

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	60	-	2	-	62	5.29779	328	52	
Pasivo - Peso	276	-	-	-	276	1	276		-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	276	-	-	-	276	1	276	-	
Pasivo - Udi	60	-	2	-	62	5.29779	328		(52)
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	119	-	23	-	142	15.2647	2,175	253	
Pasivo - Peso	1,544	-	378	-	1,922	1	1,922		-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,978	57	266	-	4,301	1	4,301		
Pasivo - Dólar	320	-	18	-	338	15.2647	5,160		(859)
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	2	377	-	379	15.2647	5,786	1,215	
Pasivo - Dólar	-	2	360	-	362	15.2647	5,524		(952)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	11	743	29,184	(125)	29,813	1	29,813	4,714	
Pasivo - Peso	11	738	28,790	-	29,539	1	29,539		(4,440)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	100				100	15.2647	1,526	-	
Pasivo - Peso	1,545				1,545	1	1,545		(19)

TOTAL NEGOCIACIÓN 6,234 (6,322)

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	160	62	-	1,030	5.29779	5,456	2,502	
Pasivo - Peso	3,035	9	(90)	-	2,954	1	2,954		-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	6,989	3	(2)	-	6,990	1	6,990	-	
Pasivo - Udi	1,600	4	111	-	1,715	5.29779	9,085		(2,095)
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	284	9,498	-	46,782	0.12731	5,956	4,848	
Pasivo - Peso	576	1	532	-	1,109	1	1,108		-
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	139	-	(7)	-	132	15.2647	2,019	314	
Pasivo - Peso	1,795	2	(92)	-	1,705	1	1,705		-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	618	23	88	-	729	1	729	34	
Pasivo - Peso	608	-	93	-	701	1	701		(6)
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	73	-	1	-	74	15.2647	1,126	139	
Pasivo - Peso	918	4	65	-	987	1	987		-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	79,122	1,062	10,607	-	90,791	1	90,791	1,619	
Pasivo - Peso	79,156	383	14,580	-	94,119	1	94,119		(4,947)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	419	-	(3)	-	416	15.2647	6,360	652	
Pasivo - Peso	5,859	-	(151)	-	5,708	1	5,708		-

Artículo 181 Fracción IX

Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	227	-	1	-	228	16.397340	3,742	-	
Pasivo - Peso	4,071	-	(156)	-	3,915	1	3,915		(173)
TOTAL COBERTURA								10,108	- 7,221

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito

Reporte del Primer Trimestre de 2015