

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2021)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Dólar	\$ 30,762	\$ 159,569	\$ 159,569	\$(157,525)	\$ 2,044
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,044</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 80	\$ 18	\$ 18	-	\$ 18
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 18</u>
Opciones a recibir por negociación *	Dólar	\$ 11,444	\$ 1,596	\$ 1,596	-	\$ 1,596
Opciones a recibir por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,596</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,685,913	\$ 288,374	\$ 288,374	\$(249,559)	\$ 38,815
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 38,815</u>
Swaps a recibir por negociación *	Dólar	\$ 247,164	\$ 254,990	\$ 254,990	\$(238,061)	\$ 16,929
Swaps a recibir por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 16,929</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 59,402</u>
A entregar						
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Dólar	\$ 271,019	\$ 159,522	\$ 159,522	\$(157,525)	\$ 1,997
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,997</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 80	\$ 17	\$ 17	-	\$ 17
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 17</u>
Opciones a entregar por negociación *	Dólar	\$ 11,444	\$ 1,595	\$ 1,595	-	\$ 1,595
Opciones a entregar por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,595</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,672,607	\$ 289,088	\$ 289,088	\$(249,559)	\$ 39,529
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 39,529</u>
Swaps a entregar por negociación *	Dólar	\$ 247,360	\$ 255,124	\$ 255,124	\$(238,061)	\$ 17,063
Swaps a entregar por cobertura *	Dólar	-	-	-	-	-
						<u>\$ 17,063</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 60,201</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.