,000)	MXN	1,805,000,000
SPOT	03/31/2026	USD	100,000,000	MXN	(1,805,145,000)
SPOT	03/30/2026	USD	332,911	MXN	(6,006,745)
SPOT	03/31/2026	USD	(332,911)	MXN	6,007,188
SPOT	03/30/2026	USD	(15,000,000)	MXN	270,900,000
SPOT	03/31/2026	USD	15,000,000	MXN	(270,923,700)
SPOT	03/31/2026	USD	(55,000,000)	MXN	996,655,000
SPOT	03/31/2026	USD	(60,000,000)	MXN	1,079,820,000
SPOT	03/31/2026	USD	(42,000,000)	MXN	755,920,074
SPOT	03/31/2026	USD	(51,796)	MXN	932,463

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	148,109	USD	2,800,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	153,931	USD	2,800,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	148,109	USD	2,800,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	153,931	USD	2,800,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,935,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,848,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,935,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,848,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	2,273	USD	42,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	2,273	USD	42,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	25,000	USD	542,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	25,000	USD	517,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	25,000	USD	542,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	25,000	USD	517,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	2,250,000	USD	47,250,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	2,250,000	USD	44,786,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	2,250,000	USD	44,786,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	950,000	USD	19,950,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	950,000	USD	18,909,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	950,000	USD	18,909,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	1,300,000	USD	27,300,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,300,000	USD	25,876,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,300,000	USD	25,876,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	542,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	25,000	USD	517,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	25,000	USD	542,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	25,000	USD	517,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	300,000	USD	6,000,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,640,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	300,000	USD	5,445,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	300,000	USD	6,000,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,640,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	300,000	USD	5,445,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	2,500,000	USD	52,500,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	2,500,000	USD	49,762,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	2,500,000	USD	49,762,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	250,000	USD	5,250,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,976,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,976,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	950,000	USD	19,950,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	950,000	USD	18,909,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	950,000	USD	18,909,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	1,300,000	USD	27,300,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,300,000	USD	25,876,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,300,000	USD	25,876,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	18,000	USD	360,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	10,744	USD	195,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	18,000	USD	360,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	10,744	USD	195,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	158,500	USD	3,059,050	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	158,500	USD	2,948,100	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	158,500	USD	2,948,100	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	158,500	USD	3,059,050	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	158,500	USD	2,948,100	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	158,500	USD	2,948,100	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,937,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,655,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,800,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	250,000	USD	4,937,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,655,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,800,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,992,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,848,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,832,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	150,000	USD	2,992,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,848,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,832,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	7,218	USD	144,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	874	USD	16,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	7,218	USD	144,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	874	USD	16,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	79,800,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	73,800,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	75,800,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	4,000,000	USD	79,800,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	73,800,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	75,800,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,970,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,894,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,624,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,977,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,848,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,827,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	150,000	USD	2,977,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	150,000	USD	2,848,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,827,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,625,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	125,000	USD	2,541,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,437,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,625,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,541,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,437,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	1,987	USD	36,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	6,499	USD	129,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,114	USD	21,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	6,499	USD	129,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,114	USD	21,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	3,988	USD	83,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	5,321	USD	103,750	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	3,988	USD	83,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	5,321	USD	103,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	45,000	USD	822,600	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	973,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	923,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	45,000	USD	838,350	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	224,100	USD	4,325,130	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	224,100	USD	4,168,260	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	224,100	USD	4,168,260	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	198,700	USD	3,834,910	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	198,700	USD	3,695,820	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	198,700	USD	3,695,820	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	224,100	USD	4,325,130	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	224,100	USD	