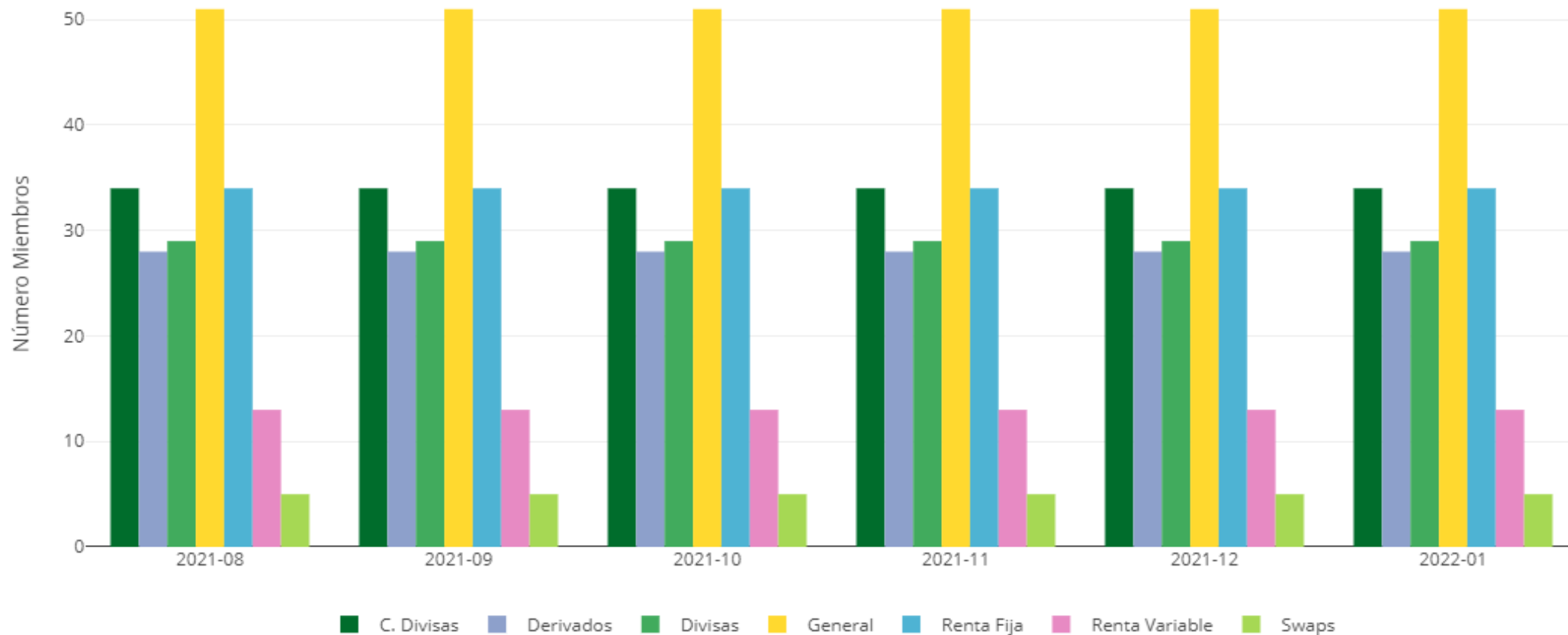


Evolución de Mercado

Enero 2022

- Miembros Operando



- Volumen Operado

Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$17,354,072	\$14,558,891	\$291,177,828	\$13,979,758	\$1,733,489,995
Renta Fija	TES	Simultaneas	53.82%	\$9,339,700	\$5,142,878	\$102,857,562	\$5,263,852	\$652,717,599
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	26.76%	\$4,644,733	\$5,331,689	\$106,633,780	\$5,109,407	\$633,566,466
Derivados	TRM	NDF FX FWD	11.27%	\$1,955,566	\$2,133,366	\$42,667,320	\$1,877,775	\$232,844,107
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	3.97%	\$689,433	\$790,714	\$15,814,286	\$796,364	\$98,749,106
Derivados	OIS	OIS IBR	1.86%	\$322,348	\$550,613	\$11,012,259	\$263,942	\$32,728,786
Derivados	TRM	F. TRM	0.98%	\$170,329	\$231,636	\$4,632,711	\$264,725	\$32,825,846
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.53%	\$92,844	\$92,781	\$1,855,612	\$92,566	\$11,478,196
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.44%	\$76,542	\$167,858	\$3,357,160	\$111,981	\$13,885,677

