

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		
<b>Monto Nominal Valorizado</b>	<b>542</b>	<b>502</b>	<b>502</b>	<b>542</b>	<b>2,270</b>	<b>2,338</b>	<b>2,353</b>	<b>2,272</b>	<b>560</b>	<b>558</b>	<b>27,600</b>	<b>27,351</b>
<b>Operaciones financieras derivadas</b>	<b>40</b>		<b>(40)</b>		<b>(68)</b>		<b>81</b>		<b>2</b>		<b>249</b>	

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					
<b>Monto Nominal Valorizado</b>	<b>7,438</b>	<b>4,620</b>	<b>7,755</b>	<b>10,420</b>	<b>6,412</b>	<b>1,823</b>	<b>2,432</b>	<b>2,500</b>	<b>878</b>	<b>853</b>	<b>43,122</b>	<b>43,960</b>
<b>Operaciones financieras derivadas</b>	<b>2,818</b>		<b>(2,665)</b>		<b>4,589</b>		<b>(68)</b>		<b>25</b>		<b>(838)</b>	

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	
<b>Monto Nominal Valorizado</b>	<b>1,591</b>	<b>1,682</b>	<b>763</b>	<b>767</b>
<b>Operaciones financieras derivadas</b>	<b>(91)</b>		<b>(4)</b>	

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

Disposiciones de carácter general aplicables a las Instituciones de Crédito  
Reporte del Primer Trimestre de 2012