

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2025)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 43,350	\$ 43,350	\$ 43,350	\$ (37,825)	\$ 5,525
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 501,835	\$ 343,148	\$ 343,148	\$ (340,346)	\$ 2,802
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,802</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 4,000	\$ 37	\$ 37	-	\$ 37
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 37</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 11,761	\$ 1,496	\$ 1,496	-	\$ 1,496
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,496</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,044,709	\$ 198,950	\$ 198,950	\$ (176,742)	\$ 22,208
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 22,208</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 188,092	\$ 183,834	\$ 183,834	\$ (174,877)	\$ 8,957
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 8,957</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ (66)
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 40,959</u>
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 43,465	\$ 43,465	\$ 43,465	\$ (37,825)	\$ 5,640
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 5,640</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 388,836	\$ 342,750	\$ 342,750	\$ (340,346)	\$ 2,404
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,404</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 4,000	\$ 37	\$ 37	-	\$ 37
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 37</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 11,761	\$ 1,496	\$ 1,496	-	\$ 1,496
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,496</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,045,059	\$ 198,586	\$ 198,586	\$ (176,742)	\$ 21,844
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 21,844</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 187,849	\$ 182,580	\$ 182,580	\$ (174,877)	\$ 7,703
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 7,703</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ (169)
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 38,955</u>

Los valores nacionales 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.