

Artículo 181, Fracción IX

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos)

SWAP	Udis / Pesos		Pesos / Udis		Dólar / Pesos		Pesos / Dólar		Tasas de interés		Tasas de interés	
	POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN	
Con fines de negociación	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Monto Nominal	109 (Udis)	500 M.N.	500 M.N.	109 (Udis)	145 (DlIs)	1,884 M.N.	1,890 M.N.	146 (DlIs)	0 (DlIs)	0 (DlIs)	0 M.N.	0 M.N.
Intereses devengados	0 (Udis)	1 M.N.	1 M.N.	0 (Udis)	0 (DlIs)	11 M.N.	15 M.N.	1 (DlIs)	1 (DlIs)	1 (DlIs)	477 M.N.	474 M.N.
Valuación	5 (Udis)	1 M.N.	1 M.N.	5 (Udis)	31 (DlIs)	443 M.N.	448 M.N.	31 (DlIs)	43 (DlIs)	43 (DlIs)	27,123 M.N.	26,877 M.N.
Tipo de cambio	4.759784			4.759784	12.809300			12.809300	12.809300	12.809300		
Monto Nominal Valorizado	542	502	502	542	2,270	2,338	2,353	2,272	560	558	27,600	27,351
Operaciones financieras derivadas	40		(40)		(68)		81		2		249	

SWAP	Udis / Pesos		Pesos / Udis		Yenes / Pesos		Dólar / Pesos		Tasas de interés (Flujos de Efectivo)		Tasas de interés	
	POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN	
Con fines de cobertura	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Monto Nominal	1,303 (Udis)	4,717 M.N.	7,741 M.N.	1,861 (Udis)	37,000 (Yen)	959 M.N.	193 (DlIs)	2,469 M.N.	757 M.N.	754 M.N.	34,885 M.N.	34,895 M.N.
Intereses devengados	117 (Udis)	14 M.N.	17 M.N.	7 (Udis)	287 (Yen)	2 M.N.	0 (DlIs)	9 M.N.	29 M.N.	6 M.N.	298 M.N.	191 M.N.
Valuación	143 (Udis)	(111) M.N.	(3) M.N.	321 (Udis)	3,879 (Yen)	862 M.N.	(4) (DlIs)	22 M.N.	92 M.N.	93 M.N.	7,939 M.N.	8,874 M.N.
Tipo de cambio	4.759784			4.759784	0.155760		12.809300					
Monto Nominal Valorizado	7,438	4,620	7,755	10,420	6,412	1,823	2,432	2,500	878	853	43,122	43,960
Operaciones financieras derivadas	2,818		(2,665)		4,589		(68)		25		(838)	

FORWARD	Compra Euros		Compra Dólar	
	POSICIÓN		POSICIÓN	
Con fines de cobertura	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Monto Nominal	93 (Euro)	1,743 M.N.	60 (DlIs)	792 M.N.
Valuación	(0) (Euro)	(61) M.N.	(0) (DlIs)	(25) M.N.
Tipo de cambio	17.092730		12.809300	
Monto Nominal Valorizado	1,591	1,682	763	767
Operaciones financieras derivadas	(91)		(4)	