

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	-	7	-	116	4.968770	577	76	
Pasivo - Peso	500	-	1	-	501	1	501		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	500	-	1	-	501	1	501	-	
Pasivo - Udi	109	-	7	-	116	4.968770	577		(76)
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	138	-	21	-	159	13.174700	2,095	4	
Pasivo - Peso	1,792	1	419	-	2,212	1	2,212		(121)
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	4,272	55	167	-	4,494	1	4,494	135	
Pasivo - Dólar	342	-	7	-	349	13.174700	4,603		(244)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	1	137	-	138	13.174700	1,822	192	
Pasivo - Dólar	-	1	131	-	132	13.174700	1,748		(118)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	5	589	33,452	(69)	33,977	1	33,977	3,157	
Pasivo - Peso	5	586	33,092	-	33,683	1	33,683		(2,863)
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>							<b>3,564</b>	<b>(3,422)</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	959	138	133	-	1,230	4.968770	6,112	2,416	
Pasivo - Peso	3,785	13	(102)	-	3,696	1	3,696		-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	9,660	7	(3)	-	9,664	1	9,664	-	
Pasivo - Udi	2,236	7	336	-	2,579	4.968770	12,818		(3,154)
<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	281	3,100	-	40,381	0.134280	5,422	3,982	
Pasivo - Peso	767	-	673	-	1,440	1	1,440		-
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	198	-	(10)	-	188	13.174700	2,476	12	
Pasivo - Peso	2,529	5	8	-	2,542	1	2,542		(78)
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo)</b>									
Activo - Peso	687	27	88	-	802	1	802	35	
Pasivo - Peso	679	-	90	-	769	1	769		(2)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	71,764	526	6,632	-	78,922	1	78,922	2,308	
Pasivo - Peso	71,776	284	7,183	-	79,243	1	79,243		(2,629)
<b>II. FORWARDS</b>									
<b>Forward Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	88	-	-	-	88	13.174700	1,157	1	
Pasivo - Peso	1,212	-	(22)	-	1,190	1	1,190		(34)
<b>Forward Euro / Peso</b>									
Activo - Euro	29	-	-	-	29	17.831960	517	-	
Pasivo - Peso	563	-	(7)	-	556	1	556		(39)
<b>TOTAL COBERTURA</b>							<b>8,754</b>	<b>(5,936)</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 Tercer Trimestre de 2013