

## 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 nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	169	1	-	-	170	7.871663	1,341	712	-
Pasivo - Peso	622	6	2	-	630	1.000000	629	-	-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	622	6	(1)	6	633	1.000000	633	-	-
Pasivo - Udi	169	1	1	-	169	7.871663	1,335	-	(702)
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	44	-	3	-	47	17.427900	818	328	-
Pasivo - Peso	569	1	6	-	576	1.000000	576	-	(86)
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	568	-	10	-	578	1.000000	578	85	-
Pasivo - Dólar	44	-	3	-	47	17.427900	813	-	(320)
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	288	10,835	(2 002)	46,121	0.116670	5,381	5,381	-
Pasivo - Peso	384	2	1,223	-	1,609	1.000000	1,609	-	(1,609)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	7	510	-	517	17.427900	9,015	2,935	-
Pasivo - Dólar	-	7	492	(7)	492	17.427900	8,557	-	(2,477)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	529	1,297	29,667	(41)	31,452	1.000000	31,453	3,691	-
Pasivo - Peso	529	1,292	29,369	(78)	31,112	1.000000	31,112	-	(3,350)
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>13,132</b>	<b>(8,544)</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 Tercer 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		
<b>Moneda origen</b>										
<b>Swap Udis / Peso</b>										
Activo - Udis	2,973	21	( 193)	-	8	2,793	7.871663	21,987	2,358	-
Pasivo - Peso	19,010	94	618	-	-	19,722	1.000000	19,722	-	(92)
<b>Swap Peso / Udi</b>										
Activo - Peso	20,598	164	1 398	-	3	22,163	1.000000	22,163	331	-
Pasivo - Udi	3,026	26	103	-	-	3,155	7.871663	24,832	-	(3,000)
<b>Swap Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	69	-	( 3)	-	-	66	17.427900	1,152	1,152	-
Pasivo - Peso	1,238	9	( 53)	-	-	1,194	1.000000	1,194	-	(1,194)
<b>Swap Peso / Dólar</b>										
Activo - Peso	7,275	114	587	-	1	7,975	1.000000	7,975	7,975	-
Pasivo - Dólar	402	5	43	-	-	450	17.427900	7,829	-	(7,829)
<b>Swap Peso / Dólar (Flujo de Efectivo)</b>										
Activo - Peso	10	-	-	-	-	10	17.427900	175	175	-
Pasivo - Dólar	188	1	( 11)	-	-	178	1.000000	178	-	(178)
<b>Swap Dólar / Peso (Flujo de Efectivo)</b>										
Activo - Dólar	-	-	-	-	-	-	1.000000	-	-	-
Pasivo - Peso	-	-	-	-	-	-	17.427900	-	-	-
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	14,520	4,104	55 195	( 36)	-	73,783	1.000000	73,783	10,317	-
Pasivo - Peso	14,520	1,199	50 904	-	-	66,623	1.000000	66,623	-	(3,157)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>										
Activo - Peso	-	-	15	-	-	15	17.427900	258	17	-
Pasivo - Peso	-	-	14	-	-	14	17.427900	241	-	-

**TOTAL COBERTURA**

**22,325 (15,450)**

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 2023