

# Instrumentos financieros derivados

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

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
<b>A recibir</b>						
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 5,376	\$ 5,376	\$ 5,376	\$ (1,199)	\$ 4,177
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 4,177</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 264,603	\$ 170,554	\$ 170,554	\$ (166,723)	\$ 3,831
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,831</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 121	\$ 121	\$ 121	\$ -	\$ 121
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 121</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 1,533	\$ 1,533	\$ 1,533	\$ -	\$ 1,533
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,533</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,054,468	\$ 217,780	\$ 217,780	\$ (193,436)	\$ 24,344
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 24,344</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 179,103	\$ 187,383	\$ 187,383	\$ (175,742)	\$ 11,641
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 11,641</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 101
<b>Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)</b>						<u><b>\$ 45,748</b></u>
<b>A entregar</b>						
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 5,419	\$ 5,419	\$ 5,419	\$ (1,199)	\$ 4,220
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 4,220</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 274,705	\$ 170,792	\$ 170,792	\$ (166,723)	\$ 4,069
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 4,069</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 121	\$ 121	\$ 121	\$ -	\$ 121
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 121</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 1,533	\$ 1,533	\$ 1,533	\$ -	\$ 1,533
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,533</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,054,818	\$ 217,666	\$ 217,666	\$ (193,436)	\$ 24,230
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 24,230</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 179,319	\$ 186,636	\$ 186,636	\$ (175,742)	\$ 10,894
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,894</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 56
<b>Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)</b>						<u><b>\$ 45,123</b></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.