

Artículo 181 Fracción IX

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

I. SWAPS

	Monto nominal	Intereses	Valuación	Total	Tipo de cambio	Presentación			
						Total valorizado	Activo	Pasivo	
							Moneda Nacional		
Moneda origen									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	429	2	38	469	6.106995	2,869	1,280	-	
Pasivo - Peso	1,578	11	-	1,589	1.000000	1,589	-	-	
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,578	11	-	1,589	1.000000	1,589	-	-	
Pasivo - Udi	429	2	37	468	6.106995	2,863	-	1,274	
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	81	-	11	92	18.723100	1,720	578	-	
Pasivo - Peso	1,046	4	92	1,142	1.000000	1,142	-	-	
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,481	109	(344)	5,246	1.000000	5,246	-	-	
Pasivo - Dólar	387	2	18	407	18.723100	7,640	-	2,394	
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	290	14 797	52,087	0.164820	8,585	7,056	-	
Pasivo - Peso	384	1	1,144	1,529	1.000000	1,529	-	-	
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	12	703	715	18.723100	13,388	1,591	-	
Pasivo - Dólar	-	11	675	686	18.723100	12,855	-	1,058	
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	16	818	29 464	30,298	1.000000	30,298	1,706	-	
Pasivo - Peso	16	814	29,186	30,016	1.000000	30,016	-	1,424	
II. FORWARDS									
Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	97	-	(2)	95	18.723100	1,793	-	-	
Pasivo - Peso	2,025	-	100	1,925	1.000000	1,925	-	132	
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	29	-	-	29	21.743140	626	-	-	
Pasivo - Peso	658	-	(3)	655	1.000000	655	-	29	
Forward Pesos / Dólar									
Activo - Peso	2,033	-	(100)	1,933	1.000000	1,933	140	-	
Pasivo - Dólar	97	-	(2)	95	18.723100	1,793	-	-	
Forward Peso / Euro									
Activo - Euro	678	-	(4)	674	1.000000	674	48	-	
Pasivo - Peso	29	-	0	29	21.743140	626	-	-	
TOTAL NEGOCIACIÓN							12,399	6,311	

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nocional	Intereses	Valuación	Total	Tipo de cambio	Presentación		
						Total valorizado	Activo	Pasivo
	Moneda origen					Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso								
Activo - Udis	1,098	225	1	1,324	6.106995	8,084	3,374	-
Pasivo - Peso	4,741	34	(64)	4,711	1.000000	4,711	-	1
Swap Peso / Udi								
Activo - Peso	7,529	22	466	8,017	1.000000	8,017	-	-
Pasivo - Udi	1,456	9	80	1,545	6.106995	9,435	-	1,418
Swap Dólar / Peso								
Activo - Dólar	171	1	(6)	166	18.723100	3,094	709	-
Pasivo - Peso	2,509	13	(136)	2,386	1.000000	2,386	-	1
Swap Peso / Dólar								
Activo - Peso	2,724	16	520	3,260	1.000000	3,260	42	-
Pasivo - Dólar	141	1	37	179	18.723100	3,349	-	131
Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Peso / Peso								
Activo - Peso	402	17	12	431	1.000000	431	23	-
Pasivo - Peso	393	3	12	408	1.000000	408	-	-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de Efectivo) Dolar / Peso								
Activo - Dólar	69	-	2	71	18.723100	1,323	420	-
Pasivo - Peso	916	4	(17)	903	1.000000	903	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso								
Activo - Peso	43,370	1,533	31 000	75,903	1.000000	75,903	5,021	-
Pasivo - Peso	43,370	574	28 354	72,298	1.000000	72,298	-	1,416
II. FORWARDS								
Forward Euro / Peso								
Activo - Euro	32	-	0	32	21.743140	707	-	-
Pasivo - Peso	838	-	(55)	783	1.000000	783	-	76
TOTAL COBERTURA						9,589	3,043	

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 2018

