

Artículo 181 Fracción IX

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

	Monto	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total	Presentación			
								Moneda origen		Moneda Nacional	
								Activo	Pasivo	Activo	Pasivo
I. SWAPS											
Swap Udis / Peso											
Activo - Udis	576	3	92	-	671	5.415207	3,636	1,465	-		
Pasivo - Peso	2,171	-	-	-	2,171	1	2,171	-	-		
Swap Peso / Udi											
Activo - Peso	2,171	-	-	-	2,171	1	2,171	-	-		
Pasivo - Udi	576	3	91	-	670	5.415207	3,628	-	1,457		
Swap Dólar / Peso											
Activo - Dólar	97	-	21	-	118	18.464600	2,190	654	-		
Pasivo - Peso	1,257	-	279	-	1,536	1	1,536	-	-		
Swap Peso / Dólar											
Activo - Peso	3,691	26	188	-	3,905	1	3,905	-	-		
Pasivo - Dólar	297	1	17	-	315	18.464600	5,822	-	1,917		
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar											
Activo - Dólar	-	1	419	-	420	18.464600	7,753	2,822	-		
Pasivo - Dólar	-	1	399	-	400	18.464600	7,381	-	2,450		
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso											
Activo - Peso	13	941	30,614	(107)	31,461	1	31,461	4,711	-		
Pasivo - Peso	13	922	30,202	-	31,137	1	31,137	-	4,387		
II. FORWARDS											
Forward Dólar / Peso											
Activo - Dólar	5	-	-	-	5	18.464600	100	23	-		
Pasivo - Peso	77	-	-	-	77	1	77	-	-		
Forward Euro / Peso											
Activo - Euro	52	-	-	-	52	20.523400	1,075	139	-		
Pasivo - Peso	951	-	(15)	-	936	1	936	-	-		
Forward Peso / Euro											
Activo - Peso	949	-	(15)	-	934	1	934	8	-		
Pasivo - Euro	45	-	-	-	45	20.523400	926	-	-		
TOTAL NEGOCIACIÓN								9,822	10,211		

Nota: Las sumas y algunas cifras pueden variar por efectos de redondeo

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Segundo Trimestre de 2016

Artículo 181 Fracción IX

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

	Monto	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de	Presentación		
							Total	Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
I. SWAPS									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	882	187	79	-	1,148	5.415207	6,219	2,853	-
Pasivo - Peso	3,435	13	(81)	-	3,367	1	3,367	-	1
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	10,776	14	(2)	-	10,788	1	10,788	-	-
Pasivo - Udi	2,122	16	112	-	2,250	5.415207	12,187	-	1,399
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	9	18,075	-	55,084	0.179900	9,910	8,228	-
Pasivo - Peso	576	-	1,106	-	1,682	1	1,682	-	-
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	133	-	(4)	-	129	18.464600	2,387	712	-
Pasivo - Peso	1,766	3	(94)	-	1,675	1	1,675	-	-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	549	9	71	-	629	1	629	10	-
Pasivo - Peso	549	-	74	-	623	1	623	-	4
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	69	-	1	-	70	18.464600	1,297	357	-
Pasivo - Peso	871	19	50	-	940	1	940	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	69,263	916	16,328	-	86,507	1	86,507	1,382	-
Pasivo - Peso	69,263	504	19,197	-	88,964	1	88,964	-	3,839
II. FORWARDS									
Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	169	-	-	-	169	18.464600	3,112	419	-
Pasivo - Peso	2,736	-	(43)	-	2,693	1	2,693	-	-
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	34	-	-	-	34	20.523400	705	94	-
Pasivo - Peso	642	-	(31)	-	611	1	611	-	-
TOTAL COBERTURA								14,055	5,243

Nota: Las sumas y algunas cifras pueden variar por efectos de redondeo

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Segundo Trimestre de 2016