

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2024)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Índice	\$ 395	\$ 395	\$ 395	\$(395)	\$ -
Futuros a recibir por cobertura	Índice	-	-	-	-	-
						\$ -
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 4,543	\$ 4,543	\$ 4,543	-	\$ 4,543
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 4,543
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 247,642	\$ 159,951	\$ 159,951	\$(157,391)	\$ 2,560
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 2,560
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 174	\$ 174	\$ 174	-	\$ 174
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 174
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 1,377	\$ 1,376	\$ 1,376	-	\$ 1,376
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 1,376
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,081,152	\$ 226,035	\$ 226,035	\$(191,715)	\$ 34,320
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 34,320
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 183,252	\$ 186,480	\$ 186,480	\$(174,799)	\$ 11,681
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 11,681
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 128
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						\$ 54,782
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Índice	\$ 399	\$ 399	\$ 399	\$(395)	\$ 4
Futuros a entregar por cobertura *	Índice	-	-	-	-	-
						\$ 4
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 4,254	\$ 4,254	\$ 4,254	-	\$ 4,254
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 4,254
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 256,037	\$ 160,118	\$ 160,118	\$(157,391)	\$ 2,727
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 2,727
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 174	\$ 174	\$ 174	-	\$ 174
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 174
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 1,377	\$ 1,376	\$ 1,376	-	\$ 1,376
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 1,376
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,081,502	\$ 225,638	\$ 225,638	\$(191,715)	\$ 33,923
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 33,923
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 183,889	\$ 186,198	\$ 186,198	\$(174,799)	\$ 11,399
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 11,399
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 58
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						\$ 53,915

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.