



Reportos y préstamo de valores

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2020)

	Monto del reporto	Intereses a favor	Intereses a cargo	Premios devengados	Efecto por valuación	Valor de mercado
Deudores por reporte						
Deuda gubernamental						
Bonos de Tasa Variable	\$ 3,000	\$ -	\$ -	\$ 3	\$ -	\$ 3,003
Bonos de Protección al Ahorro Bancario	512	-	-	2	-	514
Certificados de la Tesorería de la Federación	3,000	-	-	1	-	3,001
	<u>\$ 6,512</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 6</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 6,518</u>
Deuda gubernamental extranjera						
Treasury Bonds	\$ 1,409	\$ -	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 1,409
	<u>\$ 1,409</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 1,409</u>
Total de Deudores por reporte antes de compensación						\$ 7,927
Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía						(3,558)
Total de Deudores por reporte después de compensación						\$ 4,369
Acreeedores por reporte						
Deuda gubernamental						
Bonos de Tasa Fija	\$ 329	\$ -	\$ -	\$ 0	\$ -	\$ 329
	<u>\$ 329</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 0</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 329</u>
Total de Acreeedores por reporte						\$ 329
Colaterales Vendidos o Dados en garantía en operaciones de reporte						
Reportos						
Deuda gubernamental						
Certificados de la Tesorería de la Federación	\$ 2,331	\$ -	\$ -	\$ 1	\$ 0	\$ 2,332
Bonos de Tasa Variable	924	-	-	0	0	924
Bonos de Protección al Ahorro Bancario	300	-	-	2	(0)	302
Bonos de Tasa Fija	1,927	-	-	19	49	1,995
	<u>\$ 5,482</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 22</u>	<u>\$ 49</u>	<u>\$ 5,553</u>
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía por reporte antes de compensación						\$ 5,553
Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía						(3,558)
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en operaciones de reporte						\$ 1,995
Préstamo de valores						
Deuda gubernamental						
Certificados de la Tesorería de la Federación	\$ 61	\$ -	\$ -	\$ -	\$ 0	\$ 61
Udibonos	12	-	-	-	(1)	11
Bonos de Tasa Fija	4,531	-	93	-	60	4,684
	<u>\$ 4,604</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 93</u>	<u>\$ -</u>	<u>\$ 59</u>	<u>\$ 4,756</u>
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en préstamo de valores						\$ 4,756
Total de Colaterales vendidos o dados en garantía						\$ 6,751