



Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre de 2020)

| Instrumento | Subyacente | Valor nominal | Valuación | Saldo antes de compensar | Compensación | Valor de mercado |
|--|------------|---------------|------------|--------------------------|--------------|-------------------------|
| A recibir | | | | | | |
| Contratos adelantados a recibir por negociación * | Divisa | \$ 206,409 | \$ 85,586 | \$ 85,586 | \$(83,696) | \$ 1,890 |
| Contratos adelantados a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 1,890</u> |
| Opciones a recibir por negociación * | Tasa | \$ 6,020 | \$ 18 | \$ 18 | - | \$ 18 |
| Opciones a recibir por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 18</u> |
| Opciones a recibir por negociación * | Divisa | \$ 9,002 | \$ 1,869 | \$ 1,869 | - | \$ 1,869 |
| Opciones a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 1,869</u> |
| Swaps a recibir por negociación * | Tasa | \$ 1,836,974 | \$ 298,055 | \$ 298,055 | \$(234,206) | \$ 63,849 |
| Swaps a recibir por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 63,849</u> |
| Swaps a recibir por negociación * | Divisa | \$ 253,660 | \$ 271,868 | \$ 271,868 | \$(248,101) | \$ 23,767 |
| Swaps a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 23,767</u> |
| | | | | | | <u>\$ 91,393</u> |
| Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor) | | | | | | |
| A entregar | | | | | | |
| Contratos adelantados a entregar por negociación * | Divisa | \$ 207,638 | \$ 85,543 | \$ 85,543 | \$(83,696) | \$ 1,847 |
| Contratos adelantados a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 1,847</u> |
| Opciones a entregar por negociación * | Tasa | \$ 6,020 | \$ 18 | \$ 18 | - | \$ 18 |
| Opciones a entregar por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 18</u> |
| Opciones a entregar por negociación * | Divisa | \$ 9,002 | \$ 1,869 | \$ 1,869 | - | \$ 1,869 |
| Opciones a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 1,869</u> |
| Swaps a entregar por negociación * | Tasa | \$ 1,821,337 | \$ 298,660 | \$ 298,660 | \$(234,206) | \$ 64,454 |
| Swaps a entregar por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 64,454</u> |
| Swaps a entregar por negociación * | Divisa | \$ 253,889 | \$ 271,992 | \$ 271,992 | \$(248,101) | \$ 23,891 |
| Swaps a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 23,891</u> |
| | | | | | | <u>\$ 92,079</u> |
| Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor) | | | | | | |

Los valores nominales relacionados con los instrumentos financieros derivados reflejan el volumen de actividad; sin embargo, no reflejan los importes en riesgo. Los montos en riesgo se encuentran generalmente limitados a la utilidad o pérdida no realizada por valuación a mercado de estos instrumentos, la cual puede variar de acuerdo con los cambios en el valor a mercado del bien subyacente, su volatilidad y la calidad crediticia de las contrapartes.

* El valor nominal de este rubro se encuentra fuera de balance.