

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2026)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 21,166	\$ 21,166	\$ 21,166	\$ (10,560)	\$ 10,606
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,606</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 268,304	\$ 197,362	\$ 197,362	\$ (193,897)	\$ 3,465
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,465</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 2,294	\$ 13	\$ 13	-	\$ 13
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 13</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ -	\$ 2,036	\$ 2,036	-	\$ 2,036
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,036</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 825,890	\$ 158,988	\$ 158,988	\$ (143,329)	\$ 15,659
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 15,659</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 196,793	\$ 142,211	\$ 142,211	\$ (133,211)	\$ 9,000
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 9,000</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ (88)
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 40,691</u>
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 21,048	\$ 21,048	\$ 21,048	\$ (10,560)	\$ 10,488
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,488</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 260,051	\$ 197,438	\$ 197,438	\$ (193,897)	\$ 3,541
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,541</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 2,294	\$ 13	\$ 13	-	\$ 13
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 13</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ -	\$ 2,036	\$ 2,036	-	\$ 2,036
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,036</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 825,890	\$ 158,587	\$ 158,587	\$ (143,329)	\$ 15,258
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 15,258</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 196,792	\$ 142,252	\$ 142,252	\$ (133,211)	\$ 9,041
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 9,041</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ (148)
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 40,229</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.