

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2022)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 128,839	\$ 84,371	\$ 84,371	\$ (82,578)	\$ 1,793
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,793</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 5,202	\$ 279	\$ 279	\$ -	\$ 279
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 279</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 12,787	\$ 2,055	\$ 2,055	\$ -	\$ 2,055
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,055</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,209,820	\$ 311,562	\$ 311,562	\$ (268,917)	\$ 42,645
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 42,645</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 180,601	\$ 180,601	\$ (168,115)	\$ 12,486
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,486</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						\$ 59,258
A entregar						
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 130,542	\$ 83,572	\$ 83,572	\$ (82,578)	\$ 994
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 994</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 5,202	\$ 279	\$ 279	\$ -	\$ 279
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 279</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 12,787	\$ 2,055	\$ 2,055	\$ -	\$ 2,055
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,055</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,202,176	\$ 312,344	\$ 312,344	\$ (268,917)	\$ 43,427
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 43,427</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 180,555	\$ 180,555	\$ (168,115)	\$ 12,440
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,440</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 56
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						\$ 59,251

Los valores nacionales 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.