

**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 Udi / Peso</b>										
Activo - Udis	246	1	13	-	260	7.361518	1,917	1,011	-	
Pasivo - Peso	903	-	3	-	906	1.000000	906	-	-	
<b>Swap Peso / Udi</b>										
Activo - Peso	903	-	(3)	-	900	1.000000	900	-	-	
Pasivo - Udi	246	1	11	-	258	7.361518	1,902	-	1,002	
<b>Swap Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	53	-	6	-	59	20.135300	1,183	573	-	
Pasivo - Peso	683	-	25	-	708	1.000000	708	-	98	
<b>Swap Peso / Dólar</b>										
Activo - Peso	683	-	26	-	709	1.000000	709	98	-	
Pasivo - Dólar	53	-	6	(1)	58	20.135300	1,171	-	560	
<b>Swap Yen / Peso</b>										
Activo - Yen	37,000	9	14,999	(3 264)	48,744	0.148200	7,224	7,224	-	
Pasivo - Peso	384	1	2,197	-	2,582	1.000000	2,582	-	2,582	
<b>Swap de Tasa de Interés Dólar / Dólar</b>										
Activo - Dólar	-	5	500	-	505	20.135300	10,165	1,501	-	
Pasivo - Dólar	-	4	478	-	482	20.135300	9,629	-	965	
<b>Swap de Tasa de Interés Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	540	1,052	30,777	(48)	32,321	1.000000	32,321	3,066	-	
Pasivo - Peso	540	1,048	30,479	(83)	31,984	1.000000	31,984	-	2,729	
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>13,473</b>	<b>7,936</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 Segundo 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**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Udis	2,814	31	13	-	2,858	7.242651	21,044	3,411	
Pasivo - Peso	17,031	52	547	3	17,633	1.000000	17,633		

**Swap Peso / Udi**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Peso	10,382	21	635	2	11,040	1.000000	11,040		
Pasivo - Udi	1,873	13	198	-	2,084	7.242651	15,344		4,304

**Swap Dólar / Peso**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Dólar	84	-	(2)	-	82	19.891100	1,652	1,652	
Pasivo - Peso	1,388	2	(68)	-	1,322	1.000000	1,322		1,322

**Swap Peso / Dólar**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Peso	3,540	10	685	1	4,236	1.000000	4,236	4,236	
Pasivo - Dólar	182	3	62	-	247	19.891100	4,976		4,976

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

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Dólar	11	-	1	-	12	19.891100	240	240	
Pasivo - Peso	216	-	(9)	-	207	1.000000	207		207

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

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Dólar	4,432	43	(211)	-	4,264	1.000000	4,264	4,264	
Pasivo - Peso	306	1	6	-	313	19.891100	6,309		6,309

**Swap de Tasa de Interés Peso / Peso**

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Activo	Pasivo
Activo - Peso	23,232	1,965	47 218	(29)	72,386	1.000000	72,386	7,315	
Pasivo - Peso	23,233	1,356	43 044	2	67,635	1.000000	67,635		2,564

<b>TOTAL COBERTURA</b>								<b>21,118</b>	<b>19,682</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 Segundo Trimestre de 2022