

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 origen | | | | | | | Moneda Nacional | | |
| Swap Udis / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Udis | 339 | 2 | 45 | - | 386 | 6.549579 | 2,530 | 1,283 | - |
| Pasivo - Peso | 1,247 | - | - | - | 1,247 | 1 | 1,247 | - | - |
| Swap Peso / Udi | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 1,247 | - | - | - | 1,247 | 1 | 1,247 | - | - |
| Pasivo - Udi | 339 | 2 | 45 | - | 386 | 6.549579 | 2,527 | - | 1,280 |
| Swap Dólar / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Dólar | 66 | - | 15 | - | 81 | 22.143800 | 1,794 | 776 | - |
| Pasivo - Peso | 852 | - | 166 | - | 1,018 | 1 | 1,018 | - | - |
| Swap Peso / Dólar | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 5,284 | 105 | 292 | - | 5,681 | 1 | 5,681 | - | - |
| Pasivo - Dólar | 372 | 1 | 21 | - | 394 | 22.143800 | 8,729 | - | 3,048 |
| Swap Yen / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Yen | 37,000 | 287 | 16,976 | - | 54,263 | 0.209830 | 11,386 | 8,464 | - |
| Pasivo - Peso | 384 | 1 | 2,537 | - | 2,922 | 1 | 2,922 | - | - |
| Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar | | | | | | | | | |
| Activo - Dólar | - | 7 | 426 | - | 433 | 22.143800 | 9,580 | 5,494 | - |
| Pasivo - Dólar | - | 6 | 395 | - | 401 | 22.143800 | 8,892 | - | 4,806 |
| Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 199 | 925 | 27,366 | - | 28,490 | 1 | 28,490 | 6,096 | - |
| Pasivo - Peso | 199 | 919 | 26,980 | - | 28,098 | 1 | 28,098 | - | 5,704 |
| TOTAL NEGOCIACIÓN | | | | | | | | 22,113 | 14,838 |

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 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 Nacional | |
| Moneda origen | | | | | | | | | |
| Swap Udis / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Udis | 1,851 | 264 | 221 | - | 2,336 | 6.549579 | 15,298 | 5,854 | - |
| Pasivo - Peso | 9,516 | 14 | (86) | - | 9,444 | 1 | 9,444 | - | - |
| Swap Peso / Udi | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 10,287 | 16 | 658 | - | 10,961 | 1 | 10,961 | - | - |
| Pasivo - Udi | 1,885 | 15 | 408 | - | 2,308 | 6.549579 | 15,119 | - | 4,158 |
| Swap Dólar / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Dólar | 107 | - | 3 | - | 110 | 22.143800 | 2,428 | 877 | - |
| Pasivo - Peso | 1,635 | 2 | (86) | - | 1,551 | 1 | 1,551 | - | - |
| Swap Peso / Dólar | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 4,520 | 9 | 782 | - | 5,311 | 1 | 5,311 | 104 | - |
| Pasivo - Dólar | 222 | 2 | 150 | - | 374 | 22.143800 | 8,291 | - | 3,084 |
| Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Dólar | 65 | - | 1 | - | 66 | 22.143800 | 1,467 | 528 | - |
| Pasivo - Peso | 897 | 3 | 41 | - | 941 | 1 | 941 | - | 2 |
| Swap de Tasas de Interes Peso / Peso | | | | | | | | | |
| Activo - Peso | 35,260 | 1,690 | 32 972 | - | 69,922 | 1 | 69,922 | 4,572 | - |
| Pasivo - Peso | 35,112 | 825 | 36 933 | - | 72,870 | 1 | 72,870 | - | 7,520 |

TOTAL COBERTURA

11,935 14,764

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 2020