

Instrumentos financieros derivados

(Cifras en millones de pesos al 30 de junio de 2023)

Instrumento	Subyacente	Valor nominal	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Tasa	\$ 482	\$ 482	\$ 482	(7)	\$ 475
Futuros a recibir por cobertura	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 475
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ 5,181	\$ 5,181	\$ 5,181	(8)	\$ 5,173
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 5,173
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 238,722	\$ 159,065	\$ 159,065	(153,659)	\$ 5,406
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 5,406
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 2,392	\$ 175	\$ 175	-	\$ 175
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 175
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 12,011	\$ 932	\$ 932	-	\$ 932
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 932
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,250,383	\$ 246,696	\$ 246,696	(215,653)	\$ 31,043
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 31,043
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 244,610	\$ 150,321	\$ 150,321	(137,556)	\$ 12,765
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 12,765
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 175
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						\$ 56,144
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Tasa	\$ 482	\$ 482	\$ 482	(7)	\$ 475
Futuros a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 475
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 4,438	\$ 4,438	\$ 4,438	(8)	\$ 4,430
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 4,430
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,166	\$ 156,615	\$ 156,615	(153,659)	\$ 2,956
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 2,956
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 2,392	\$ 175	\$ 175	-	\$ 175
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 175
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 12,011	\$ 932	\$ 932	-	\$ 932
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 932
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,251,033	\$ 246,640	\$ 246,640	(215,653)	\$ 30,987
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						\$ 30,987
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 244,860	\$ 150,280	\$ 150,280	(137,556)	\$ 12,724
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						\$ 12,724
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 77
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						\$ 52,756

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.