

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de Septiembre de 2022)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 167,938	\$ 101,746	\$ 101,746	\$ (99,329)	\$ 2,417
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,417</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 5,202	\$ 314	\$ 314	\$ -	\$ 314
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 314</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 11,913	\$ 1,821	\$ 1,821	\$ -	\$ 1,821
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,821</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,162,620	\$ 316,191	\$ 316,191	\$ (260,130)	\$ 56,062
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 56,062</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 182,314	\$ 182,314	\$ (169,724)	\$ 12,589
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,589</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 73,203</u>
A entregar						
Futuros a recibir por negociación	Tasa	\$ 444	\$ 476	\$ 476	\$ (444)	\$ 32
Futuros a recibir por cobertura	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 32</u>
Futuros a entregar por negociación	Divisas	\$ 1,436	\$ 1,436	\$ 1,436	\$ (1,425)	\$ 11
Futuros a entregar por cobertura	Divisas	-	-	-	-	-
						<u>\$ 11</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Tasa	\$ 168,973	\$ 101,714	\$ 101,714	\$ (99,329)	\$ 2,385
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,385</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 168,973	\$ 101,714	\$ 101,714	\$ (99,329)	\$ 2,385
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,385</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 5,202	\$ 314	\$ 314	\$ -	\$ 314
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 314</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 11,913	\$ 1,820	\$ 1,820	\$ -	\$ 1,820
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,820</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,154,981	\$ 316,754	\$ 316,754	\$ (260,130)	\$ 56,624
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 56,624</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 182,268	\$ 182,268	\$ (169,724)	\$ 12,544
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,544</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 55
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 73,785</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.