

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio 2021)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 23,874	\$ 186,008	\$ 186,008	\$ (184,174)	\$ 1,834
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,834</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,862	\$ 80	\$ 80	\$ -	\$ 80
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 80</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 8,689	\$ 1,229	\$ 1,229	\$ -	\$ 1,229
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,229</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,694,110	\$ 282,121	\$ 282,121	\$ (247,971)	\$ 34,150
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 34,150</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 252,159	\$ 252,159	\$ (225,530)	\$ 26,629
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 26,629</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 63,922</u>
A entregar						
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 273,772	\$ 185,801	\$ 185,801	\$ (184,174)	\$ 1,627
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,627</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,862	\$ 80	\$ 80	\$ -	\$ 80
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 80</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 8,689	\$ 1,229	\$ 1,229	\$ -	\$ 1,229
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,229</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,681,347	\$ 282,822	\$ 282,822	\$ (247,971)	\$ 34,851
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 34,851</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 252,370	\$ 252,370	\$ (225,530)	\$ 26,840
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 26,840</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 64,627</u>

Los valores nacionales 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.