4,168,260	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	224,100	USD	4,168,260	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	198,700	USD	3,834,910	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	198,700	USD	3,695,820	MXN	ene-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	198,700	USD	3,695,820	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	397,500	USD	7,671,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	397,500	USD	7,671,750	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	397,500	USD	7,671,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	397,500	USD	7,671,750	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	397,500	USD	7,393,500	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Call USD	120,000	USD	2,544,000	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	120,000	USD	2,292,000	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	120,000	USD	2,334,000	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	ene-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	ene-26	Buy	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call EUR	600,000	EUR	14,400,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put EUR	600,000	EUR	12,264,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call EUR	600,000	EUR	14,400,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put EUR	600,000	EUR	12,264,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	300,000	USD	5,766,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,580,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	300,000	USD	5,400,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	300,000	USD	5,766,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,580,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	300,000	USD	5,400,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	2,100,000	USD	44,100,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	2,100,000	USD	41,800,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	2,100,000	USD	41,800,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,100,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,990,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,990,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,677	USD	186,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,677	USD	186,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	8,800,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	500,000	USD	8,600,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,960,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,780,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	200,000	USD	3,690,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,960,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,780,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	200,000	USD	3,690,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	300,000	USD	6,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,670,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	300,000	USD	5,520,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	300,000	USD	6,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,670,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	300,000	USD	5,520,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	2,100,000	USD	44,100,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	2,100,000	USD	41,800,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	2,100,000	USD	41,800,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,100,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,990,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,990,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	141,346	USD	3,600,022	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	141,346	USD	2,893,290	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	141,346	USD	3,600,022	MXN	feb-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	141,346	USD	2,893,290	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,091	USD	180,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	4,878	USD	90,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	9,091	USD	180,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	4,878	USD	90,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	16,500	USD	330,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	8,152	USD	150,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	16,500	USD	330,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	8,152	USD	150,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	50,000	USD	882,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	50,000	USD	882,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	882,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	882,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	147,992	USD	2,800,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	153,762	USD	2,800,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	147,992	USD	2,800,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	153,762	USD	2,800,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	825,547	USD	14,323,240	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	825,547	USD	14,323,240	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	1,143,256	USD	19,835,498	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	1,143,256	USD	19,835,498	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	1,143,256	USD	20,149,894	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	1,143,256	USD	19,835,498	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,143,256	USD	20,149,894	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,143,256	USD	19,835,498	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	825,547	USD	14,554,394	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	825,547	USD	14,323,240	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	825,547	USD	14,554,394	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	825,547	USD	14,323,240	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	825,547	USD	14,240,686	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	825,547	USD	14,240,686	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	825,547	USD	14,199,408	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	825,547	USD	14,199,408	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	825,547	USD	14,529,627	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	825,547	USD	14,199,408	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	825,547	USD	14,529,627	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	825,547	USD	14,199,408	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	2,150,000	USD	45,150,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	2,150,000	USD	42,795,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	2,150,000	USD	42,795,750	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	150,000	USD	3,150,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,985,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	150,000	USD	2,985,750	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call EUR	600,000	EUR	14,400,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put EUR	600,000	EUR	12,264,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call EUR	600,000	EUR	14,400,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put EUR	600,000	EUR	12,264,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,251,315	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	21,500	USD	389,903	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	21,500	USD	389,903	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	116,500	USD	2,112,728	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	23,448,555	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	1,500,000	USD	27,202,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	4,000,000	USD	79,340,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	73,340,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	75,340,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	4,000,000	USD	79,340,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	