Articulo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACIÓN

I. SWAPS

	Monto nocional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación Activo	Presentación Pasivo
	Moneda origen						Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	408	2	28	-	438	6.260628	2,738	1,229	-
Pasivo - Peso	1,498	11	-	-	1,509	1	1,509	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,498	11	-	-	1,509	1	1,509	-	-
Pasivo - Udi	408	2	27	-	437	6.260628	2,733	-	1,224
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	77	-	12	-	89	19.377900	1,729	639	-
Pasivo - Peso	998	3	89	-	1,090	1	1,090	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,433	109	- 291	-	5,251	1	5,251	-	-
Pasivo - Dólar	384	3	16	-	403	19.377900	7,808	-	2,557
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	290	15,591	-	52,881	0.174830	9,244	7,400	-
Pasivo - Peso	384	2	1,458	-	1,844	1	1,844	-	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	13	619	-	632	19.377900	12,251	1,606	-
Pasivo - Dólar	-	12	590	-	602	19.377900	11,687	-	1,042
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	188	930	31,482	-	32,600	1	32,600	1,916	-
Pasivo - Peso	188	926	31,186	-	32,300	1	32,300	-	1,616

II. FORWARDS

Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	52	-	(1)	-	51	19.377900	1,006	-	-
Pasivo - Peso	1,106	-	(38)	-	1,068	1	1,068	-	62
Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	17	-	-	-	17	21.754600	367	-	-
Pasivo - Peso	433	-	(4)	-	429	1	429	-	62
Forward Peso / Dólar									
Activo - Peso	1,107	-	(38)	-	1,069	1	1,069	63	-
Pasivo -Dólar	52	-	(1)	-	51	19.377900	1,006	-	-
Forward Peso / Euro									
Activo - Peso	400	-	(3)	-	397	1	397	30	-
Pasivo - Euro	17	-	-	-	17	21.754600	367	-	-
TOTAL NEGOCIACION								**12,883**	**6,563**

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

Articulo 181 Fracción IX

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

DERIVADOS CON FINES DE COBERTURA

I. SWAPS

	Monto nocional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación Activo	Presentación Pasivo
	Moneda origen						Moneda Nacional		
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	1,229	234	(29)	-	1,434	6.260628	8,977	3,526	-
Pasivo - Peso	5,556	36	(130)	-	5,462	1	5,462	-	11
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	9,843	45	458	-	10,346	1	10,346	-	-
Pasivo - Udi	1,828	15	75	-	1,918	6.260628	12,007	-	1,661
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	166	1	(4)	-	163	19.377900	3,158	842	-
Pasivo - Peso	2,429	14	(127)	-	2,316	1	2,316	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,529	28	665	-	4,222	1	4,222	-	-
Pasivo - Dólar	182	2	64	-	248	19.377900	4,807	-	585
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	380	16	12	-	408	1	408	23	-
Pasivo - Peso	370	3	12	-	385	1	385	-	-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	67	-	1	-	68	19.377900	1,323	443	-
Pasivo - Peso	891	4	(15)	-	880	1	880	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	40,780	1,978	30 532	-	73,290	1	73,290	4,710	-
Pasivo - Peso	40,780	663	28 475	-	69,918	1	69,918	-	1,338

II. FORWARDS

Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	8	-	0	-	8	21.754600	184	-	-
Pasivo - Peso	236	-	(22)	-	214	1	214	-	30
TOTAL COBERTURA								**9,544**	**3,625**

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