

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	362	2	23	-	387	6.499174	2,510	1,181	-
Pasivo - Peso	1,329	-	-	-	1,329	1	1,329	-	-
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	1,329	-	-	-	1,329	1	1,329	-	-
Pasivo - Udi	362	2	22	-	386	6.499174	2,506	-	1,177
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	70	-	15	-	85	23.484700	1,984	955	-
Pasivo - Peso	900	-	129	-	1,029	1	1,029	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	5,332	104	65	-	5,501	1	5,501	-	-
Pasivo - Dólar	376	2	18	-	396	23.484700	9,296	-	3,795
Swap Yen / Peso									
Activo - Yen	37,000	284	16,023	-	53,307	0.217470	11,593	6,735	-
Pasivo - Peso	384	-	4,474	-	4,858	1	4,858	-	-
Swap de Tasas de Interes Dólar / Dólar									
Activo - Dólar	-	10	432	-	442	23.484700	10,381	6,065	-
Pasivo - Dólar	-	9	402	-	411	23.484700	9,655	-	5,339
Swap de Tasa de Intereses Peso / Peso									
Activo - Peso	220	947	31,608	-	32,775	1	32,775	3,474	-
Pasivo - Peso	220	942	31,219	-	32,381	1	32,381	-	3,080

TOTAL NEGOCIACIÓN

18,410 13,391

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	
Moneda origen									
Swap Udis / Peso									
Activo - Udis	1,936	257	(18)	-	2,175	6.499174	14,137	4,298	-
Pasivo - Peso	10,016	28	(90)	-	9,954	1	9,954	-	115
Swap Peso / Udi									
Activo - Peso	10,389	22	626	-	11,037	1	11,037	-	-
Pasivo - Udi	1,906	15	150	-	2,071	6.499174	13,458	-	2,421
Swap Dólar / Peso									
Activo - Dólar	157	1	1	-	159	23.484700	3,732	1,570	-
Pasivo - Peso	2,258	4	(100)	-	2,162	1	2,162	-	-
Swap Peso / Dólar									
Activo - Peso	3,530	11	720	-	4,261	1	4,261	-	-
Pasivo - Dólar	182	2	138	-	322	23.484700	7,578	-	3,317
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Peso / Peso									
Activo - Peso	335	14	27	-	376	1	376	30	-
Pasivo - Peso	320	-	26	-	346	1	346	-	-
Swap de Tasas de Interes (Flujo de efectivo) Dólar / Peso									
Activo - Dólar	67	-	1	-	68	23.484700	1,585	653	-
Pasivo - Peso	905	3	24	-	932	1	932	-	-
Swap de Tasas de Interes Peso / Peso									
Activo - Peso	35,858	1,473	30 360	-	67,691	1	67,691	2,973	-
Pasivo - Peso	35,858	629	31 304	-	67,791	1	67,791	-	3,073
TOTAL COBERTURA								9,524	8,926