



Derivados

| Instrumento | Subyacente | Valor nominal * | Valuación * | Saldo antes de compensar | Compensación * | Valor de mercado * |
|--|------------|-----------------|-------------|--------------------------|----------------|--------------------|
| A RECIBIR | | | | | | |
| Futuros a recibir por negociación | Tasa | \$ 159,638 | \$ - | \$ 159,638 | \$ 159,638 | \$ - |
| Futuros a recibir por cobertura | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Futuros a recibir por negociación | Divisa | \$ 2,583 | \$ - | \$ 2,583 | \$ 2,583 | \$ - |
| Futuros a recibir por cobertura | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Contratos adelantados a recibir por negociación | Tasa | \$ 387,990 | \$ 1,182 | \$ 389,172 | \$ 388,661 | \$ 511 |
| Contratos adelantados a recibir por cobertura | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 511 |
| Contratos adelantados a recibir por negociación | Divisa | \$ 35,057 | \$ 260 | \$ 35,317 | \$ 35,142 | \$ 175 |
| Contratos adelantados a recibir por cobertura | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 175 |
| Opciones a recibir por negociación ** | Tasa | \$ - | \$ - | \$ - | \$ - | \$ - |
| Opciones a recibir por cobertura ** | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Opciones a recibir por negociación ** | Divisa | \$ 1,719 | \$ 18 | \$ 18 | \$ - | \$ 18 |
| Opciones a recibir por cobertura ** | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 18 |
| Swaps a recibir por negociación ** | Tasa | \$ 157,701 | \$ 61,181 | \$ 61,181 | \$ 56,416 | \$ 4,765 |
| Swaps a recibir por cobertura ** | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 4,765 |
| Swaps a recibir por negociación ** | Divisa | \$ 10,406 | \$ 11,226 | \$ 11,226 | \$ 10,952 | \$ 274 |
| Swaps a recibir por cobertura ** | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 274 |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (SALDO DEUDOR) | | | | | | \$ 5,743 |
| A ENTREGAR | | | | | | |
| Futuros a entregar por negociación | Tasa | \$ 159,638 | \$ - | \$ 159,638 | \$ 159,638 | \$ - |
| Futuros a entregar por cobertura | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Futuros a entregar por negociación | Divisas | \$ 2,583 | \$ - | \$ 2,583 | \$ 2,583 | \$ - |
| Futuros a entregar por cobertura | Divisas | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Contratos adelantados a entregar por negociación | Tasa | \$ 387,990 | \$ 1,454 | \$ 389,444 | \$ 388,661 | \$ 783 |
| Contratos adelantados a entregar por cobertura | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 783 |
| Contratos adelantados a entregar por negociación | Divisa | \$ 35,057 | \$ 267 | \$ 35,324 | \$ 35,142 | \$ 182 |
| Contratos adelantados a entregar por cobertura | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 182 |
| Opciones a entregar por negociación ** | Tasa | \$ - | \$ - | \$ - | \$ - | \$ - |
| Opciones a entregar por cobertura ** | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ - |
| Opciones a entregar por negociación ** | Divisa | \$ 1,719 | \$ 18 | \$ 18 | \$ - | \$ 18 |
| Opciones a entregar por cobertura ** | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 18 |
| Swaps a entregar por negociación ** | Tasa | \$ 157,701 | \$ 60,353 | \$ 60,353 | \$ 56,416 | \$ 3,937 |
| Swaps a entregar por cobertura ** | Tasa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 3,937 |
| Swaps a entregar por negociación ** | Divisa | \$ 11,062 | \$ 11,887 | \$ 11,887 | \$ 10,952 | \$ 935 |
| Swaps a entregar por cobertura ** | Divisa | - | - | - | - | - |
| | | | | | | \$ 935 |
| OPERACIONES CON INSTRUMENTOS FINANCIEROS DERIVADOS (SALDO ACREEDOR) | | | | | | \$ 5,855 |

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.

* Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre de 2010.

** El valor nominal de este rubro se encuentra fuera de balance.