

**Artículo 181 Fracción IX**

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

<b>DERIVADOS CON FINES DE NEGOCIACION</b>											
<b>I. SWAPS</b>											
	Monto nacional	Intereses	Valuación	Deterioro	Total	Tipo de cambio	Total valorizado	Presentación			
								Moneda origen		Activo	Pasivo
										Moneda Nacional	
<b>Swap Udis / Peso</b>											
Activo - Udis	396	2	31	-	429	6.258791	2,688	1,222	-		
Pasivo - Peso	1,455	11	-	-	1,466	1	1,466	-	-		
<b>Swap Peso / Udi</b>											
Activo - Peso	1,455	11	-	-	1,466	1	1,466	-	-		
Pasivo - Udi	396	2	31	-	429	6.258791	2,683	-	1,217		
<b>Swap Dólar / Peso</b>											
Activo - Dólar	75	-	13	-	88	19.208700	1,697	612	-		
Pasivo - Peso	974	2	109	-	1,085	1	1,085	-	-		
<b>Swap Peso / Dólar</b>											
Activo - Peso	5,409	46	(165)	-	5,290	1	5,290	-	-		
Pasivo - Dólar	382	4	17	-	403	19.208700	7,730	-	2,440		
<b>Swap Yen / Peso</b>											
Activo - Yen	37,000	12	16,005	-	53,017	0.178350	9,456	7,693	-		
Pasivo - Peso	384	1	1,378	-	1,763	1	1,763	-	-		
<b>Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar</b>											
Activo - Dólar	-	15	566	-	581	19.208700	11,168	2,166	-		
Pasivo - Dólar	-	15	537	-	552	19.208700	10,603	-	1,601		
<b>Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso</b>											
Activo - Peso	184	934	30,752	-	31,870	1	31,870	2,252	-		
Pasivo - Peso	184	917	30,421	-	31,522	1	31,522	-	1,904		
<b>II. FORWARDS</b>											
<b>Forward Dólar / Peso</b>											
Activo - Dólar	26	-	-	-	26	19.208700	499	-	-		
Pasivo - Peso	560	-	(19)	-	541	1	541	-	42		
<b>Forward Peso / Dólar</b>											
Activo - Peso	560	-	(19)	-	541	1	541	42	-		
Pasivo - Dólar	26	-	-	-	26	19.208700	499	-	-		
<b>TOTAL NEGOCIACION</b>								<b>13,987</b>	<b>7,204</b>		

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			
								Moneda origen		Activo	Pasivo
								Moneda Nacional			
<b>Swap Udis / Peso</b>											
Activo - Udis	1,589	244	14	-	1,847	6.258791	11,562	3,848	-		
Pasivo - Peso	7,806	43	(124)	-	7,725	1	7,725	-	11		
<b>Swap Peso / Udi</b>											
Activo - Peso	10,052	40	490	-	10,582	1	10,582	-	-		
Pasivo - Udi	1,862	24	147	-	2,033	6.258791	12,722	-	2,140		
<b>Swap Dólar / Peso</b>											
Activo - Dólar	162	-	(3)	-	159	19.208700	3,073	804	-		
Pasivo - Peso	2,375	13	(119)	-	2,269	1	2,269	-	-		
<b>Swap Peso / Dólar</b>											
Activo - Peso	3,531	26	699	-	4,256	1	4,256	-	-		
Pasivo - Dólar	182	3	79	-	264	19.208700	5,061	-	805		
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso</b>											
Activo - Peso	358	7	18	-	383	1	383	3	-		
Pasivo - Peso	359	3	18	-	380	1	380	-	-		
<b>Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso</b>											
Activo - Dólar	69	-	1	-	70	19.208700	1,340	399	-		
Pasivo - Peso	926	17	(2)	-	941	1	941	-	-		
<b>Swap de Tasas de Interes Peso / Peso</b>											
Activo - Peso	40,490	1,512	31,271	-	73,273	1	73,273	3,120	-		
Pasivo - Peso	40,489	901	30,953	-	72,343	1	72,343	-	2,190		
<b>II. FORWARDS</b>											
<b>Forward Euro / Peso</b>											
Activo - Euro	8	-	-	-	8	21.871990	185	-	-		
Pasivo - Peso	236	-	(17)	-	219	1	219	-	34		
<b>TOTAL COBERTURA</b>								<b>8,174</b>	<b>5,180</b>		