

**Artículo 181 Fracción XI**

**Montos nominales de los instrumentos financieros derivados por tipo de instrumento y por subyacente**

**DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN**

**I. SWAPS**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
<b>Moneda origen</b>									
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	260	1	18	-	279	7.242651	2,025	1,065	-
Pasivo - Peso	956	-	4	-	960	1.000000	960	-	-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	956	-	2	-	958	1.000000	958	-	-
Pasivo - Udi	260	1	17	-	278	7.242651	2,020	-	1,062
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	55	-	7	-	62	19.891100	1,221	571	-
Pasivo - Peso	705	-	48	-	753	1.000000	753	-	103
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	706	-	53	-	759	1.000000	759	105	-
Pasivo - Dólar	55	-	7	-	62	19.891100	1,223	-	569
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	287	14,929	(2 222)	49,994	0.164030	6,338	6,338	-
Pasivo - Peso	386	-	-	-	386	1.000000	386	-	386
<b>Swap de Tasa de Interés Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	6	464	(1)	469	19.891100	9,332	1,212	-
Pasivo - Dólar	-	6	442	(1)	447	19.891100	8,888	-	768
<b>Swap de Tasa de Interés Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	558	1,058	29,792	(45)	31,363	1.000000	31,363	2,483	-
Pasivo - Peso	558	1,053	29,525	(33)	31,103	1.000000	31,103	-	2,223
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>11,774</b>	<b>5,111</b>

Nota: Las sumas y algunas cifras pueden variar por efectos de redondeo

**Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito**

Reporte del Primer Trimestre de 2022

**Artículo 181 Fracción XI**

**Montos nominales de los instrumentos financieros derivados por tipo de instrumento y por subyacente**

**DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA**

**I. SWAPS**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
<b>Moneda origen</b>									
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	2,814	16	9	-	2,839	7.242651	20,562	3,036	-
Pasivo - Peso	17,031	31	586	2	17,650	1.000000	17,650	-	124
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	10,302	21	665	6	10,994	1.000000	10,994	-	-
Pasivo - Udi	1,864	15	203	(1)	2,081	7.242651	15,075	-	4,081
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	89	-	(2)	-	87	19.891100	1,744	1,744	-
Pasivo - Peso	1,437	2	(68)	-	1,371	1.000000	1,371	-	1,371
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	3,537	10	723	1	4,271	1.000000	4,271	4,271	-
Pasivo - Dólar	182	2	59	-	243	19.891100	4,846	-	4,846
<b>Swap de Tasa de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	12	-	0	-	12	19.891100	245	245	-
Pasivo - Peso	221	-	(3)	-	218	1.000000	218	-	218
<b>Swap de Tasa de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	4,432	105	(178)	-	4,359	1.000000	4,359	4,359	-
Pasivo - Peso	306	1	6	-	313	19.891100	6,217	-	6,217
<b>Swap de Tasa de Interés Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	24,469	1,881	40 318	(15)	66,653	1.000000	66,653	4,986	-
Pasivo - Peso	24,469	871	37 940	3	63,283	1.000000	63,283	-	1,616
<b>TOTAL COBERTURA</b>								<b>18,641</b>	<b>18,473</b>

Nota: Las sumas y algunas cifras pueden variar por efectos de redondeo

**Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito**

Reporte del Primer Trimestre de 2022