73,340,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	75,340,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	58,202,718	USD	1,280,413,236	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	58,202,718	USD	1,196,647,885	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	58,202,718	USD	1,280,413,236	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	58,202,718	USD	1,196,647,885	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,500,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,500,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,817,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,100,000	USD	24,200,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	1,100,000	USD	18,733,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,100,000	USD	24,200,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	1,100,000	USD	18,733,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,865,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,975,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,945,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,805,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	2,150,000	USD	45,150,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	2,150,000	USD	42,795,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	2,150,000	USD	42,795,750	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	150,000	USD	3,150,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	150,000	USD	2,985,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	150,000	USD	2,985,750	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	21,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	1,000,000	USD	19,905,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Put USD	942	USD	17,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	969,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	919,000	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	90,000	USD	1,645,200	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Put USD	25,000	USD	457,500	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	25,000	USD	468,000	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	25,000	USD	463,750	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	feb-26	Buy	Exercise
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	90,000	USD	1,676,700	MXN	feb-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,222,750	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,299,800	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,273,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,222,750	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,299,800	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,273,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	69,000	USD	1,175,484	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	21,500	USD	366,274	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	116,500	USD	1,984,694	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	22,027,548	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	25,554,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	885,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	50,000	USD	845,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	885,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	50,000	USD	845,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	890,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	50,000	USD	850,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	890,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	50,000	USD	850,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	1,300,000	USD	26,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,025,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,885,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,885,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,025,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,885,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,885,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,050,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,871,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,871,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,050,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,871,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,871,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,982,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,932,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,932,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,982,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,932,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,932,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	8,707	USD	178,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,707	USD	178,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	10,025,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	9,400,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,500,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	200,000	USD	3,910,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,840,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	200,000	USD	3,720,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,910,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,840,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	200,000	USD	3,720,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	3,581	USD	70,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	3,581	USD	70,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	285,000	USD	5,130,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	285,000	USD	5,130,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,215,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,215,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	8,800,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	500,000	USD	8,600,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	285,000	USD	5,073,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	285,000	USD	5,073,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	69,000	USD	1,175,484	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	21,500	USD	366,274	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	116,500	USD	1,984,694	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,293,000	USD	22,027,548	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	25,554,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	905,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	865,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,990,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,990,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	882,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	882,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	50,000	USD	882,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	882,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	1,456,514	USD	33,526,909	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,456,514	USD	33,526,909	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	1,456,514	USD	26,746,692	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,456,514	USD	26,746,692	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,850,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	6,000,000	USD	102,708,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	6,000,000	USD	102,708,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,150,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,150,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	672,957	USD	11,675,803	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	672,957	USD	11,675,803	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	928,254	USD	16,105,199	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	928,254	USD	16,105,199	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	928,254	USD	16,360,468	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	928,254	USD	16,105,199	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	928,254	