

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	288	1	25	-	314	6.922358	2,180	1,122	-
Pasivo - Peso	1,058	-	-	-	1,058	1.000000	1,058	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,058	-	-	-	1,058	1.000000	1,058	-	-
Pasivo - Udi	288	1	25	-	314	6.922358	2,178	-	1,120
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	58	-	10	-	68	20.562300	1,415	578	-
Pasivo - Peso	755	-	82	-	837	1.000000	837	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,187	106	8	-	5,301	1.000000	5,301	-	-
Pasivo - Dólar	365	1	14	-	380	20.562300	7,796	-	2,495
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	288	13,409	-	50,697	0.184280	9,342	7,819	-
Pasivo - Peso	384	1	1,138	-	1,523	1.000000	1,523	-	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	6	446	-	452	20.562300	9,295	2,927	-
Pasivo - Dólar	-	6	419	-	425	20.562300	8,740	-	2,372
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	562	983	28,840	-	30,385	1.000000	30,385	2,630	-
Pasivo - Peso	562	978	28,546	-	30,086	1.000000	30,086	-	2,331
TOTAL NEGOCIACIÓN								15,076	8,318

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 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	2,777	14	100	-	2,891	6.922358	20,007	3,102	-
Pasivo - Peso	16,731	34	259	-	17,024	1.000000	17,024	-	119
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	10,055	15	565	-	10,635	1.000000	10,635	-	-
Pasivo - Udi	1,837	15	256	-	2,108	6.922358	14,593	-	3,958
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	95	-	0	-	95	20.562300	1,969	545	-
Pasivo - Peso	1,504	2	(82)	-	1,424	1.000000	1,424	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,535	7	673	-	4,215	1.000000	4,215	-	-
Pasivo - Dólar	182	2	99	-	283	20.562300	5,830	-	1,615
Swap de Tasas de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	13	-	0	-	13	20.562300	265	29	-
Pasivo - Peso	233	-	5	-	238	1.000000	238	-	2
Swap de Tasas de Interés Peso / Peso									
Activo - Peso	32,735	2,365	36 359	-	71,459	1.000000	71,459	4,441	-
Pasivo - Peso	32,735	847	35 551	-	69,133	1.000000	69,133	-	2,115

TOTAL COBERTURA

8,117 7,809

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 2021