

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	600	3	99	-	702	5.30972	3,723	1,464	-
Pasivo - Peso	2,259	-	-	-	2,259	1	2,259	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	2,259	-	-	-	2,259	1	2,259	-	-
Pasivo - Udi	600	3	97	-	700	5.30972	3,715	-	(1,456)
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	103	-	19	-	122	16.9053	2,055	433	-
Pasivo - Peso	1,329	-	293	-	1,622	1	1,622	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,763	57	157	-	3,977	1	3,977	-	-
Pasivo - Dólar	303	-	12	-	315	16.9053	5,330	-	(1,353)
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	3	507	-	510	16.9053	8,618	1,661	-
Pasivo - Dólar	-	3	485	-	488	16.9053	8,241	-	(1,284)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	12	787	30,415	(101)	31,113	1	31,113	4,008	-
Pasivo - Peso	12	782	30,054	-	30,848	1	30,848	-	(3,743)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	119	-	-	-	119	16.9053	2,017	361	-
Pasivo - Peso	1,669	-	(13)	-	1,656	1	1,656	-	-
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	1	-	-	-	1	18.8748	22	2	-
Pasivo - Peso	20	-	-	-	20	1	20	-	-

TOTAL NEGOCIACIÓN 7,929 (7,836)

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 2015

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación		
								Activo	Pasivo	
								Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso										
Activo - Udis	808	169	69	-	1,046	5.30972	5,554	2,594		
Pasivo - Peso	3,035	10	(85)	-	2,960	1	2,960		-	
Swap Peso / Udi										
Activo - Peso	4,907	3	(1)	-	4,909	1	4,909	-		
Pasivo - Udi	1,036	1	25	-	1,062	5.30972	5,644		(73.5)	
Swap Yen / Peso										
Activo - Yen	37,000	287	9,494	-	46,781	0.14114	6,602	5,152		
Pasivo - Peso	576	-	874	-	1,450	1	1,450		-	
Swap Dólar / Peso										
Activo - Dólar	134	-	(7)	-	127	16.9053	2,157	510		
Pasivo - Peso	1,738	2	(93)	-	1,647	1	1,647		-	
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso										
Activo - Peso	595	23	76	-	694	1	694	34		
Pasivo - Peso	585	-	79	-	664	1	664		(4)	
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso										
Activo - Dólar	71	-	-	-	71	16.9053	1,209	254		
Pasivo - Peso	894	4	57	-	955	1	955		-	
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso										
Activo - Peso	75,288	942	11,700	-	87,930	1	87,931	1,616		
Pasivo - Peso	75,323	355	14,208	-	89,886	1	89,886		(3,571)	
II. FORWARDS										
Forward Dólar / Peso										
Activo - Dólar	187	-	(1)	-	186	16.9053	3,142	566		
Pasivo - Peso	2,639	-	(63)	-	2,576	1	2,576		-	
Forward Euro / Peso										
Activo - Euro	205	-	1	-	206	18.874770	3,886	298		
Pasivo - Peso	3,685	-	(97)	-	3,588	1	3,588		-	
TOTAL COBERTURA								11,024	(4,310)	

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 2015