USD	16,360,468	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	928,254	USD	16,105,199	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	672,957	USD	11,864,231	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	672,957	USD	11,675,803	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	672,957	USD	11,864,231	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	672,957	USD	11,675,803	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	672,957	USD	11,608,508	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	672,957	USD	11,608,508	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	672,957	USD	11,574,860	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	672,957	USD	11,574,860	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	672,957	USD	11,844,043	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	672,957	USD	11,574,860	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	672,957	USD	11,844,043	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	672,957	USD	11,574,860	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,800,000	USD	37,800,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	1,800,000	USD	35,829,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	1,800,000	USD	35,829,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	1,500,000	USD	31,500,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	29,857,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	29,857,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	300,000	USD	6,300,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,971,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	300,000	USD	5,971,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,967,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,917,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,917,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,967,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,917,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,917,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	36,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	500,000	USD	8,800,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,600,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	250,000	USD	4,400,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	250,000	USD	4,300,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,990,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,990,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,940,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	947,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	922,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	33,750	USD	641,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	33,750	USD	622,013	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	33,750	USD	612,563	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,999,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,949,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,949,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,999,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,949,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,949,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	1,013	USD	19,238	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	521	USD	9,450	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	77,800,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	4,000,000	USD	73,800,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	71,800,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	4,000,000	USD	77,800,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	4,000,000	USD	73,800,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	4,000,000	USD	71,800,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	67,000	USD	1,169,150	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,139,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,000,000	USD	22,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	1,000,000	USD	17,030,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,216,050	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,293,100	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,246,200	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	67,000	USD	1,212,700	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	67,000	USD	1,286,400	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	67,000	USD	1,242,850	MXN	mar-26	Buy	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,902,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,849,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	2,000,000	USD	42,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	2,000,000	USD	39,810,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	2,000,000	USD	39,810,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	200,000	USD	4,200,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	200,000	USD	3,981,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	200,000	USD	3,981,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	1,500,000	USD	31,500,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	1,500,000	USD	29,857,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	1,500,000	USD	29,857,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	300,000	USD	6,300,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	300,000	USD	5,971,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	300,000	USD	5,971,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	500,000	USD	9,000,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	500,000	USD	8,850,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	963,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	913,750	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	50,000	USD	959,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	50,000	USD	914,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	50,000	USD	934,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	22,500	USD	427,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	22,500	USD	414,675	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	22,500	USD	408,375	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	2,005,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,005,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	11,181,526	USD	245,709,562	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	11,181,526	USD	229,635,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	11,181,526	USD	245,709,562	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	11,181,526	USD	229,635,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	675	USD	12,825	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	347	USD	6,300	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Put USD	100,000	USD	1,825,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,900,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	1,855,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,346,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,382,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Exercise

CallPut	Nominal	Ccy1	Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,562,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,386,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	125,000	USD	2,593,750	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	125,000	USD	2,397,500	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,005,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	100,000	USD	2,005,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Call USD	100,000	USD	1,955,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	10,549	USD	216,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,780	USD	180,000	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	8,598	USD	176,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Sell	Expiry
Call USD	9,458	USD	196,250	MXN	mar-26	Buy	Expiry
Put USD	600,000	USD	10,800,000	MXN	mar-26	Buy	Exercise
Put USD	600,000	USD	10,800,000	MXN	mar-26	Sell	Exercise

Liquidados Anticipadamente

