

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	
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	109	-	5	-	114	5.17863	589	88	
Pasivo - Peso	500	1	-	-	501	1	501		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	500	1	-	-	501	1	501	-	
Pasivo - Udi	109	-	5	-	114	5.17863	589		(88)
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	124	-	19	-	143	13.4330	1,917	6	
Pasivo - Peso	1,598	1	366	-	1,965	1	1,965		(54)
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	4,033	57	192	-	4,282	1	4,282	63	
Pasivo - Dólar	324	-	12	-	336	13.4330	4,512		(293)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	2	294	-	296	13.4330	3,977	467	
Pasivo - Dólar	-	2	282	-	284	13.4330	3,813		(303)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
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)
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>4,535</b>	<b>(4,369)</b>

**DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
<b>Swap Udis / Peso</b>									
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		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
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)
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	284	6,668	-	43,952	0.12246	5,382	4,324	
Pasivo - Peso	576	-	482	-	1,058	1	1,058		-
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	138	-	(9)	-	129	13.4330	1,731	57	
Pasivo - Peso	1,772	3	(92)	-	1,683	1	1,683		(9)
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	641	25	86	-	752	1	752	35	
Pasivo - Peso	632	-	89	-	721	1	721		(4)
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	75	-	-	-	75	13.4330	1,009	7	
Pasivo - Peso	941	4	57	-	1,002	1	1,002		-
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
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**

<b>Forward Dólar / Peso</b>									
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