- Volumen Operado

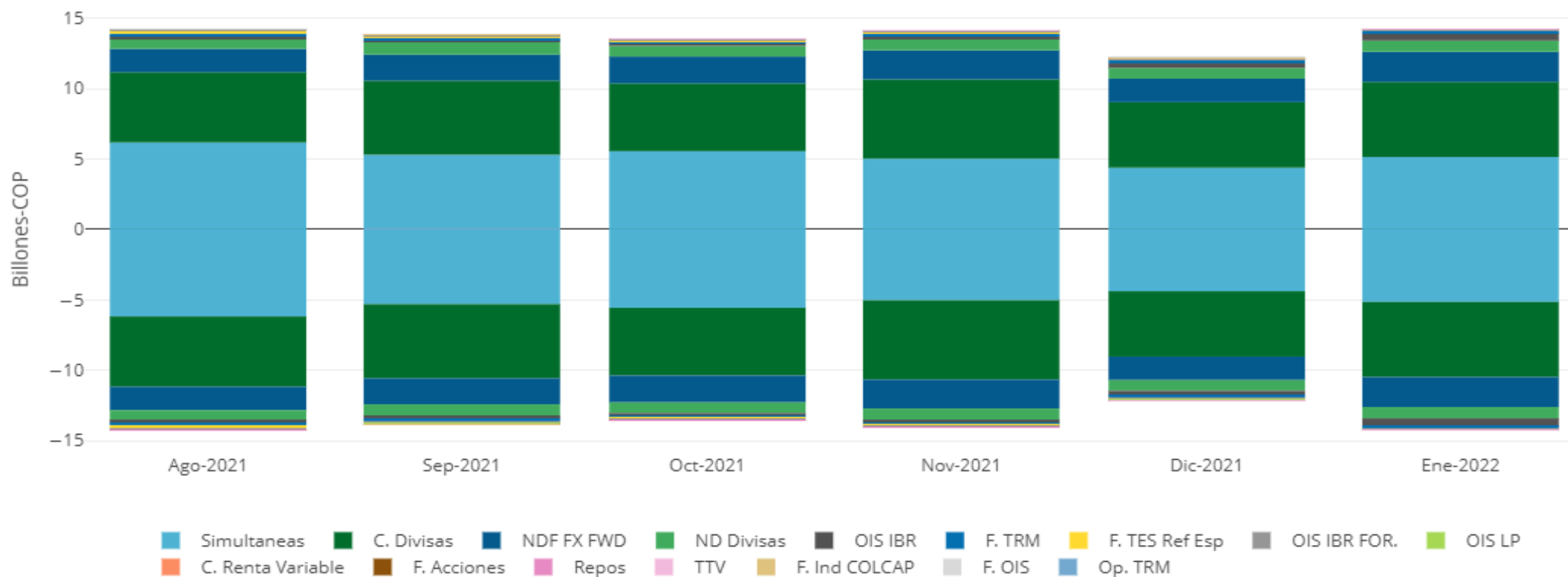
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.31%	\$54,250	\$51,958	\$1,039,157	\$141,119	\$17,498,768
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$3,405	\$14,833	\$296,670	\$13,857	\$1,718,273
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.02%	\$3,198	\$3,808	\$76,169	\$6,412	\$795,143
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.01%	\$1,132	\$1,377	\$27,547	\$2,023	\$250,877
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$338	\$994	\$19,871	\$1,060	\$131,442
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$158	\$7,920	\$158,403	\$6,412	\$795,026
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$97	\$655	\$13,096	\$913	\$113,228
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$89	\$1,777	\$24	\$3,029
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$488	\$60,492

- Volumen Operado

Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$2,172	\$43,449	\$1,588	\$196,864
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$5	\$569
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$33,550	\$671,000	\$25,246	\$3,130,500

