

Artículo 181 Fracción XI

Montos nominales de los instrumentos financieros derivados por tipo de instrumento y por subyacente
(cifras en millones de pesos)

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

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	136	1	-	-	137	8.116657	1,113	607	-
Pasivo - Peso	500	5	1	-	506	1.000000	506	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	500	5	1	-	506	1.000000	506	-	-
Pasivo - Udi	136	1	-	-	137	8.116657	1,113	-	(607)
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	41	-	2	-	43	16.562500	710	252	-
Pasivo - Peso	523	2	16	-	541	1.000000	541	-	(83)
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	522	-	24	-	546	1.000000	546	84	-
Pasivo - Dólar	39	-	3	1	43	16.562500	712	-	(250)
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	290	10,133	-	47,247	0.109280	5,006	5,006	-
Pasivo - Peso	384	1	870	-	1,255	1.000000	1,255	-	(1,255)
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	19	447	-	465	16.562500	7,728	2,188	-
Pasivo - Dólar	-	18	430	69	517	16.562500	7,369	-	(1,829)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	473	1,296	28,815	-	30,526	1.000000	30,526	2,532	-
Pasivo - Peso	473	1,293	28,475	24	30,265	1.000000	30,265	-	(2,271)
TOTAL NEGOCIACIÓN								10,669	(6,295)

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 2024

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	3,196	26	- 159	- 4	3,059	8.116657	24,853	3,255	-	
Pasivo - Peso	20,850	110	638	-	21,598	1.000000	21,598	-	-	
Swap Peso / Udi										
Activo - Peso	20,931	194	1,510	4	22,639	1.000000	22,639	9	-	
Pasivo - Udi	3,066	37	141	1	3,245	8.116657	26,333	-	(3,703)	
Swap Dólar / Peso										
Activo - Dólar	66	1	- 3	-	64	16.562500	1,051	1,051	-	
Pasivo - Peso	1,164	9	- 45	-	1,128	1.000000	1,128	-	(1,128)	
Swap Peso / Dólar										
Activo - Peso	38,778	286	4,342	- 3	43,403	1.000000	43,403	43,403	-	
Pasivo - Dólar	2,238	17	270	-	2,525	16.562500	41,827	-	(41,827)	
Swap Peso / Dólar (Flujo de Efectivo)										
Activo - Peso	-	-	-	-	-	1.000000	-	-	-	
Pasivo - Dólar	-	-	-	-	-	16.562500	-	-	-	
Swap Dólar / Peso (Flujo de Efectivo)										
Activo - Dólar	10	-	-	-	10	16.562500	171	171	-	
Pasivo - Peso	179	1	- 6	-	174	1.000000	174	-	(174)	
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso										
Activo - Peso	13,761	4,252	57,095	(14)	75,094	1.000000	75,094	7,454	-	
Pasivo - Peso	13,761	1,344	54,283	-	69,388	1.000000	69,388	-	(1,748)	
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar										
Activo - Peso	-	-	12	-	12	16.562500	203	-	-	
Pasivo - Peso	-	-	12	-	12	16.562500	209	-	(6)	
TOTAL COBERTURA							55,343	(48,586)		

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 2024