

**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	201	1	1	-	203	7.774887	1,580	840	-
Pasivo - Peso	738	-	2	-	740	1.000000	740	-	-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	738	-	(1)	-	737	1.000000	737	-	-
Pasivo - Udi	201	1	-	-	202	7.774887	1,571	-	834
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	48	-	4	-	52	18.020100	925	379	-
Pasivo - Peso	614	-	24	-	638	1.000000	638	-	92
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	614	-	25	-	639	1.000000	639	93	-
Pasivo - Dólar	48	-	4	-	52	18.020100	920	-	374
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	287	12,696	(2 365)	47,618	0.135490	6,452	6,452	-
Pasivo - Peso	384	1	1,512	-	1,897	1.000000	1,897	-	1,897
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	16	484	-	500	18.020100	8,998	1,897	-
Pasivo - Dólar	-	15	463	(4)	474	18.020100	8,559	-	1,458
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	568	1,218	30,030	(105)	31,711	1.000000	31,711	2,967	-
Pasivo - Peso	568	1,213	29,745	(25)	31,501	1.000000	31,501	-	2,757
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>12,628</b>	<b>7,412</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 2023

**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	2,973	20	91	-	1	3,083	7.774887	23,970	4,187	-
Pasivo - Peso	19,010	76	697	-	-	19,783	1.000000	19,783	-	-
<b>Swap Peso / Udi</b>										
Activo - Peso	11,072	41	1 359	-	7	12,479	1.000000	12,479	-	-
Pasivo - Udi	1,812	18	307	-	-	2,137	7.774887	16,611	-	4,132
<b>Swap Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	78	1	(3)	-	-	76	18.020100	1,364	1,364	-
Pasivo - Peso	1,302	2	(56)	-	-	1,248	1.000000	1,248	-	1,248
<b>Swap Peso / Dólar</b>										
Activo - Peso	3,541	16	712	-	1	4,268	1.000000	4,268	4,268	-
Pasivo - Dólar	183	2	51	-	-	236	18.020100	4,256	-	4,256
<b>Swap Peso / Dólar (Flujo de Efectivo)</b>										
Activo - Peso	2,432	60	(5)	-	-	2,487	1.000000	2,487	2,487	-
Pasivo - Dólar	201	2	0	-	-	203	18.020100	3,650	-	3,650
<b>Swap Dólar / Peso (Flujo de Efectivo)</b>										
Activo - Dólar	11	-	0	-	-	11	18.020100	206	206	-
Pasivo - Peso	197	-	(5)	-	-	192	1.000000	192	-	192
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	17,510	3,015	47 881	-	(26)	68,380	1.000000	68,380	6,337	-
Pasivo - Peso	17,510	1,257	45 629	-	-	64,396	1.000000	64,396	-	2,353
<b>TOTAL COBERTURA</b>								<b>18,849</b>	<b>15,831</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 2023