

Artículo 181 Fracción IX

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente  
(Cifras en millones de pesos)

**DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Presentación		
							Total valorizado	Activo	Pasivo
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	109	-	5	-	114	5.145084	585	84	
Pasivo - Peso	500	1	-	-	501	1	501		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	500	1	-	-	501	1	501	-	
Pasivo - Udi	109	-	5	-	114	5.145084	585		(84)
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	128	-	19	-	147	13.054900	1,913	4	
Pasivo - Peso	1,650	-	357	-	2,007	1	2,007		(98)
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	4,085	57	125	-	4,267	1	4,267	107	
Pasivo - Dólar	328	-	10	-	338	13.054900	4,422		(262)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	2	296	-	298	13.054900	3,890	360	
Pasivo - Dólar	-	2	284	-	286	13.054900	3,734		(204)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	6	635	31,621	(77)	32,185	1	32,185	3,133	
Pasivo - Peso	6	631	31,278	-	31,915	1	31,915		(2,863)
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>							<b>3,688</b>	<b>(3,511)</b>	

**DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Presentación		
							Total valorizado	Activo	Pasivo
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	808	147	108	-	1,063	5.145084	5,468	2,518	
Pasivo - Peso	3,035	10	(95)	-	2,950	1	2,950		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	9,542	7	(3)	-	9,546	1	9,546	-	
Pasivo - Udi	2,207	7	273	-	2,487	5.145084	12,797		(3,251)
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	281	4,591	-	41,872	0.126760	5,308	4,087	
Pasivo - Peso	576	1	644	-	1,221	1	1,221		-
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	119	-	(6)	-	113	13.054900	1,481	20	
Pasivo - Peso	1,538	1	(40)	-	1,499	1	1,499		(38)
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	664	26	83	-	773	1	773	34	
Pasivo - Peso	656	-	85	-	741	1	741		(2)
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Dolar / Peso</b>									
Activo - Dólar	75	-	-	-	75	13.054900	977	-	
Pasivo - Peso	941	4	47	-	992	1	992		(15)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	83,083	779	8,152	-	92,014	1	92,014	2,313	
Pasivo - Peso	83,095	383	8,957	-	92,435	1	92,435		(2,734)
<b>II. FORWARDS</b>									
<b>Forward Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	122	-	-	-	122	13.174700	1,592	-	
Pasivo - Peso	1,669	-	(24)	-	1,645	1	1,645		(53)
<b>TOTAL COBERTURA</b>							<b>8,972</b>	<b>(6,093)</b>	

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 2014