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00871391	24/02/2026	Unwound	1,000,000	usd	-	1,000,000	-
SPX757	27/02/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
SPX755	27/01/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
SPX738	27/01/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
SPX737	27/02/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
SPX488	25/02/2026	Unwound	12,220,000	usd	12,220,000	12,220,000	-
SPX487	25/02/2026	Unwound	12,220,000	usd	12,220,000	12,220,000	-
SPX476	23/01/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
SPX375	23/01/2026	Unwound	1,000,000	mxn	1,000,000	1,000,000	-
EB7277	13/03/2026	Unwound	37,000,000	mxn	-	-	37,000,000.00
EB7276	13/03/2026	Unwound	37,000,000	mxn	-	-	37,000,000.00
EA9819	02/03/2026	Unwound	32,770,000	mxn	-	-	32,770,000.00
EA9817	02/03/2026	Unwound	32,770,000	mxn	-	-	32,770,000.00
EA8227	25/02/2026	Unwound	1,300,000	usd	-	-	1,300,000.00
EA8225	25/02/2026	Unwound	1,300,000	usd	-	-	1,300,000.00
SNT254	19/02/2026	Unwound	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	-
SNT260	27/02/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SNT267	25/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SNT241	20/01/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SNT247	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT249	06/02/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SNT210	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT217	13/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SNT179	24/03/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SNT150	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SNT060	19/02/2026	Unwound	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	-
SNT071	25/02/2026	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SNT072	04/03/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SNT022	18/02/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SNT024	19/03/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SNT054	30/01/2026	Unwound	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
SNT016	18/02/2026	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	-
SNS909	02/01/2026	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
SNS910	02/01/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SNS842	02/01/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SNS843	02/01/2026	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
SNS335	02/01/2026	Unwound	1,250,000,000	mxn	1,250,000,000	1,250,000,000	-
SNJ449	18/02/2026	Unwound	355,000,000	mxn	355,000,000	355,000,000	-
P19965	09/01/2026	Unwound	8,515,571	usd	-	-	8,515,570.89
P19964	09/01/2026	Unwound	8,515,571	usd	-	-	8,515,570.89
P19947	09/01/2026	Unwound	8,901,717	usd	-	-	8,901,716.64
P19945	09/01/2026	Unwound	382,712	usd	-	-	382,712.47
P19941	09/01/2026	Unwound	382,712	usd	-	-	382,712.47
P19940	09/01/2026	Unwound	8,901,717	usd	-	-	8,901,716.64
SLA177	25/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKZ314	19/03/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SKW487	25/02/2026	Unwound	235,000,000	mxn	235,000,000	235,000,000	-
SKW314	04/03/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SKV845	02/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKV534	27/02/2026	Unwound	470,000,000	mxn	470,000,000	470,000,000	-
SKV413	27/02/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
C92724	01/03/2026	Unwound	-	usd/mxn	20,000,000	341,940,000	-
C92723	01/03/2026	Unwound	-	mxn/usd	341,940,000	20,000,000	-
SKU093	19/02/2026	Unwound	315,000,000	mxn	315,000,000	315,000,000	-
SKT987	18/02/2026	Unwound	285,000,000	mxn	285,000,000	285,000,000	-
SKT604	16/02/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SKT420	13/02/2026	Unwound	450,000,000	mxn	450,000,000	450,000,000	-
SKT307	09/01/2026	Unwound	75,008,946	usd	75,008,946	75,008,946	-
SKT299	09/01/2026	Unwound	75,008,946	usd	75,008,946	75,008,946	-
SKS529	09/01/2026	Unwound	10,649,470	usd	10,649,470	10,649,470	-
SKS530	09/01/2026	Unwound	53,341,584	usd	53,341,584	53,341,584	-
SKS527	09/01/2026	Unwound	10,649,470	usd	10,649,470	10,649,470	-
SKS528	09/01/2026	Unwound	53,341,584	usd	53,341,584	53,341,584	-
SKS193	06/02/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SKR989	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SKR930	05/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SKN446	20/01/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SKN065	16/01/2026	Unwound	475,000,000	mxn	475,000,000	475,000,000	-
SKG306	03/02/2026	Unwound	1,200,000	usd	1,200,000	1,200,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
M00143694	03/02/2026	Unwound	1,200,000	usd	-	1,200,000	-
SJN891	03/02/2026	Unwound	1,200,000	usd	1,200,000	1,200,000	-
SJN579	03/02/2026	Unwound	1,200,000	usd	1,200,000	1,200,000	-
SJF363	26/02/2026	Unwound	4,279,706	usd	4,279,706	4,279,706	-
SJF348	26/02/2026	Unwound	4,279,706	usd	4,279,706	4,279,706	-
SJB877	23/01/2026	Unwound	1,791,806	mxn	1,791,806	1,791,806	-
SJB873	23/01/2026	Unwound	1,791,806	mxn	1,791,806	1,791,806	-
SII689	23/01/2026	Unwound	1,672,953	mxn	1,672,953	1,672,953	-
SII688	23/01/2026	Unwound	1,672,953	mxn	1,672,953	1,672,953	-
SIH765	31/03/2026	Unwound	82,500,000	mxn	82,500,000	82,500,000	-
P18822	27/03/2026	Unwound	10,000,000	mxn	-	-	10,000,000.00
SIH684	31/03/2026	Unwound	27,500,000	mxn	27,500,000	27,500,000	-
SIH683	31/03/2026	Unwound	82,500,000	mxn	82,500,000	82,500,000	-
M00038982	31/03/2026	Unwound	27,500,000	mxn	-	27,500,000	-
M00038979	31/03/2026	Unwound	82,500,000	mxn	-	82,500,000	-
P18821	27/03/2026	Unwound	10,000,000	mxn	-	-	10,000,000.00
SIH667	31/03/2026	Unwound	27,500,000	mxn	27,500,000	27,500,000	-
P18820	27/03/2026	Unwound	10,000,000	mxn	-	-	10,000,000.00
P18819	27/03/2026	Unwound	10,000,000	mxn	-	-	10,000,000.00
SIH655	31/03/2026	Unwound	27,500,000	mxn	27,500,000	27,500,000	-
SIH656	31/03/2026	Unwound	82,500,000	mxn	82,500,000	82,500,000	-
SIH350	25/03/2026	Unwound	360,000,000	mxn	360,000,000	360,000,000	-
P18785	17/03/2026	Unwound	17,000,000	mxn	-	-	17,000,000.00
P18783	17/03/2026	Unwound	17,000,000	mxn	-	-	17,000,000.00
P18782	17/03/2026	Unwound	17,000,000	mxn	-	-	17,000,000.00
SIF327	13/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SIB322	08/01/2026	Unwound	989,187,500	mxn	989,187,500	989,187,500	-
SIB199	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SIB160	19/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
P18680	30/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	-	-	100,000,000.00
SHX614	30/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
P18676	30/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	-	-	100,000,000.00
SHX602	30/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SHW913	23/01/2026	Unwound	5,386,557	mxn	5,386,557	5,386,557	-
SHW905	23/01/2026	Unwound	5,386,557	mxn	5,386,557	5,386,557	-
SHL327	28/01/2026	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SGW933	15/01/2026	Unwound	33,582,877	mxn	33,582,877	33,582,877	-
SGO567	26/02/2026	Unwound	7,178,861	usd	7,178,861	7,178,861	-
SGH414	26/03/2026	Unwound	175,000,000	mxn	175,000,000	175,000,000	-
SGH181	26/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SGH178	26/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SGG123	24/03/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SGD029	05/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SGA142	19/02/2026	Unwound	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	-
SFZ970	18/02/2026	Unwound	295,000,000	mxn	295,000,000	295,000,000	-
SFY819	28/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SFY342	20/02/2026	Unwound	75,500,000	mxn	75,500,000	75,500,000	-
SFY314	20/02/2026	Unwound	75,500,000	mxn	75,500,000	75,500,000	-
SDX946	26/02/2026	Unwound	7,178,861	usd	7,178,861	7,178,861	-
SDX386	05/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX350	17/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX356	06/03/2026	Unwound	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDX340	06/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX308	17/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX313	17/03/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDX268	08/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX269	25/02/2026	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	-
