

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 origen						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 origen						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) Dolar / 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