

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 31 de marzo de 2023)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Tasa	\$ 489	\$ 489	\$ 489	\$ (483)	\$ 6
Futuros a recibir por cobertura	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 6</u>
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 26,656	\$ 26,656	\$ 26,656	\$ -	\$ 26,656
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 26,656</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 267,701	\$ 169,627	\$ 169,627	\$ (164,300)	\$ 5,327
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 5,327</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 2,742	\$ 248	\$ 248	\$ -	\$ 248
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 248</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 12,517	\$ 1,278	\$ 1,278	\$ -	\$ 1,278
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,278</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,297,470	\$ 264,604	\$ 264,604	\$ (229,315)	\$ 35,289
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 35,289</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 158,586	\$ 158,586	\$ (148,162)	\$ 10,424
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,424</u>
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						<u>\$ 79,228</u>
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Tasa	\$ 489	\$ 1,088	\$ 1,088	\$ (483)	\$ 605
Futuros a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 605</u>
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 25,997	\$ 25,997	\$ 25,997	\$ -	\$ 25,997
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 25,997</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 280,455	\$ 167,706	\$ 167,706	\$ (164,300)	\$ 3,406
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,406</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 2,742	\$ 248	\$ 248	\$ -	\$ 248
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 248</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 12,517	\$ 1,278	\$ 1,278	\$ -	\$ 1,278
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,278</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,298,120	\$ 264,418	\$ 264,418	\$ (229,315)	\$ 35,103
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 35,103</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 158,556	\$ 158,556	\$ (148,161)	\$ 10,395
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 10,395</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 49
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						<u>\$ 77,081</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.