

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Tasa	\$ 482	\$ 482	\$ 482	\$ (7)	\$ 475
Futuros a recibir por cobertura	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 475</u>
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 5,181	\$ 5,181	\$ 5,181	\$ (8)	\$ 5,173
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 5,173</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 238,722	\$ 159,065	\$ 159,065	\$ (153,659)	\$ 5,406
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 5,406</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 2,392	\$ 175	\$ 175	\$ -	\$ 175
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 175</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 12,011	\$ 932	\$ 932	\$ -	\$ 932
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 932</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,250,383	\$ 246,696	\$ 246,696	\$ (215,653)	\$ 31,043
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 31,043</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 150,321	\$ 150,321	\$ (137,556)	\$ 12,765
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,765</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 175
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 56,144</u>
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Tasa	\$ 482	\$ 482	\$ 482	\$ (7)	\$ 475
Futuros a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 475</u>
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 4,438	\$ 4,438	\$ 4,438	\$ (8)	\$ 4,430
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 4,430</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,166	\$ 156,615	\$ 156,615	\$ (153,659)	\$ 2,956
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,956</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 2,392	\$ 175	\$ 175	\$ -	\$ 175
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 175</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 12,011	\$ 932	\$ 932	\$ -	\$ 932
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 932</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,251,033	\$ 246,640	\$ 246,640	\$ (215,653)	\$ 30,987
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 30,987</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 150,280	\$ 150,280	\$ (137,556)	\$ 12,724
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,724</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 77
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 52,756</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.