

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	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación		
								Activo	Pasivo	
Moneda origen							Moneda Nacional			
Swap Udis / Peso										
Activo - Udis	302	2	29	-	333	6.830377	2,272	1,164		
Pasivo - Peso	1,108	-	-	-	1,108	1.000000	1,108			
Swap Peso / Udi										
Activo - Peso	1,108	-	-	-	1,108	1.000000	1,108			
Pasivo - Udi	302	2	29	-	333	6.830377	2,269		1,161	
Swap Dólar / Peso										
Activo - Dólar	60	-	11	-	71	19.906200	1,425	547		
Pasivo - Peso	779	-	99	-	878	1.000000	878			
Swap Peso / Dólar										
Activo - Peso	5,211	42	49	-	5,302	1.000000	5,302			
Pasivo - Dólar	367	1	15	-	383	19.906200	7,613		2,311	
Swap Yen / Peso										
Activo - Yen	37,000	9	14,716	-	51,725	0.179350	9,277	7,836		
Pasivo - Peso	384	-	1,057	-	1,441	1.000000	1,441			
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar										
Activo - Dólar	-	4	449	-	453	19.906200	9,031	3,115		
Pasivo - Dólar	-	4	422	-	426	19.906200	8,478		2,562	
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso										
Activo - Peso	554	944	29,952	-	31,450	1.000000	31,450	3,153		
Pasivo - Peso	554	926	29,607	-	31,087	1.000000	31,087		2,790	
TOTAL NEGOCIACIÓN								15,815	8,824	

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 2021

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	2,052	20	112	-	2,184	6.830377	14,917	3,168	
Pasivo - Peso	11,731	21	41	-	11,793	1.000000	11,793		44
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	10,156	14	588	-	10,758	1.000000	10,758		
Pasivo - Udi	1,858	13	286	-	2,157	6.830377	14,740		3,982
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	95	-	1	-	96	19.906200	1,915	476	
Pasivo - Peso	1,522	1	(83)	-	1,440	1.000000	1,440		1
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,535	7	702	-	4,244	1.000000	4,244		
Pasivo - Dólar	182	3	109	-	294	19.906200	5,853		1,609
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	63	-	0	-	63	19.906200	1,268	370	
Pasivo - Peso	875	14	13	-	902	1.000000	902		4
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	33,586	2,338	35 149	-	71,073	1.000000	71,073	3,932	
Pasivo - Peso	33,404	1,281	35 694	-	70,379	1.000000	70,379		3,238

TOTAL COBERTURA

7,946 8,878

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 2021