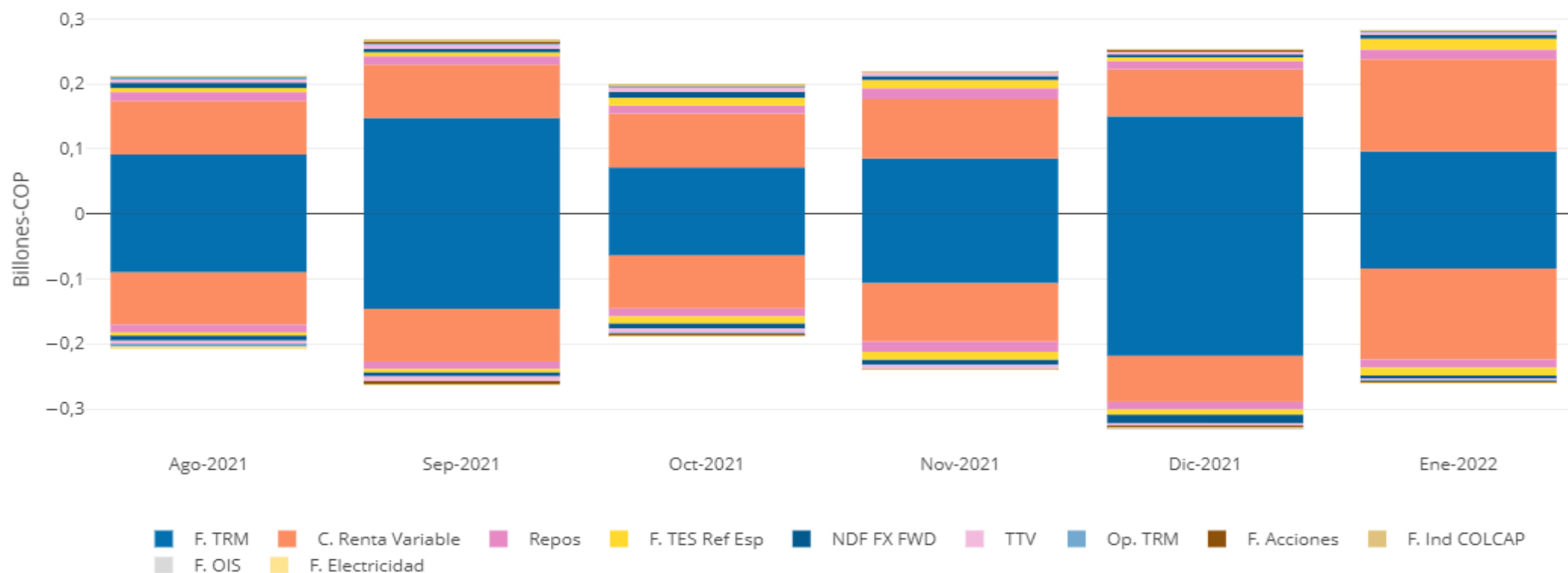
- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

