

Reportos y préstamo de valores

(Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Operaciones de Reporto y Préstamo de Valores

	Monto del reporto	Intereses a favor	Intereses a cargo	Premios devengados	Efecto por valuación	Valor de mercado
Deudores por reporto						
Deuda gubernamental						
Bonos de Tasa Variable	\$ 1,944	\$ -	\$ -	\$ 0	\$ -	\$ 1,944
Bonos de Protección al Ahorro Bancario	11,056	-	-	18	-	11,074
	<u>\$ 13,000</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 18</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 13,018</u>
Deuda gubernamental extranjera						
Treasury Bills	\$ 27,245	\$ -	\$ -	\$ 0	\$ -	\$ 27,245
	<u>\$ 27,245</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 27,245</u>
Total de Deudores por reporto antes de compensación						\$ 40,263
Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía						(1,208)
Total de Deudores por reporto después de compensación						\$ 39,055
Colaterales Vendidos o Dados en garantía en operaciones de reporto						
Deuda gubernamental						
Bonos de Tasa Variable	\$ 1,208	\$ -	\$ -	\$ 0	\$ -	\$ 1,208
Bonos de Tasa Fija	1,854	-	-	21	(24)	1,851
	<u>\$ 3,062</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 21</u>	<u>\$ (24)</u>	<u>\$ 3,059</u>
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía por reporto antes de compensación						\$ 3,059
Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía						(1,208)
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en operaciones de reporto						\$ 1,851
Préstamo de valores						
Deuda gubernamental						
Certificados de la Tesorería de la Federación	\$ 925	\$ -	\$ 6	\$ -	\$ (1)	\$ 930
Udibonos	15	-	0	-	(0)	15
Bonos de Tasa Fija	12,984	-	269	-	(58)	13,195
	<u>\$ 13,924</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 275</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ (59)</u>	<u>\$ 14,140</u>
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en préstamo de valores						\$ 14,140
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía						\$ 15,991