

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 origen						Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	450	2	42	-	494	6.021319	2,977	1,311	-
Pasivo - Peso	1,654	12	-	-	1,666	1	1,666	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,654	12	-	-	1,666	1	1,666	-	-
Pasivo - Udi	450	2	41	-	493	6	2,972	-	1,306
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	85	-	13	-	98	18.270900	1,783	562	-
Pasivo - Peso	1,093	3	125	-	1,221	1	1,221	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,524	103	(245)	-	5,382	1	5,382	-	-
Pasivo - Dólar	391	2	20	-	413	18.270900	7,545	-	2,163
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	10	663	-	673	18.270900	12,302	1,363	-
Pasivo - Dólar	-	9	636	-	645	18.270900	11,787	-	848
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	15	826	31,460	-	32,301	1	32,301	1,841	-
Pasivo - Peso	15	822	31,113	-	31,950	1	31,950	-	1,490
II. FORWARDS									
Forward Dólar / Peso									
Activo - Euro	116	-	(3)	-	113	18.270900	2,070	-	-
Pasivo - Peso	2,401	-	(175)	-	2,226	1	2,226	-	156
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	46	-	-	-	46	22.564560	1,030	12	-
Pasivo - Peso	1,050	-	(32)	-	1,018	1	1,018	-	-
Forward Peso / Dólar									
Activo - Peso	2,410	-	(176)	-	2,234	1	2,234	164	-
Pasivo - Euro	116	-	(3)	-	113	18.270900	2,070	-	-
Forward Peso / Euro									
Activo - Peso	1,063	-	(32)	-	1,031	1	1,031	1	-
Pasivo - Euro	46	-	-	-	46	22.564560	1,031	-	1
TOTAL NEGOCIACIÓN								5,254	5,962

Artículo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación	
								Activo	Pasivo
								Moneda Nacional	

Swap Udis / Peso

	Moneda origen						Moneda Nacional		
Activo - Udis	1,135	216	7	-	1,358	6.021319	8,178	3,279	-
Pasivo - Peso	4,935	32	(68)	-	4,899	1	4,899	-	-

Swap Peso / Udi

Activo - Peso	5,961	10	155	-	6,126	1	6,126	-	-
Pasivo - Udi	1,198	2	19	-	1,219	6.021319	7,340	-	1,214

Swap Yen / Peso

Activo - Yen	37,000	287	16,349	-	53,636	0.172060	9,229	7,543	-
Pasivo - Peso	384	2	1,300	-	1,686	1	1,686	-	-

Swap Dólar / Peso

Activo - Dólar	168	1	(6)	-	163	18.270900	2,989	657	-
Pasivo - Peso	2,468	13	(137)	-	2,344	1	2,344	-	12

Swap Peso / Dólar

Activo - Dólar	186	1	29	-	216	18.270900	216	-	-
Pasivo - Peso	10	-	3	-	13	1	238	-	22

Swap de Tasas de Interés (Flujo de efectivo) Peso / Peso

Activo - Peso	478	18	21	-	517	1	517	24	-
Pasivo - Peso	469	3	21	-	493	1	493	-	-

Swap de Tasas de Interés (Flujo de efectivo) Dólar / Peso

Activo - Dólar	64	-	2	-	66	18.270900	1,205	392	-
Pasivo - Peso	820	4	(10)	-	814	1	814	-	1

Swap de Tasas de Interés Peso / Peso

Activo - Peso	50,238	1,547	26,006	-	77,791	1	77,791	3,662	-
Pasivo - Peso	50,238	675	24,800	-	75,713	1	75,713	-	1,584

II. FORWARDS

Forward Euro / Peso

Activo - Euro	104	-	-	-	104	22.564560	2,356	22	-
Pasivo - Peso	2,527	-	(117)	-	2,410	1	2,410	-	76

TOTAL COBERTURA

15,579 2,909