Posición Propia ▼

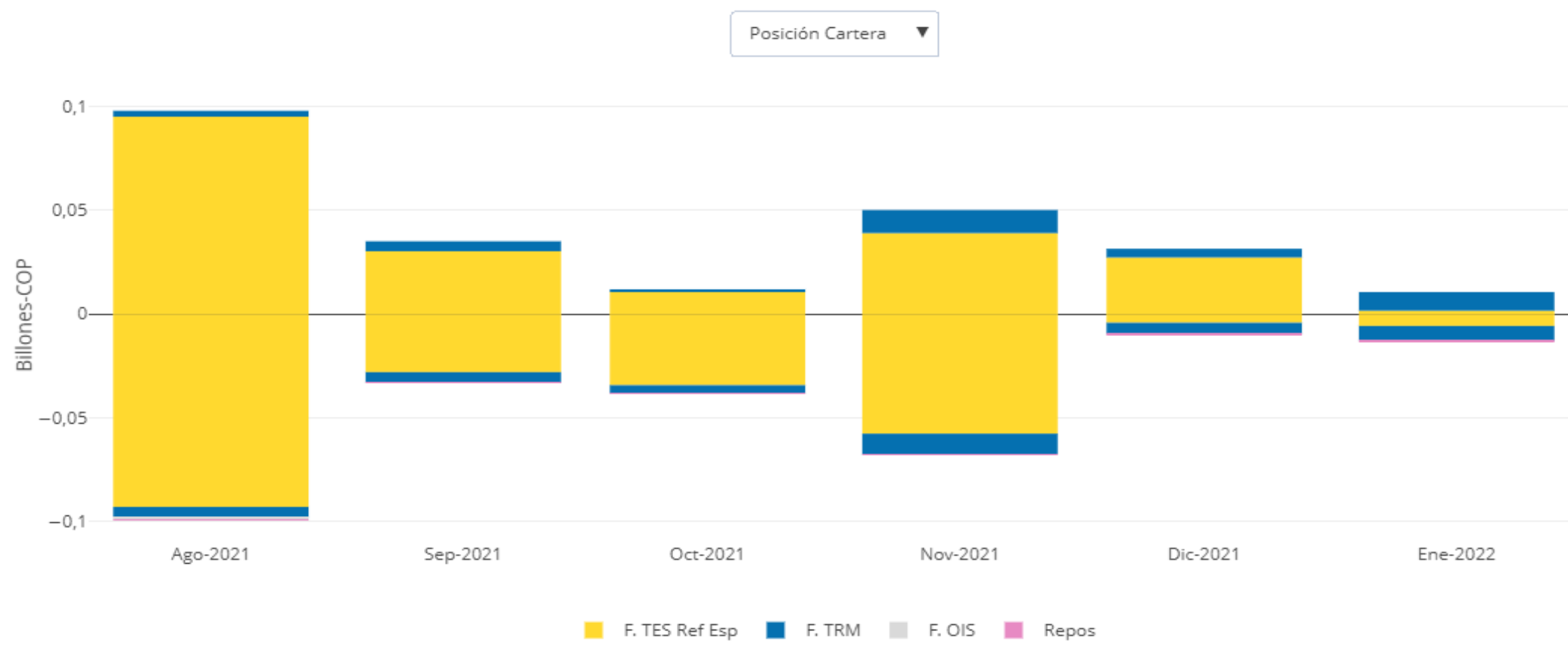


- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

Posición Terceros ▼



- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta







- Posición Abierta

Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$99,301,950	\$99,301,950	\$97,395,416	\$97,395,404	\$83,668,216	\$83,668,213
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$40,388,980	\$40,388,980	\$41,504,584	\$41,504,584	\$37,227,214	\$37,227,214
Derivados	OIS	OIS IBR	\$27,851,564	\$27,851,564	\$26,857,488	\$26,857,488	\$17,879,704	\$17,879,704
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$11,041,770	\$11,041,770	\$8,987,795	\$8,987,795	\$9,889,695	\$9,889,695
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$7,212,500	\$7,212,500	\$7,042,100	\$7,042,100	\$5,933,895	\$5,933,895
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	\$4,778,015	\$4,778,015	\$4,700,852	\$4,700,852	\$4,743,565	\$4,743,565
Derivados	TRM	F. TRM	\$3,948,600	\$3,948,600	\$4,062,509	\$4,062,509	\$2,834,666	\$2,834,666
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	\$1,705,327	\$1,705,327	\$1,603,889	\$1,603,889	\$2,245,399	\$2,245,399
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,041,852	\$1,041,852	\$1,132,898	\$1,132,898	\$1,309,783	\$1,309,783

- Posición Abierta

Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	\$604,809	\$604,809	\$645,714	\$645,714	\$690,444	\$690,444
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$442,614	\$442,614	\$457,840	\$457,840	\$504,736	\$504,736
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$169,150	\$169,150	\$281,266	\$281,254	\$188,075	\$188,073
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$45,397	\$45,397	\$33,081	\$33,081	\$121,296	\$121,296
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$32,616	\$32,616	\$32,629	\$32,629	\$32,632	\$32,632
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$18,211	\$18,211	\$20,136	\$20,136	\$22,142	\$22,142
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$13,098	\$13,098	\$15,512	\$15,512	\$18,409	\$18,409
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$3,746	\$3,746	\$6,692	\$6,692	\$17,773	\$17,773
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$3,544	\$3,544	\$2,509	\$2,509	\$2,490	\$2,490

- Posición Abierta

Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$158	\$158	\$7,920	\$7,920	\$6,293	\$6,293
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	\$0	\$0	\$0	\$0	\$5	\$5

- Posición Abierta Promedio Diario Por Mes y Tipo de Cuenta



- Posición Abierta Swaps Por Rango de Años

Rango Años	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0Y-1Y	\$1,310,000	\$1,238,350	\$983,145
1Y-2Y	\$2,158,500	\$2,162,275	\$1,754,710
2Y-5Y	\$2,860,500	\$2,762,125	\$2,429,065
5Y-10Y	\$883,500	\$879,350	\$766,976
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte