

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	
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	607	3	99	-	709	5.27677	3,740	1,455	-
Pasivo - Peso	2,285	-	-	-	2,285	1	2,285	-	-
<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	2,285	1	-	-	2,286	1	2,286	-	-
Pasivo - Udi	607	3	97	-	707	5.27677	3,732	-	(1,446)
<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	117	-	20	-	137	15.6854	2,160	301	-
Pasivo - Peso	1,516	-	343	-	1,859	1	1,859	-	-
<b>Swap Peso / Dólar</b>									
Activo - Peso	3,950	25	201	-	4,176	1	4,176	-	-
Pasivo - Dólar	318	-	16	-	334	15.6854	5,236	-	(1,060)
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>									
Activo - Dólar	-	1	541	-	542	15.6854	8,495	928	-
Pasivo - Dólar	-	1	519	-	520	15.6854	8,151	-	(584)
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	12	778	28,884	(104)	29,570	1	29,570	4,072	-
Pasivo - Peso	12	761	28,548	-	29,321	1	29,321	-	(3,823)
<b>II. FORWARDS</b>									
<b>Forward Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	50	-	-	-	50	15.6854	780	97	-
Pasivo - Peso	691	-	(8)	-	683	1	683	-	-
<b>Forward Euro / Peso</b>									
Activo - Euro	6	-	-	-	6	17.4751	104	-	-
Pasivo - Peso	104	-	-	-	104	1	104	-	-
<b>TOTAL NEGOCIACIÓN</b>								<b>6,853</b>	<b>(6,913)</b>

**Artículo 181 Fracción IX**

**DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA**

**I. SWAPS**

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	
<b>Moneda origen</b>									
<b>Swap Udis / Peso</b>									
Activo - Udis	808	170	62	-	1,040	5.27677	5,486	2,530	-
Pasivo - Peso	3,035	9	(88)	-	2,956	1	2,956	-	-

<b>Swap Peso / Udi</b>									
Activo - Peso	4,952	3	(1)	-	4,954	1	4,954	-	-
Pasivo - Udi	1,046	8	18	-	1,072	5.27677	5,657	-	(703)

<b>Swap Yen / Peso</b>									
Activo - Yen	37,000	6	9,483	-	46,489	0.12820	5,960	4,857	-
Pasivo - Peso	576	-	527	-	1,103	1	1,103	-	-

<b>Swap Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	135	-	(7)	-	128	15.6854	2,011	350	-
Pasivo - Peso	1,754	2	(95)	-	1,661	1	1,661	-	-

<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	595	10	80	-	685	1	685	10	-
Pasivo - Peso	596	-	83	-	679	1	679	-	(4)

<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	73	-	1	-	74	15.6854	1,159	162	-
Pasivo - Peso	918	20	59	-	997	1	997	-	-

<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>									
Activo - Peso	75,676	1,089	11,835	-	88,600	1	88,600	1,846	-
Pasivo - Peso	75,709	461	14,482	-	90,652	1	90,652	-	(3,898)

**II. FORWARDS**

<b>Forward Dólar / Peso</b>									
Activo - Dólar	298	-	(1)	-	297	15.6854	4,664	561	-
Pasivo - Peso	4,205	-	(102)	-	4,103	1	4,103	-	-

<b>Forward Euro / Peso</b>									
Activo - Euro	213	-	-	-	213	17.475100	3,736	36	-
Pasivo - Peso	3,825	-	(125)	-	3,700	1	3,700	-	-

<b>TOTAL COBERTURA</b>								<b>10,352</b>	<b>(4,605)</b>
------------------------	--	--	--	--	--	--	--	---------------	----------------

Nota: Las sumas y algunas cifras pueden variar por efectos de redondeo.