

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

I. SWAPS

	Monto	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total	Presentación			
								Moneda origen		Moneda Nacional	
								Activo	Pasivo	Activo	Pasivo
Swap Udis / Peso											
Activo - Udis	546	3	90	-	639	5.454790	3,483	1,444	-		
Pasivo - Peso	2,039	1	(1)	-	2,039	1	2,039	-	-		
Swap Peso / Udi											
Activo - Peso	2,039	1	(1)	-	2,039	1	2,039	-	-		
Pasivo - Udi	546	3	89	-	638	5.454790	3,476	-	(1,437)		
Swap Dólar / Peso											
Activo - Dólar	95	-	22	-	117	19.377600	2,276	801	-		
Pasivo - Peso	1,233	1	241	-	1,475	1	1,475	-	-		
Swap Peso / Dólar											
Activo - Peso	5,667	88	78	-	5,833	1	5,833	-	-		
Pasivo - Dólar	402	1	26	-	429	19.377600	8,301	-	(2,468)		
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar											
Activo - Dólar	-	7	532	-	539	19.377600	10,436	3,112	-		
Pasivo - Dólar	-	7	502	-	509	19.377600	9,857	-	(2,533)		
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso											
Activo - Peso	15	949	29,902	(75)	30,791	1	30,791	3,879	-		
Pasivo - Peso	15	943	29,521	-	30,479	1	30,479	-	(3,567)		
II. FORWARDS											
Forward Dólar / Peso											
Activo - Dólar	15	-	-	-	15	19.377600	295	79	-		
Pasivo - Peso	218	-	(2)	-	216	1	216	-	-		
Forward Euro / Peso											
Activo - Euro	52	-	1	-	53	21.768800	1,138	192	-		
Pasivo - Peso	951	-	(5)	-	946	1	946	-	-		
Forward Peso / Euro											
Activo - Peso	950	-	(5)	-	945	1	945	-	-		
Pasivo - Euro	45	-	-	-	45	21.768800	981	-	(36)		
TOTAL NEGOCIACIÓN								9,507	(10,041)		

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Tercer Trimestre de 2016

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de	Total	Presentación			
								Moneda origen		Moneda Nacional	
								Activo	Pasivo	Activo	Pasivo
Swap Udis / Peso											
Activo - Udis	882	187	85	-	1,154	5.454790	6,293	2,921	-		
Pasivo - Peso	3,435	15	(78)	-	3,372	1	3,372	-	-		
Swap Peso / Udi											
Activo - Peso	10,929	17	(5)	-	10,941	1	10,941	-	-		
Pasivo - Udi	2,149	10	108	-	2,267	5.454790	12,369	-	(1,428)		
Swap Yen / Peso											
Activo - Yen	37,000	288	18,931	-	56,219	0.191300	10,755	8,994	-		
Pasivo - Peso	576	1	1,184	-	1,761	1	1,761	-	-		
Swap Dólar / Peso											
Activo - Dólar	183	1	(3)	-	181	19.377600	3,500	950	-		
Pasivo - Peso	2,694	3	(147)	-	2,550	1	2,550	-	-		
Swap de Tasas de Interés (Flujo de efectivo) Peso / Peso											
Activo - Peso	548	21	58	-	627	1	627	33	-		
Pasivo - Peso	537	-	60	-	597	1	597	-	(3)		
Swap de Tasas de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso											
Activo - Dólar	68	-	1	-	69	19.377600	1,338	457	-		
Pasivo - Peso	847	4	30	-	881	1	881	-	-		
Swap de Tasas de Interés Peso / Peso											
Activo - Peso	66,263	1,131	18,261	-	85,655	1	85,655	1,361	-		
Pasivo - Peso	66,263	375	20,424	-	87,062	1	87,062	-	(2,768)		

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	131	-	-	-	131	19.377600	2,535	353	-
Pasivo - Peso	2,194	-	(12)	-	2,162	1	2,182	-	-
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	34	-	-	-	34	21.768800	746	133	-
Pasivo - Peso	642	-	(28)	-	614	1	614	-	-

TOTAL COBERTURA								15,202	(4,199)
------------------------	--	--	--	--	--	--	--	---------------	----------------

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Tercer Trimestre de 2016