

Artículo 181 Fracción IX

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

**DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Presentación			
							Total valorizado	Activo	Pasivo	
							Moneda Nacional			
<b>Swap Udis / Peso</b>										
Activo - Udis	109	1	5	-	115	5.13111	591	90		
Pasivo - Peso	500	1	-	-	501	1	501		-	
<b>Swap Peso / Udi</b>										
Activo - Peso	500	1	-	-	501	1	501	-		
Pasivo - Udi	109	1	5	-	115	5.13111	591		(90)	
<b>Swap Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	126	-	20	-	146	12.9712	1,885	1		
Pasivo - Peso	1,624	-	413	-	2,037	1	2,037		(153)	
<b>Swap Peso / Dólar</b>										
Activo - Peso	4,059	25	287	-	4,371	1	4,371	162		
Pasivo - Dólar	326	-	11	-	337	12.9712	4,378		(169)	
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>										
Activo - Dólar	-	1	302	-	303	12.9712	3,921	435		
Pasivo - Dólar	-	1	289	-	290	12.9712	3,760		(274)	
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	7	671	30,749	(126)	31,301	1	31,301	4,594		
Pasivo - Peso	7	655	30,364	-	31,026	1	31,026		(4,319)	
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>							<b>5,282</b>	<b>(5,005)</b>		

**DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Presentación			
							Total valorizado	Activo	Pasivo	
							Moneda Nacional			
<b>Swap Udis / Peso</b>										
Activo - Udis	808	152	95	-	1,055	5.13111	5,412	2,463		
Pasivo - Peso	3,035	10	(96)	-	2,949	1	2,949		-	
<b>Swap Peso / Udi</b>										
Activo - Peso	9,513	6	(2)	-	9,517	1	9,517	-		
Pasivo - Udi	2,199	21	248	-	2,468	5.13111	12,664		(3,147)	
<b>Swap Yen / Peso</b>										
Activo - Yen	37,000	-	5,288	-	42,288	0.12805	5,415	4,346		
Pasivo - Peso	576	-	493	-	1,069	1	1,069		-	
<b>Swap Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	116	-	(6)	-	110	12.9712	1,434	12		
Pasivo - Peso	1,502	1	(41)	-	1,462	1	1,462		(40)	
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	642	11	101	-	754	1	754	10		
Pasivo - Peso	644	-	105	-	749	1	749		(5)	
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	75	-	-	-	75	12.9712	972	-		
Pasivo - Peso	941	21	77	-	1,039	1	1,039		(67)	
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>										
Activo - Peso	80,145	994	8,742	-	89,881	1	89,881	1,949		
Pasivo - Peso	80,157	480	12,130	-	92,767	1	92,767		(4,835)	
<b>II. FORWARDS</b>										
<b>Forward Dólar / Peso</b>										
Activo - Dólar	58	-	-	-	58	12.9712	756	-		
Pasivo - Peso	785	-	(15)	-	770	1	770		(14)	
<b>TOTAL COBERTURA</b>							<b>8,780</b>	<b>(8,108)</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 Segundo Trimestre de 2014