Instrumentos financieros derivados

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

Instrumento	Subyacente	Val	or nocional	,	Valuación		ldo antes de compensar	C	ompensación	Valor	de mercad
cibir											
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$	23,874	\$	186,008	\$	186,008	\$	(184,174)	\$	1,8
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa		-		-		-		-	\$	1,8
Opeignos a regibir por pogosicoión *	T	Φ.	0.000	Φ.	00	Φ.	00	•			<u> </u>
Opciones a recibir por negociación * Opciones a recibir por cobertura *	Tasa Tasa	\$	3,862	Ф	80	Ъ	80	Ъ	-	\$	
										\$	
Opciones a recibir por negociación * Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	\$	8,689	\$	1,229	\$	1,229	\$	-	\$	1,2
	Divisa		-		-		-		-	\$	1,2
Curana a racibir nor nagociación *	Toolo	œ.	1 604 110	¢	202.424	¢.	202 424	œ	(247.074)	•	24.4
Swaps a recibir por negociación * Swaps a recibir por cobertura *	Tasa Tasa	\$	1,694,110 -	Ф	282,121	Ъ	282,121	Ф	(247,971)	\$	34,1
										\$	34,1
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$	244,610	\$	252,159	\$	252,159	\$	(225,530)	\$	26,6
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa		-		-		-			•	
o napo a room por observara											
raciones con instrumentos financieros derivado	os (saldo deudo	or)								\$	
	os (saldo deudo Divisa Divisa	or) \$	273,772 -	\$	185,801 -	\$	185,801 -	\$	(184,174) -	\$	63,9
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	•	273,772 -	\$	185,801 -	\$	185,801 -	\$	(184,174) -	\$	63,9
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación *	Divisa Divisa Tasa	•	273,772 - 3,862		185,801 - 80	\$	185,801 - 80		(184,174) - -	\$	1,6 1,6
eraciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa Divisa	\$	-		-		-		(184,174) - - - -	\$ \$ \$ \$	1,6 1,6
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa	\$	3,862	\$	80	\$	80	\$	(184,174) - - - -	\$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa	\$	-	\$	-	\$	-	\$	(184,174) - - - - -	\$ \$ \$ \$	1,6 1,6
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa	\$	3,862	\$	80	\$	80	\$	(184,174) - - - - - -	\$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa	\$ \$	3,862 - 8,689	\$	1,229	\$	80 - 1,229	\$	- - -	\$ \$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6 1,6
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa	\$	3,862	\$	80	\$	80	\$	(184,174) - - - - - - (247,971)	\$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$	26,6 63,9 1,6 1,6 1,2 34,8
raciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa Divisa	\$ \$	3,862 - 8,689	\$	1,229	\$	80 - 1,229	\$	- - -	\$ \$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6 1,6
craciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura * Swaps a entregar por negociación * Swaps a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa Divisa Divisa Tasa Tasa Tasa	\$ \$	3,862 - 8,689	\$ \$	1,229	\$	80 - 1,229	\$	- - -	\$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6 1,2 1,2 34,8
craciones con instrumentos financieros derivado ntregar Contratos adelantados a entregar por negociación * Contratos adelantados a entregar por cobertura * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por negociación * Opciones a entregar por cobertura * Swaps a entregar por negociación * Swaps a entregar por cobertura *	Divisa Divisa Tasa Tasa Divisa Divisa Tasa	\$ \$ \$	3,862 - 8,689 - 1,681,347	\$ \$	1,229 - 282,822	\$	1,229 - 282,822	\$	- - - - - (247,971)	\$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$ \$	1,6 1,6 1,2 34,8

Los valores nocionales 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 nocional de este rubro se encuentra fuera de balance.