

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2024)

Instrumento	Subyacente	Valor notional	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Índice	\$ 488	\$ 488	\$ 488	\$(468)	\$ 20
Futuros a recibir por cobertura	Índice	-	-	-	-	-
						<u>\$ 20</u>
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 19,531	\$ 19,531	\$ 19,531	\$(15,587)	\$ 3,944
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,944</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 226,331	\$ 141,079	\$ 141,079	\$(137,415)	\$ 3,664
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,664</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,036	\$ 170	\$ 170	-	\$ 170
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 170</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 14,807	\$ 1,037	\$ 1,037	-	\$ 1,037
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,037</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,048,082	\$ 217,645	\$ 217,645	\$(188,654)	\$ 28,991
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 28,991</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 186,869	\$ 191,224	\$ 191,224	\$(174,966)	\$ 16,258
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 16,258</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 105
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 54,189</u>
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Índice	\$ 469	\$ 469	\$ 469	\$(469)	\$ -
Futuros a entregar por cobertura *	Índice	-	-	-	-	-
						<u>\$ -</u>
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 19,641	\$ 19,641	\$ 19,641	\$(15,587)	\$ 4,054
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 4,054</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 234,916	\$ 141,086	\$ 141,086	\$(137,415)	\$ 3,671
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,671</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,036	\$ 170	\$ 170	-	\$ 170
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 170</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 14,807	\$ 1,037	\$ 1,037	-	\$ 1,037
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,037</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,048,432	\$ 217,419	\$ 217,419	\$(188,654)	\$ 28,765
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 28,765</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 186,888	\$ 191,227	\$ 191,227	\$(174,966)	\$ 16,261
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 16,261</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 71
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 54,029</u>

Los valores notacionales 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 notional de este rubro se encuentra fuera de balance.