

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2022)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 158,023	\$ 103,491	\$ 103,491	\$ (100,673)	\$ 2,818
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,818</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 4,922	\$ 236	\$ 236	\$ -	\$ 236
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 236</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 8,529	\$ 1,059	\$ 1,059	\$ -	\$ 1,059
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,059</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,059,640	\$ 313,207	\$ 313,207	\$ (282,009)	\$ 31,198
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 31,198</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 187,558	\$ 187,558	\$ (177,222)	\$ 10,336
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,336</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 45,647</u>
A entregar						
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 161,759	\$ 103,442	\$ 103,442	\$ (100,673)	\$ 2,769
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,769</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 4,922	\$ 235	\$ 235	\$ -	\$ 235
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 235</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 8,529	\$ 1,059	\$ 1,059	\$ -	\$ 1,059
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,059</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,052,086	\$ 314,359	\$ 314,359	\$ (282,009)	\$ 32,350
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 32,350</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 187,478	\$ 187,478	\$ (177,222)	\$ 10,256
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,256</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 57
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 46,726</u>

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.