

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	
Swap Udi / Peso									
Activo - Udis	231	1	9	-	241	7.529183	1,817	966	-
Pasivo - Peso	848	-	3	-	851	1.000000	851	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	848	-	(2)	-	846	1.000000	846	-	-
Pasivo - Udi	231	1	8	-	240	7.529183	1,804	-	958
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	51	-	4	-	55	20.127100	1,109	528	-
Pasivo - Peso	660	-	16	-	676	1.000000	676	-	95
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	660	-	16	-	676	1.000000	676	95	-
Pasivo - Dólar	51	-	4	(1)	54	20.127100	1,094	-	513
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	288	14,111	(2 642)	48,757	0.138840	6,769	6,769	-
Pasivo - Peso	384	2	2,160	-	2,546	1.000000	2,546	-	2,546
Swap de Tasa de Interés Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	12	531	-	543	20.127100	10,919	2,572	-
Pasivo - Dólar	-	11	509	(8)	512	20.127100	10,313	-	1,966
Swap de Tasa de Interés Peso / Peso									
Activo - Peso	565	1,132	30,351	(103)	31,945	1.000000	31,945	3,422	-
Pasivo - Peso	565	1,127	30,058	(100)	31,650	1.000000	31,650	-	3,127
TOTAL NEGOCIACIÓN								14,352	9,205

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Tercer 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	

Swap Udi / Peso

	Moneda origen	Moneda Nacional	
Activo - Udis	2,614	16	(54)
Pasivo - Peso	16,281	66	542

Swap Peso / Udi

Activo - Peso	11,866	31	884	4	12,785	1.000000	12,785	11	-
Pasivo - Udi	2,064	17	192	-	2,273	7.529183	17,110	-	4,336

Swap Dólar / Peso

Activo - Dólar	84	-	(3)	-	81	20.127100	1,623	1,623	-
Pasivo - Peso	1,371	2	(66)	-	1,307	1.000000	1,307	-	1,307

Swap Peso / Dólar

Activo - Peso	3,539	11	671	2	4,223	1.000000	4,223	4,223	-
Pasivo - Dólar	182	2	46	-	230	20.127100	4,636	-	4,636

Swap de Tasa de Interés (Flujo de efectivo) Peso / Dólar

Activo - Dólar	4,432	106	(209)	-	4,329	1.000000	4,329	4,329	-
Pasivo - Peso	307	2	4	-	313	20.127100	6,293	-	6,293

Swap de Tasa de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso

Activo - Dólar	11	-	1	-	12	20.127100	242	242	-
Pasivo - Peso	209	-	(10)	-	199	1.000000	199	-	199

Swap de Tasa de Interés Peso / Peso

Activo - Peso	21,209	2,952	49 218	(65)	73,314	1.000000	73,314	8,833	-
Pasivo - Peso	21,209	1,259	44 787	1	67,256	1.000000	67,256	-	2,775

TOTAL COBERTURA							21,763	19,553	
------------------------	--	--	--	--	--	--	---------------	---------------	--

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Tercer Trimestre de 2022