

Artículo 181, Fracción IX

Montos nominales de los derivados por tipo de instrumento y por subyacente

(Cifras en millones de pesos)

SWAPS	Udi / Peso		Peso / Udi		Dólar / Peso		Peso / Dólar		Tasas de interés Dólar / Dólar		Tasas de interés Peso / Peso	
	POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de negociación												
Monto nominal	109	500	500	109	146	1,895	1,946	150	0	0	0	0
Intereses devengados	0	1	1	0	3	11	15	5	1	1	512	506
Valuación	8	1	1	8	35	541	550	34	107	102	30,602	30,230
Tipo de cambio	4.805421			4.805421	12.869500		12.869500		12.869500	12.869500		
Monto nominal valorizado	565	502	502	565	2,333	2,447	2,511	2,379	1,380	1,319	31,114	30,736
Saldo deudor(acreedor)	63		(63)		(114)		132		61		378	

SWAPS	Udi / Peso		Peso / Udi		Yen / Peso		Dólar / Peso		Tasas de interés (Flujos de Efectivo)		Tasas de interés Peso / Peso	
	POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN		POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de cobertura												
Monto nominal	1,303	4,717	7,644	1,837	37,000	959	200	2,569	734	730	44,332	44,342
Intereses devengados	125	18	15	7	287	1	0	9	28	6	301	210
Valuación	249	(110)	(2)	498	4,238	914	(7)	42	118	122	7,486	10,283
Tipo de cambio	4.805421			4.805421	0.165500		12.869500					
Monto nominal valorizado	8,060	4,625	7,657	11,255	6,872	1,874	2,489	2,620	880	858	52,119	54,835
Saldo deudor(acreedor)	3,435		(3,598)		4,998		(131)		22		(2,716)	

FORWARDS	Compra Euro / Peso		Compra Dólar / Peso	
	POSICIÓN		POSICIÓN	
	ACTIVA	PASIVA	ACTIVA	PASIVA
Con fines de cobertura				
Monto nominal	72	1,358	55	728
Valuación	0	(36)	0	(12)
Tipo de cambio	16.595220		12.869500	
Monto nominal valorizado	1,195	1,322	705	716
Saldo deudor(acreedor)	(127)		(11)	

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