SDX270	08/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX240	08/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX255	08/01/2026	Unwound	20,000,000	mxn	20,000,000	20,000,000	-
SDX175	05/02/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
P17278	05/03/2026	Unwound	700,000,000	mxn	-	-	700,000,000.00
P17279	05/03/2026	Unwound	700,000,000	mxn	-	-	700,000,000.00
SDX145	05/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX134	04/03/2026	Unwound	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDX116	16/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDX121	04/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX096	16/02/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDX079	02/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX038	27/02/2026	Unwound	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDX056	03/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX060	02/02/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDX006	08/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDX018	27/02/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SDW961	16/02/2026	Unwound	400,000,000	mxn	400,000,000	400,000,000	-
SDW863	27/02/2026	Unwound	115,000,000	mxn	115,000,000	115,000,000	-
SDW822	30/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW754	30/01/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDW715	14/01/2026	Unwound	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDW688	30/01/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDW670	26/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDW643	26/02/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDW614	26/02/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDW455	14/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW434	12/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW436	29/01/2026	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDW410	12/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW387	12/02/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDW319	29/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW305	12/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW197	25/02/2026	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	-
SDW192	29/01/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDW155	28/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW114	12/02/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SDW084	13/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV996	11/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDW003	31/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV961	13/01/2026	Unwound	170,000,000	mxn	170,000,000	170,000,000	-
SDV977	25/02/2026	Unwound	140,000,000	mxn	140,000,000	140,000,000	-
SDV983	28/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV934	24/02/2026	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	-
SDV948	28/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV885	23/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV895	22/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV907	22/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV854	23/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV826	23/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV842	27/01/2026	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	-
SDV793	23/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV800	31/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV805	27/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV816	11/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV752	23/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV745	26/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDV676	26/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV685	26/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV709	26/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV603	26/03/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDV621	10/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV633	23/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV579	26/01/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDV587	20/02/2026	Unwound	47,500,000	mxn	47,500,000	47,500,000	-
SDV528	26/01/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDV526	10/02/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV469	23/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV488	10/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV419	07/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV430	10/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV437	25/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV439	26/03/2026	Unwound	440,000,000	mxn	440,000,000	440,000,000	-
MNF334	17/03/2026	Unwound	80,000,000	mxn	-	80,000,000	-
MNF330	12/03/2026	Unwound	17,899,999	usd	-	17,899,999	-
SDV365	20/02/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDV369	24/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV333	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SDV340	26/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDV299	26/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDV244	26/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDV265	26/03/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDV191	01/03/2026	Unwound	223,549,140	mxn	223,549,140	223,549,140	-
SDV113	26/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV027	26/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDV029	18/03/2026	Unwound	280,000,000	mxn	280,000,000	280,000,000	-
SDV036	02/01/2026	Unwound	1,250,000,000	mxn	1,250,000,000	1,250,000,000	-
SDV037	28/01/2026	Unwound	1,500,000,000	mxn	1,500,000,000	1,500,000,000	-
SDU851	28/01/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SDU856	28/01/2026	Unwound	1,000,000,000	mxn	1,000,000,000	1,000,000,000	-
SDU806	05/01/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU800	09/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU743	19/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU680	05/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU687	19/02/2026	Unwound	90,000,000	mxn	90,000,000	90,000,000	-
SDU625	23/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU635	09/02/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDU656	06/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU666	23/01/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDU597	06/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU615	19/02/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
SDU546	22/01/2026	Unwound	2,940,000,000	mxn	2,940,000,000	2,940,000,000	-
SDU499	25/03/2026	Unwound	300,000,000	mxn	300,000,000	300,000,000	-
SDU514	01/01/2026	Unwound	414,129,324	mxn	414,129,324	414,129,324	-
SDU437	25/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU471	06/03/2026	Unwound	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDU387	06/02/2026	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	-
SDU414	22/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU295	02/01/2026	Unwound	500,000,000	mxn	500,000,000	500,000,000	-
SDU314	06/02/2026	Unwound	40,000,000	mxn	40,000,000	40,000,000	-
SDU255	16/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU262	06/02/2026	Unwound	70,000,000	mxn	70,000,000	70,000,000	-
SDU285	02/01/2026	Unwound	750,000,000	mxn	750,000,000	750,000,000	-
SDU227	24/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU231	06/02/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDU154	02/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU183	18/02/2026	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	-
SDU132	06/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU145	24/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU147	18/02/2026	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	-
SDU049	01/01/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU066	18/02/2026	Unwound	130,000,000	mxn	130,000,000	130,000,000	-
