

Artículo 181, Fracción IX

Instrumentos financieros derivados
(Cifras en millones de pesos)

SWAP	Udis / Pesos POSICIÓN		Pesos / Udis POSICIÓN		Dólar / Pesos POSICIÓN		Pesos / Dólar POSICIÓN		Tasas de interés POSICIÓN		Tasas de interés POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de negociación												
Monto Nominal	109 (Udis)	500 M.N.	500 M.N.	109 (Udis)	143 (Dls)	1,859 M.N.	1,911 M.N.	147 (Dls)	0 (Dls)	0 (Dls)	0 M.N.	0 M.N.
Intereses devengados	1 (Udis)	1 M.N.	1 M.N.	1 (Udis)	0 (Dls)	10 M.N.	15 M.N.	1 (Dls)	1 (Dls)	1 (Dls)	512 M.N.	493 M.N.
Valuación	8 (Udis)	1 M.N.	1 M.N.	8 (Udis)	32 (Dls)	536 M.N.	545 M.N.	32 (Dls)	108 (Dls)	103 (Dls)	31,045 M.N.	30,673 M.N.
Tipo de cambio	4.741055			4.741055	13.408400			13.408400	13.408400	13.408400		
Monto Nominal Valorizado	558	502	502	558	2,356	2,406	2,470	2,404	1,456	1,393	31,557	31,166
Operaciones financieras derivadas	56		(56)		(50)		66		63		392	

SWAP	Udis / Pesos POSICIÓN		Pesos / Udis POSICIÓN		Yenes / Pesos POSICIÓN		Dólar / Pesos POSICIÓN		Tasas de interés (Flujos de Efectivo) POSICIÓN		Tasas de interés POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de cobertura												
Monto Nominal	1,303 (Udis)	4,717 M.N.	7,718 M.N.	1,855 (Udis)	37,000 (Yen)	959 M.N.	194 (Dls)	2,497 M.N.	734 M.N.	742 M.N.	37,920 M.N.	37,930 M.N.
Intereses devengados	127 (Udis)	15 M.N.	16 M.N.	19 (Udis)	3 (Yen)	3 M.N.	0 (Dls)	26 M.N.	13 M.N.	5 M.N.	211 M.N.	199 M.N.
Valuación	218 (Udis)	(112) M.N.	(2) M.N.	448 (Udis)	2,911 (Yen)	897 M.N.	(9) (Dls)	56 M.N.	120 M.N.	124 M.N.	7,315 M.N.	10,060 M.N.
Tipo de cambio	4.741055			4.741055	0.168540		13.408400					
Monto Nominal Valorizado	7,815	4,620	7,731	11,008	6,727	1,860	2,495	2,579	867	872	45,446	48,188
Operaciones financieras derivadas	3,196		(3,276)		4,868		(84)		(5)		(2,742)	

FORWARD	Compra Euros POSICIÓN		Compra Dólar POSICIÓN		Venta Dólar POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de cobertura						
Monto Nominal	72 (Euro)	1,359 M.N.	55 (Dls)	728 M.N.	559 M.N.	40 (Dls)
Valuación	0 (Euro)	(46) M.N.	0 (Dls)	(18) M.N.	0 M.N.	0 (Dls)
Tipo de cambio	16.988440		13.408400		13.408400	
Monto Nominal Valorizado	1,223	1,313	733	710	559	536
Operaciones financieras derivadas	(90)		23		23	