

# Reportos y préstamo de valores

(Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre de 2023)

## Operaciones de Reporto y Préstamo de Valores

|  | Monto del<br>reporto | Intereses a<br>favor | Intereses a<br>cargo | Premios<br>devengados | Efecto por<br>valuación | Valor de<br>mercado |
|--|----------------------|----------------------|----------------------|-----------------------|-------------------------|---------------------|
| <b>Deudores por reporto</b>  |                      |                      |                      |                       |                         |                     |
| <b>Deuda gubernamental</b>   |                      |                      |                      |                       |                         |                     |
| Bonos de tasa variable   | \$ 8,400             | \$ 5                 | \$ -                 | \$ -                  | \$ -                    | \$ 8,405            |
| Bonos de Protección al Ahorro Bancario   | 6500                 | 4                    | 0                    | 0                     | 0                       | 6504                |
| Bonos de Tasa Fija   | 10,000               | 6                    | -                    | -                     | -                       | 10,006              |
|  | <u>\$ 24,900</u>     | <u>\$ 15</u>         | <u>\$ -</u>          | <u>\$ -</u>           | <u>\$ -</u>             | <u>\$ 24,915</u>    |
| <b>Deuda gubernamental extranjera</b>  |                      |                      |                      |                       |                         |                     |
| Treasury Bond  | \$ 37,732            | \$ 11                | \$ -                 | \$ -                  | \$ -                    | \$ 37,743           |
| <b>Total de Deudores por reporto antes de compensación</b>   |                      |                      |                      |                       |                         | <b>\$ 62,658</b>    |
| <b>Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía</b> |                      |                      |                      |                       |                         | <b>2,927</b>        |
| <b>Total de Deudores por reporto despues de compensación</b>   |                      |                      |                      |                       |                         | <b>\$ 59,731</b>    |

|   |        |      |      |      |      |               |
|---|--------|------|------|------|------|---------------|
| <b>Acreeedores por reporto</b>          |        |      |      |      |      |               |
| <b>Deuda gubernamental</b>              |        |      |      |      |      |               |
| Bonos de Tasa Fija                      | \$ 100 | \$ 4 | \$ - | \$ - | \$ - | \$ 104        |
| <b>Total de Acreeedores por reporto</b> |        |      |      |      |      | <b>\$ 104</b> |

## Colaterales Vendidos o Dados en garantía en operaciones de reporto

### Reportos

#### Deuda gubernamental

|  |                 |              |             |             |             |                 |
|--|-----------------|--------------|-------------|-------------|-------------|-----------------|
| Bonos de Protección al Ahorro Bancario   | \$ 1,439        | \$ 1         | \$ -        | \$ -        | \$ -        | \$ 1,440        |
| Bonos de Tasa Fija                       | 442             | 14           | 0           | 0           | 8           | 464             |
| Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal | 1,479           | 8            | 0           | -           | -1          | 1,486           |
|  | <u>\$ 3,360</u> | <u>\$ 23</u> | <u>\$ -</u> | <u>\$ -</u> | <u>\$ 7</u> | <u>\$ 3,390</u> |

|  |  |  |  |  |  |                 |
|--|--|--|--|--|--|-----------------|
| <b>Total de Colaterales vendidos o dados en garantía por reporto antes de compensación</b>             |  |  |  |  |  | <b>\$ 3,390</b> |
| <b>Compensación de la Cuenta por pagar originada por la venta de colaterales recibidos en garantía</b> |  |  |  |  |  | <b>2,927</b>    |
| <b>Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en operaciones de reporto</b>                     |  |  |  |  |  | <b>\$ 463</b>   |

### Préstamo de valores

#### Deuda gubernamental

|   |                 |             |              |             |              |                 |
|---|-----------------|-------------|--------------|-------------|--------------|-----------------|
| Certificados de la Tesorería de la Federación | \$ 2,156        | \$ -        | \$ 27        | \$ -        | \$ (4)       | \$ 2,179        |
| Bonos de desarrollo                           | 5               | -           | 0            | -           | (0)          | 5               |
| Udibonos                                      | 1,168           | -           | 14           | -           | (1)          | 1,181           |
| Bonos de Tasa Fija                            | 4,973           | -           | 34           | -           | 50           | 5,057           |
|   | <u>\$ 8,302</u> | <u>\$ -</u> | <u>\$ 75</u> | <u>\$ -</u> | <u>\$ 45</u> | <u>\$ 8,422</u> |

|   |  |  |  |  |  |                 |
|---|--|--|--|--|--|-----------------|
| <b>Total de Colaterales vendidos o dados en garantía en préstamo de valores</b> |  |  |  |  |  | <b>\$ 8,422</b> |
| <b>Total de Colaterales vendidos o dados en garantía</b>                        |  |  |  |  |  | <b>\$ 8,885</b> |