SDU082	16/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDU009	06/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDU029	24/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDU040	16/01/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDT993	16/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT957	24/03/2026	Unwound	200,000,000	mxn	200,000,000	200,000,000	-
SDT958	16/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT791	06/02/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT713	15/01/2026	Unwound	225,000,000	mxn	225,000,000	225,000,000	-
SDT684	23/03/2026	Unwound	30,000,000	mxn	30,000,000	30,000,000	-
SDT589	15/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT518	15/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT552	23/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT508	30/01/2026	Unwound	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
SDT442	10/03/2026	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDT462	20/03/2026	Unwound	220,000,000	mxn	220,000,000	220,000,000	-
SDT379	15/01/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT385	20/03/2026	Unwound	210,000,000	mxn	210,000,000	210,000,000	-
SDT364	20/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT220	31/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT222	31/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDT192	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SDT128	12/03/2026	Unwound	17,899,999	usd	17,899,999	17,899,999	-
SDT149	19/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDT165	25/03/2026	Unwound	145,000,000	mxn	145,000,000	145,000,000	-
SDT100	12/03/2026	Unwound	17,899,999	usd	17,899,999	17,899,999	-
SDT111	12/03/2026	Unwound	17,899,999	usd	17,899,999	17,899,999	-
SDT006	19/03/2026	Unwound	302,437,938	mxn	302,437,938	302,437,938	-
SDS918	19/03/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDS920	10/03/2026	Unwound	250,000,000	mxn	250,000,000	250,000,000	-
SDS912	19/03/2026	Unwound	150,000,000	mxn	150,000,000	150,000,000	-
SDS913	19/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDS808	10/03/2026	Unwound	230,000,000	mxn	230,000,000	230,000,000	-
SDS811	10/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDS743	17/03/2026	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	-
SDS747	17/03/2026	Unwound	80,000,000	mxn	80,000,000	80,000,000	-
SDS646	17/03/2026	Unwound	577,000	usd	577,000	577,000	-
SDS514	06/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS418	10/03/2026	Unwound	100,000,000	mxn	100,000,000	100,000,000	-
SDS420	10/03/2026	Unwound	120,000,000	mxn	120,000,000	120,000,000	-
SDS231	03/03/2026	Unwound	50,000,000	mxn	50,000,000	50,000,000	-
SDS029	18/03/2026	Unwound	1,800,000	usd	1,800,000	1,800,000	-
SDS035	18/03/2026	Unwound	1,800,000	usd	1,800,000	1,800,000	-
SDS046	01/02/2026	Unwound	526,216,790	mxn	526,216,790	526,216,790	-
SDR997	23/02/2026	Unwound	240,000,000	mxn	240,000,000	240,000,000	-
SDR944	20/02/2026	Unwound	47,500,000	mxn	47,500,000	47,500,000	-
C67428	12/01/2026	Unwound	-	mxn/usd	175,550,000	10,000,000	-
C67388	12/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	10,000,000	175,550,000	-
C67396	21/01/2026	Unwound	-	mxn/usd	385,230,000	20,000,000	-
C67397	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	20,000,000	385,230,000	-
C67373	21/01/2026	Unwound	-	mxn/usd	393,960,000	20,000,000	-
C67366	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	20,000,000	393,960,000	-
SDG361	18/02/2026	Unwound	45,000,000	mxn	45,000,000	45,000,000	-
SDG359	18/02/2026	Unwound	45,000,000	mxn	45,000,000	45,000,000	-
MGP904	21/01/2026	Unwound	10,000,000	usd	-	10,000,000	-
MGP875	21/01/2026	Unwound	25,000,000	usd	-	25,000,000	-
C59958	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	25,000,000	610,250,000	-
C59952	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	10,000,000	247,900,000	-

Trade ID	Maturity Date	Status	Notional	Currency	PaySide Notional	RcvSide Notional	Option Notional
C59939	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	10,000,000	243,400,000	-
MGK326	21/01/2026	Unwound	15,000,000	usd	-	15,000,000	-
MGK327	21/01/2026	Unwound	10,000,000	usd	-	10,000,000	-
C59752	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	15,000,000	360,450,000	-
MGH655	21/01/2026	Unwound	10,000,000	usd	-	10,000,000	-
C59643	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	10,000,000	243,500,000	-
C53920	21/01/2026	Unwound	-	usd/mxn	4,686,000	86,362,980	-
SAI949	28/01/2026	Unwound	166,900,000	mxn	166,900,000	166,900,000	-
SAI947	28/01/2026	Unwound	3,750,000	usd	3,750,000	3,750,000	-
MZ4450	28/01/2026	Unwound	166,900,000	mxn	-	166,900,000	-
SAI927	28/01/2026	Unwound	166,900,000	mxn	166,900,000	166,900,000	-
SAI926	28/01/2026	Unwound	166,900,000	mxn	166,900,000	166,900,000	-
MZ4444	28/01/2026	Unwound	3,750,000	usd	-	3,750,000	-
SAI919	28/01/2026	Unwound	3,750,000	usd	3,750,000	3,750,000	-
SAI918	28/01/2026	Unwound	3,750,000	usd	3,750,000	3,750,000	-
SU6729	30/01/2026	Unwound	2,075,000,000	mxn	2,075,000,000	2,075,000,000	-
C38368	21/01/2026	Unwound	-	mxn/usd	86,362,980	4,686,000	-

CallPut	Nominal	Ccy1	Other Nominal	Ccy2	Maturity Date	B/S	Last event
Put USD	220,000	USD	4,624,400	MXN	ene-26	Buy	Unwind
Put USD	220,000	USD	4,624,400	MXN	ene-26	Sell	Unwind
Put USD	220,000	USD	4,699,200	MXN	ene-26	Sell	Unwind
Put USD	220,000	USD	4,699,200	MXN	ene-26	Buy	Unwind
Put USD	275,000	USD	6,061,000	MXN	feb-26	Buy	Unwind
Put USD	275,000	USD	6,061,000	MXN	feb-26	Sell	Unwind
Put USD	312,500	USD	6,890,625	MXN	mar-26	Buy	Unwind
Put USD	275,000	USD	5,953,750	MXN	mar-26	Buy	Unwind
Put USD	312,500	USD	6,890,625	MXN	mar-26	Sell	Unwind
Put USD	275,000	USD	5,953,750	MXN	mar-26	Sell	Unwind
Put USD	600,000	USD	10,800,000	MXN	mar-26	Sell	Unwind

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD/UNWIND	03/02/2026	USD	(700,000)	MXN	14,858,200
FWD/UNWIND	02/18/2026	USD	(150,000)	MXN	2,918,850
FWD/UNWIND	03/11/2026	USD	(500,000)	MXN	9,592,500
FWD/UNWIND	03/11/2026	USD	(725,000)	MXN	13,931,890
FWD/UNWIND	03/11/2026	USD	(1,000,000)	MXN	19,397,400
FWD/UNWIND	01/07/2026	USD	200,000	MXN	(3,800,000)
FWD/UNWIND	01/05/2026	USD	300,000	MXN	(5,685,540)
FWD/UNWIND	01/14/2026	USD	200,000	MXN	(3,770,000)
FWD/UNWIND	01/15/2026	USD	200,000	MXN	(3,768,200)
FWD/UNWIND	01/09/2026	USD	(250,000)	MXN	4,591,750
FWD/UNWIND	01/09/2026	USD	(200,000)	MXN	3,673,800
FWD/UNWIND	01/02/2026	USD	(200,000)	MXN	3,672,620
FWD/UNWIND	01/16/2026	USD	(600,000)	MXN	11,002,560
FWD/UNWIND	01/09/2026	USD	(600,000)	MXN	10,998,960
FWD/UNWIND	02/03/2026	USD	(600,000)	MXN	11,003,280
FWD/UNWIND	01/30/2026	USD	(600,000)	MXN	11,002,140
FWD/UNWIND	02/10/2026	USD	(250,000)	MXN	4,575,200
FWD/UNWIND	01/23/2026	USD	(250,000)	MXN	4,574,200
FWD/UNWIND	01/08/2026	USD	(250,000)	MXN	4,569,000
FWD/UNWIND	01/21/2026	USD	200,000	MXN	(3,722,600)
FWD/UNWIND	01/21/2026	USD	400,000	MXN	(7,340,800)
FWD/UNWIND	01/30/2026	USD	200,000	MXN	(3,646,000)
FWD/UNWIND	01/30/2026	USD	300,000	MXN	(5,479,200)
FWD/UNWIND	01/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,797,800
FWD/UNWIND	01/13/2026	USD	(150,000)	MXN	2,800,200
FWD/UNWIND	01/14/2026	USD	(150,000)	MXN	2,781,150
FWD/UNWIND	01/14/2026	USD	(150,000)	MXN	2,777,700
FWD/UNWIND	02/04/2026	USD	200,000	MXN	(3,669,000)
FWD/UNWIND	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(905,010)

DESCR	Value Date	CCY1	Amount 1	CCY2	Amount2
FWD/UNWIND	01/21/2026	USD	(250,000)	MXN	4,531,250
FWD/UNWIND	02/05/2026	USD	(250,000)	MXN	4,511,250
FWD/UNWIND	01/05/2026	USD	(50,000)	MXN	918,155
FWD/UNWIND	02/06/2026	USD	300,000	MXN	(5,449,500)
FWD/UNWIND	02/10/2026	USD	300,000	MXN	(5,460,000)
FWD/UNWIND	01/29/2026	USD	(240,000)	MXN	4,293,312
FWD/UNWIND	02/11/2026	USD	300,000	MXN	(5,409,000)
FWD/UNWIND	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(893,405)
FWD/UNWIND	03/02/2026	USD	(150,000)	MXN	2,665,200
FWD/UNWIND	03/06/2026	USD	(150,000)	MXN	2,657,955
FWD/UNWIND	02/24/2026	USD	200,000	MXN	(3,600,000)
FWD/UNWIND	02/20/2026	USD	200,000	MXN	(3,586,300)
FWD/UNWIND	02/17/2026	USD	(477,400)	MXN	8,455,757
FWD/UNWIND	02/25/2026	USD	300,000	MXN	(5,319,600)
FWD/UNWIND	03/20/2026	USD	(500,000)	MXN	8,819,300
