

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	109	-	5	-	114	5.17863	589	88	
Pasivo - Peso	500	1	-	-	501	1	501		-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	500	1	-	-	501	1	501	-	
Pasivo - Udi	109	-	5	-	114	5.17863	589		(88)
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	124	-	19	-	143	13.4330	1,917	6	
Pasivo - Peso	1,598	1	366	-	1,965	1	1,965		(54)
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	4,033	57	192	-	4,282	1	4,282	63	
Pasivo - Dólar	324	-	12	-	336	13.4330	4,512		(293)
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	2	294	-	296	13.4330	3,977	467	
Pasivo - Dólar	-	2	282	-	284	13.4330	3,813		(303)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	11	694	30,818	(101)	31,422	1	31,422	3,911	
Pasivo - Peso	11	689	30,442	-	31,142	1	31,142		(3,631)
TOTAL NEGOCIACIÓN								4,535	(4,369)

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	1,778	150	86	-	2,014	5.17863	10,429	2,475	
Pasivo - Peso	8,035	19	(100)	-	7,954	1	7,954		-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	7,087	3	(2)	-	7,088	1	7,088	-	
Pasivo - Udi	1,625	4	150	-	1,779	5.17863	9,214		(2,126)
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	284	6,668	-	43,952	0.12246	5,382	4,324	
Pasivo - Peso	576	-	482	-	1,058	1	1,058		-
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	138	-	(9)	-	129	13.4330	1,731	57	
Pasivo - Peso	1,772	3	(92)	-	1,683	1	1,683		(9)
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	641	25	86	-	752	1	752	35	
Pasivo - Peso	632	-	89	-	721	1	721		(4)
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	75	-	-	-	75	13.4330	1,009	7	
Pasivo - Peso	941	4	57	-	1,002	1	1,002		-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	79,796	1,142	11,407	-	92,345	1	92,345	2,143	
Pasivo - Peso	79,808	375	13,655	-	93,838	1	93,838		(3,636)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	46	-	-	-	46	13.4330	620	6	
Pasivo - Peso	624	-	(10)	-	614	1	614		-

TOTAL COBERTURA 9,047 (5,775)

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 2014