

Instrumentos financieros derivados

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

Instrumento	Subyacente	Valor notional	Valuación	Saldo antes de compensar	Compensación	Valor de mercado
A recibir						
Futuros a recibir por negociación	Tasa	\$ 427	\$ 427	\$ 427	\$ -	\$ 427
Futuros a recibir por cobertura	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 427</u>
Futuros a recibir por negociación	Divisa	\$ -	\$ -	\$ -	\$ (427)	\$ (427)
Futuros a recibir por cobertura	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ (427)</u>
Contratos adelantados a recibir por negociación *	Divisa	\$ 202,749	\$ 136,502	\$ 136,502	\$ (132,899)	\$ 3,603
Contratos adelantados a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 3,603</u>
Opciones a recibir por negociación *	Tasa	\$ 3,036	\$ 159	\$ 159	\$ -	\$ 159
Opciones a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 159</u>
Opciones a recibir por negociación *	Divisa	\$ 14,651	\$ 1,708	\$ 1,708	\$ -	\$ 1,708
Opciones a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,708</u>
Swaps a recibir por negociación *	Tasa	\$ 1,218,269	\$ 249,936	\$ 249,936	\$ (204,202)	\$ 45,734
Swaps a recibir por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 45,734</u>
Swaps a recibir por negociación *	Divisa	\$ 165,323	\$ 167,382	\$ 167,382	\$ (154,757)	\$ 12,625
Swaps a recibir por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,625</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 193
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo deudor)						\$ 64,022
A entregar						
Futuros a entregar por negociación *	Tasa	\$ 427	\$ 439	\$ 439	\$ -	\$ 439
Futuros a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 439</u>
Futuros a entregar por negociación *	Divisa	\$ 1	\$ 1	\$ 1	\$ (427)	\$ (426)
Futuros a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ (426)</u>
Contratos adelantados a entregar por negociación *	Divisa	\$ 209,150	\$ 135,126	\$ 135,126	\$ (132,899)	\$ 2,227
Contratos adelantados a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 2,227</u>
Opciones a entregar por negociación *	Tasa	\$ 3,036	\$ 159	\$ 159	\$ -	\$ 159
Opciones a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 159</u>
Opciones a entregar por negociación *	Divisa	\$ 14,651	\$ 1,708	\$ 1,708	\$ -	\$ 1,708
Opciones a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 1,708</u>
Swaps a entregar por negociación *	Tasa	\$ 1,218,619	\$ 249,684	\$ 249,684	\$ (204,202)	\$ 45,482
Swaps a entregar por cobertura *	Tasa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 45,482</u>
Swaps a entregar por negociación *	Divisa	\$ 166,177	\$ 167,345	\$ 167,345	\$ (154,758)	\$ 12,587
Swaps a entregar por cobertura *	Divisa	-	-	-	-	-
						<u>\$ 12,587</u>
Ajuste por riesgo de crédito						\$ 66
Operaciones con instrumentos financieros derivados (saldo acreedor)						\$ 62,242

Los valores notacionales 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.