FWD/UNWIND	03/27/2026	USD	(150,000)	MXN	2,647,350
FWD/UNWIND	03/25/2026	USD	(300,000)	MXN	5,256,900
FWD/UNWIND	03/24/2026	USD	(300,000)	MXN	5,255,700
FWD/UNWIND	03/23/2026	USD	(300,000)	MXN	5,254,650
FWD/UNWIND	03/05/2026	USD	(250,000)	MXN	4,356,275
FWD/UNWIND	03/04/2026	USD	(250,000)	MXN	4,355,850
FWD/UNWIND	03/03/2026	USD	(300,000)	MXN	5,226,540
FWD/UNWIND	02/26/2026	USD	(400,000)	MXN	6,967,360
FWD/UNWIND	03/27/2026	USD	100,000	MXN	(1,762,630)
FWD/UNWIND	02/09/2026	USD	500,000	MXN	(8,612,500)
FWD/UNWIND	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(864,105)
FWD/UNWIND	03/26/2026	USD	(1,700,000)	MXN	29,763,600
FWD/UNWIND	03/23/2026	USD	200,000	MXN	(3,514,400)
FWD/UNWIND	03/26/2026	USD	300,000	MXN	(5,316,150)
FWD/UNWIND	03/31/2026	USD	(100,000)	MXN	1,741,000
FWD/UNWIND	02/25/2026	USD	(200,000)	MXN	3,458,140
FWD/UNWIND	02/25/2026	USD	(200,000)	MXN	3,457,800
FWD/UNWIND	02/24/2026	USD	(200,000)	MXN	3,457,400
FWD/UNWIND	03/09/2026	USD	(600,000)	MXN	10,335,900
FWD/UNWIND	03/31/2026	USD	50,000	MXN	(864,885)
FWD/UNWIND	03/20/2026	USD	(120,000)	MXN	2,128,764
FWD/UNWIND	03/20/2026	USD	(600,000)	MXN	10,727,280

Resumen de Instrumentos Financieros Derivados

Cifras expresadas en pesos

Tipo de derivado, valor o	Cobertura o Nego	Nocional	Posición	ACTIVO SUBYACENTE		VALOR RAZONABLE		MONTOS DE VENCIMIENTOS POR AÑO			Colateral/ Línea de crédito/Valores
				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	296,986,362,000	Compra	Divisas	Divisas	221,986,872,228	291,443,810,219	289,550,418,588	7,435,943,412	-	LINEA DE CREDITO
Forwards	NEGO	(296,967,334,236)	Venta	Divisas	Divisas	(221,994,461,122)	(291,443,506,411)	(289,525,855,625)	(7,441,478,611)	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	5,199,139,811	Compra	Acción	Acción	259,685,203	147,861,581	-	5,199,139,811	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,090,977,944.00	Venta	Acción	Acción	(119,045,781)	(78,291,366)	-	1,090,977,944.00	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	19,050,022,284	Compra	Divisas	Divisas	1,065,140,168	1,219,223,203	4,876,677,808	7,034,885,462	7,138,459,013.66	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	18,382,308,584	Venta	Divisas	Divisas	(1,026,990,326)	(1,131,465,112)	4,876,677,808	6,367,171,762	7,138,459,013.66	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,434,245,600	Compra	Índice	Índice	323,664,711	222,528,437	-	2,434,245,600	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,287,700,000	Venta	Índice	Índice	(68,146,011)	(59,460,786)	-	1,287,700,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	52,002,046,409	Compra	Tasas	Tasas	168,873,213	248,251,066	3,496,575,708	42,396,641,203	6,108,829,498	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	51,617,545,966	Venta	Tasas	Tasas	(168,145,949)	(246,779,092)	3,496,575,708	42,180,589,615	5,940,380,643	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,271,872,113	Compra	Acción NE	Acción NE	(127,352,872)	(122,108,967)	-	2,271,872,113	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	2,184,755,641	Venta	Acción NE	Acción NE	(13,286,550)	52,538,752	-	2,184,755,641	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	737,660,000	Compra	Índice NE	Índice NE	43,769,880	41,068,989	-	737,660,000	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,884,205,600	Venta	Índice NE	Índice NE	(299,288,580)	(204,136,641)	-	1,884,205,600	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,043,274,799	Compra	Divisas NE	Divisas NE	596	44,019,260	-	1,043,274,799	-	LINEA DE CREDITO
Opción	NEGO	1,043,274,799	Venta	Divisas NE	Divisas NE	(45,818)	(79,649,313)	-	1,043,274,799	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	3,132,658,288	IRS	Fija / Variable Usd, Usd	Fija / Variable Usd, Usd	12,787,509	14,092,581	-	2,243,165,813	889,492,475	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	104,404,764,534	IRS	Fija / Variable Mxn, Mxn	Fija / Variable Mxn, Mxn	(1,732,425,414)	(559,244,659)	700,000,000	81,088,584,541	22,616,179,993	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	5,377,560,000	IRS	Variable / Fija Usd, Usd	Variable / Fija Usd, Usd	217,820,928	230,416,631	-	2,688,780,000	2,688,780,000	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	1,041,518,470	IRS	Variable / Variable Usd, Usd	Variable / Variable Usd, Usd	(265,414)	(222,886)	-	551,311,378	490,207,092	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	338,175,225	XXYC	Variable / Variable Usd, Mxn	Variable / Variable Usd, Mxn	274,870,354	376,532,634	-	255,197,678	82,977,547	LINEA DE CREDITO
Swaps	COBE	445,775,581	XXYC	Fija / Fija Usd, Mxn	Fija / Fija Usd, Mxn	225,609,152	221,075,266	-	71,380,000	374,395,581	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	1,076,625,572,454	IRS	Fija / Variable MXN, MXN	Fija / Variable MXN, MXN	(8,710,155,097)	(1,580,626,271)	291,358,521,859	635,979,621,358	149,287,429,237	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	205,847,415,839	IRS	Fija / Variable Usd, Usd	Fija / Variable Usd, Usd	174,072,478	880,329,129	16,744,423,674	93,864,375,504	95,238,616,661	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	44,916,519	IRS	Fija / Fija Usd, Usd	Fija / Fija Usd, Usd	7,664,002	8,595,491	42,163,673.37	2,290,995	461,850	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	3,667,163	IRS	Fija / Fija MXN, MXN	Fija / Fija MXN, MXN	1,634,765	1,443,258	-	3,667,163	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	197,680,552,212	IRS	Variable / Fija Usd, Usd	Variable / Fija Usd, Usd	(66,690,091)	(774,124,994)	4,034,997,989	98,617,756,384	95,027,797,839	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	1,088,960,338,386	IRS	Variable / Fija MXN, MXN	Variable / Fija MXN, MXN	7,749,470,184	1,427,517,904	281,828,000,000	654,557,265,194	152,575,073,193	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	3,314,261,929	IRS	Variable / Variable Usd, Usd	Variable / Variable Usd, Usd	(50,850)	42,340	-	724,966,789	2,589,295,140	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	21,500,000,000	IRS	Variable / Variable MXN, MXN	Variable / Variable MXN, MXN	(297,197)	(132,132)	-	21,500,000,000	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	1,193,590,678	XXYC	Fija / Fija Usd, MXN	Fija / Fija Usd, MXN	1,248,413,214	1,358,195,777	-	135,335,167	1,058,255,511	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	105,511,963	XXYC	Fija / Fija EUR, MXN	Fija / Fija EUR, MXN	139,882,072	250,787,432	-	-	105,511,963	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(105,511,963)	XXYC	Fija / Fija MXN, EUR	Fija / Fija MXN, EUR	(128,291,286)	(238,948,128)	-	-	(105,511,963)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(1,198,840,307)	XXYC	Fija / Fija MXN, USD	Fija / Fija MXN, USD	(1,237,750,454)	(1,315,638,350)	-	(135,335,167)	(1,063,505,140)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	-	XXYC	Fija / Fija USD, COP	Fija / Fija USD, COP	(51,090,941)	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	-	XXYC	Fija / Fija COP, USD	Fija / Fija COP, USD	51,090,941	-	-	-	-	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(362,918,495)	XXYC	Fija / Variable MXN, Usd	Fija / Variable MXN, Usd	(333,815,206)	(362,776,120)	-	(266,096,765)	(96,821,730)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	308,017,655	XXYC	Fija / Variable USD, MXN	Fija / Variable USD, MXN	196,760,929	270,165,220	-	292,537,655	15,480,000.00	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	362,918,495	XXYC	Variable / Fija Usd, MXN	Variable / Fija Usd, MXN	333,707,174	362,811,899	-	266,096,765	96,821,730	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(308,017,655)	XXYC	Variable / Fija MXN, USD	Variable / Fija MXN, USD	(196,564,324)	(286,005,032)	-	(292,537,655)	- 15,480,000.00	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	469,308,830	XXYC	Variable / Variable Usd, mxn	Variable / Variable Usd, mxn	724,946,602	526,206,163	14,435,133.85	467,398,605	(12,524,908)	LINEA DE CREDITO
Swaps	NEGO	(487,209,281)	XXYC	Variable / Variable mxn, usd	Variable / Variable mxn, usd	(713,861,718)	(504,522,759)	- 14,435,133.85	(456,403,077)	(16,371,070)	LINEA DE CREDITO