

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de septiembre de 2021)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 129,866	\$ 90,064	\$ 90,064	\$(89,481)	\$ 583
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 583</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 2,670	\$ 126	\$ 126	-	\$ 126
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 126</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 8,801	\$ 1,343	\$ 1,343	-	\$ 1,343
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,343</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,747,218	\$ 288,348	\$ 288,348	\$(256,742)	\$ 31,606
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 31,606</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 223,455	\$ 223,455	\$(207,724)	\$ 15,731
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 15,731</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 49,389</u>
A entregar						
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 129,946	\$ 89,852	\$ 89,852	\$(89,481)	\$ 371
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 371</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 2,670	\$ 126	\$ 126	-	\$ 126
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 126</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 8,801	\$ 1,343	\$ 1,343	-	\$ 1,343
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,343</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,739,781	\$ 288,997	\$ 288,997	\$(256,742)	\$ 32,255
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 32,255</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 223,378	\$ 223,378	\$(207,724)	\$ 15,654
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 15,654</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 49,749</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.