

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
Moneda origen									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	351	2	45	-	398	6.443804	2,562	1,273	-
Pasivo - Peso	1,289	-	-	-	1,289	1	1,289	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,289	-	-	-	1,289	1	1,289	-	-
Pasivo - Udi	351	2	45	-	398	6.443804	2,559	-	1,270
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	68	-	15	-	83	23.089300	1,920	862	-
Pasivo - Peso	876	-	182	-	1,058	1	1,058	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,308	42	338	-	5,688	1	5,688	-	-
Pasivo - Dólar	374	2	21	-	397	23.089300	9,172	-	3,484
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	6	16,463	-	53,469	0.214110	11,449	8,291	-
Pasivo - Peso	384	-	2,774	-	3,158	1	3,158	-	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	7	417	-	424	23.089300	9,784	5,985	-
Pasivo - Dólar	-	6	387	-	393	23.089300	9,085	-	5,286
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	201	931	28,358	-	29,490	1	29,490	6,737	-
Pasivo - Peso	201	913	27,936	-	29,050	1	29,050	-	6,297
TOTAL NEGOCIACIÓN								23,148	16,337

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 2020

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
Moneda origen							Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	1,728	266	194	-	2,188	6.443804	14,102	5,456	-
Pasivo - Peso	8,716	22	(92)	-	8,646	1	8,646	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	10,379	18	677	-	11,074	1	11,074	-	-
Pasivo - Udi	1,904	14	385	-	2,303	6.443804	14,843	-	3,769
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	107	-	2	-	109	23.089300	2,518	952	-
Pasivo - Peso	1,652	2	(88)	-	1,566	1	1,566	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	4,520	14	805	-	5,339	1	5,339	68	-
Pasivo - Dólar	222	3	151	-	376	23.089300	8,666	-	3,395
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	67	-	1	-	68	23.089300	1,573	586	-
Pasivo - Peso	926	15	49	-	990	1	990	-	3
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	35,601	1,303	32 905	-	69,809	1	69,809	4,550	-
Pasivo - Peso	35,590	917	37 881	-	74,388	1	74,388	-	9,129

TOTAL COBERTURA

11,612 16,296

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 2020