

"2013, Año de la Lealtad Institucional y Centenario del Ejército Mexicano"

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	Total	Tipo de cambio / Valor de la Udi	Presentación	
						Total valorizado	Activo Pasivo
Swap Udis / Peso							
Activo - Udis	109	-	8	117	4.941512	581	79
Pasivo - Peso	500	1	1	502		502	-
Swap Peso / Udi							
Activo - Peso	500	1	1	502	-	502	-
Pasivo - Udi	109	-	8	117	4.941512	581	(79)
Swap Dólar / Peso							
Activo - Dólar	142	1	36	179	12.361200	2,215	-
Pasivo - Peso	1,845	12	572	2,429		2,429	(214)
Swap Peso / Dólar							
Activo - Peso	1,896	16	581	2,493		2,493	233
Pasivo - Dólar	146	1	36	183	12.361200	2,260	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar							
Activo - Dólar	-	1	108	109	12.361200	1,346	182
Pasivo - Dólar	-	1	103	104	12.361200	1,287	(123)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso							
Activo - Peso	3	565	30,109	30,677		30,677	5,575
Pasivo - Peso	3	564	29,733	30,300		30,300	(5,198)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso							
Activo - Dólar	5	-	-	5	12.361200	59	
Pasivo - Peso	60	-	-	60	1	60	(1)

TOTAL NEGOCIACIÓN 6,069 (5,615)

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Total	Tipo de cambio / Valor de la Udi	Presentación	
						Total valorizado	Activo Pasivo
Swap Udis / Peso							
Activo - Udis	1,303	134	250	1,687	4.941512	8,336	3,707
Pasivo - Peso	4,717	20	(108)	4,629		4,629	-
Swap Peso / Udi							
Activo - Peso	8,794	28	(2)	8,820		8,820	-
Pasivo - Udi	2,067	19	544	2,630	4.941512	12,997	(4,177)
Swap Yen / Peso							
Activo - Yen	37,000	278	7,893	45,171	0.131120	5,923	4,386
Pasivo - Peso	767	2	768	1,537		1,537	-
Swap Dólar / Peso							
Activo - Dólar	201	-	(1)	200	12.361200	2,478	2
Pasivo - Peso	2,582	9	52	2,643		2,643	(167)
Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo)							
Activo - Peso	711	27	127	865		865	27
Pasivo - Peso	707	5	133	845		845	(7)
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso							
Activo - Peso	55,593	359	7,021	62,973		62,973	981
Pasivo - Peso	55,604	274	11,237	67,115		67,115	(5,123)

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso							
Activo - Dólar	95	-	-	95	12.361200	1,165	-
Pasivo - Peso	1,281	-	(44)	1,237		1,237	(72)

Forward Euro / Peso							
Activo - Euro	29	-	-	29	15.785250	458	-
Pasivo - Peso	563	-	(18)	545		545	(87)

TOTAL COBERTURA 9,103 (9,633)

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 2013