

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 Nacional	
Moneda origen									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	384	2	32	-	418	6.291411	2,632	1,219	-
Pasivo - Peso	1,413	-	-	-	1,413	1	1,413	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,413	-	-	-	1,413	1	1,413	-	-
Pasivo - Udi	384	2	31	-	417	6.291411	2,629	-	1,216
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	73	-	13	-	86	19.734500	1,712	628	-
Pasivo - Peso	948	-	136	-	1,084	1	1,084	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,380	104	(9)	-	5,475	1	5,475	-	-
Pasivo - Dólar	380	2	18	-	400	19.734500	7,893	-	2,418
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	286	16,282	-	53,568	0.182620	9,783	7,854	-
Pasivo - Peso	384	1	1,544	-	1,929	1	1,929	-	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	11	517	-	528	19.734500	10,408	2,863	-
Pasivo - Dólar	-	10	488	-	498	19.734500	9,835	-	2,290
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	223	897	29,806	-	30,926	1	30,926	3,309	-
Pasivo - Peso	223	892	29,423	-	30,538	1	30,538	-	2,921
II. FORWARDS									
Forward Dólar / Peso									
Activo - Dólar	26	-	-	-	26	19.734500	516	-	-
Pasivo - Peso	560	-	(8)	-	552	1	552	-	36
Forward Peso / Dólar									
Activo - Peso	560	-	(8)	-	552	1	552	36	-
Pasivo - Dólar	26	-	-	-	26	19.734500	516	-	-
TOTAL NEGOCIACIÓN								15,909	8,881

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									
Activo - Udis	1,630	247	28	-	1,905	6.291411	11,984	4,010	-
Pasivo - Peso	8,066	43	(125)	-	7,984	1	7,984	-	10
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	9,975	22	510	-	10,507	1	10,507	-	-
Pasivo - Udi	1,846	14	175	-	2,035	6.291411	12,796	-	2,289
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	162	1	(1)	-	162	19.734500	3,194	959	-
Pasivo - Peso	2,340	4	(109)	-	2,235	1	2,235	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,528	11	746	-	4,285	1	4,285	-	-
Pasivo - Dólar	182	2	102	-	286	19.734500	5,650	-	1,365
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	358	15	26	-	399	1	399	30	-
Pasivo - Peso	343	-	26	-	369	1	369	-	-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	67	-	1	-	68	19.734500	1,343	427	-
Pasivo - Peso	897	3	16	-	916	1	916	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	39,986	1,493	29 885	-	71,364	1	71,364	2,641	-
Pasivo - Peso	39,986	641	31 807	-	72,434	1	72,434	-	3,711

II. FORWARDS

Forward Euro / Peso									
Activo - Euro	8	-	-	-	8	21.515540	182	-	-
Pasivo - Peso	236	-	(12)	-	224	1	224	-	42

TOTAL COBERTURA **8,067** **7,417**