



Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2019)

| Instrumento | Subyacente | Valor nominal | Valuación | Saldo antes de compensar | Compensación | Valor de mercado |
|--|------------|---------------|------------|--------------------------|--------------|-------------------------|
| A recibir | | | | | | |
| Contratos adelantados a recibir por negociación * | Divisa | \$ 235,036 | \$ 66,412 | \$ 66,412 | \$(63,990) | 2,422 |
| Contratos adelantados a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 2,422</u> |
| Opciones a recibir por negociación * | Tasa | \$ 15,220 | \$ 34 | \$ 34 | - | 34 |
| Opciones a recibir por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 34</u> |
| Opciones a recibir por negociación * | Divisa | \$ 21,903 | \$ 307 | \$ 307 | - | 307 |
| Opciones a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 307</u> |
| Swaps a recibir por negociación * | Tasa | \$ 1,410,973 | \$ 322,638 | \$ 322,638 | \$(302,326) | 20,312 |
| Swaps a recibir por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 20,312</u> |
| Swaps a recibir por negociación * | Divisa | \$ 218,861 | \$ 238,736 | \$ 238,736 | \$(224,084) | 14,652 |
| Swaps a recibir por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 14,652</u> |
| Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor) | | | | | | <u>\$ 37,727</u> |
| A entregar | | | | | | |
| Contratos adelantados a entregar por negociación * | Divisa | \$ 218,051 | \$ 66,645 | \$ 66,645 | \$(63,990) | 2,655 |
| Contratos adelantados a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 2,655</u> |
| Opciones a entregar por negociación * | Tasa | \$ 15,220 | \$ 34 | \$ 34 | - | 34 |
| Opciones a entregar por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 34</u> |
| Opciones a entregar por negociación * | Divisa | \$ 15,350 | \$ 307 | \$ 307 | - | 307 |
| Opciones a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 307</u> |
| Swaps a entregar por negociación * | Tasa | \$ 1,404,959 | \$ 323,003 | \$ 323,003 | \$(302,326) | 20,677 |
| Swaps a entregar por cobertura * | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 20,677</u> |
| Swaps a entregar por negociación * | Divisa | \$ 219,854 | \$ 239,657 | \$ 239,657 | \$(224,084) | 15,573 |
| Swaps a entregar por cobertura * | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | <u>\$ 15,573</u> |
| Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor) | | | | | | <u>\$ 39,246</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.