

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 origen							Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	185	1	1	-	187	7.766768	1,456	773	-
Pasivo - Peso	680	-	2	-	683	1.000000	683	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	680	-	(4)	-	677	1.000000	677	-	-
Pasivo - Udi	185	1	-	-	186	7.766768	1,442	-	765
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	46	-	3	-	49	17.115600	842	318	-
Pasivo - Peso	591	-	24	-	615	1.000000	615	-	91
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	591	-	21	-	612	1.000000	612	89	-
Pasivo - Dólar	46	-	3	-	49	17.115600	833	-	310
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	9	12,847	(2 175)	47,681	0.118580	5,654	5,654	-
Pasivo - Peso	384	1	1,201	-	1,586	1.000000	1,586	-	1,586
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	-	472	- 3	470	17.115600	8,039	1,974	-
Pasivo - Dólar	-	-	454	(14)	440	17.115600	7,525	-	1,461
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	531	1,191	29,226	(112)	30,835	1.000000	30,835	2,871	-
Pasivo - Peso	531	1,187	28,935	(15)	30,638	1.000000	30,638	-	2,674
TOTAL NEGOCIACIÓN								11,679	(6,887)

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 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 nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
Moneda origen									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	2,973	30	54	-	3,056	7.766768	23,739	3,949	-
Pasivo - Peso	19,010	107	672	-	19,789	1.000000	19,789	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	11,170	39	1 356	1	12,565	1.000000	12,565	-	-
Pasivo - Udi	1,825	15	280	-	2,119	7.766768	16,460	-	3,895
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	69	-	(3)	-	66	17.115600	1,133	1,133	-
Pasivo - Peso	1,251	2	(53)	-	1,201	1.000000	1,201	-	1,201
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,544	14	722	-	4,279	1.000000	4,279	4,279	-
Pasivo - Dólar	183	3	61	-	246	17.115600	4,216	-	4,216
Swap Peso / Dólar (Flujo de Efectivo)									
Activo - Peso	10	-	0	-	10	17.115600	168	168	-
Pasivo - Dólar	192	-	(4)	-	188	1.000000	188	-	188
Swap Dólar / Peso (Flujo de Efectivo)									
Activo - Dólar	-	-	0	-	-	1.000000	-	-	-
Pasivo - Peso	-	-	0	-	-	17.115600	-	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	15,238	3,005	48 533	(17)	66,759	1.000000	66,759	6,113	-
Pasivo - Peso	15,239	1,631	46 442	1	63,311	1.000000	63,311	-	2,665
TOTAL COBERTURA								15,642	(12,165)

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 2023