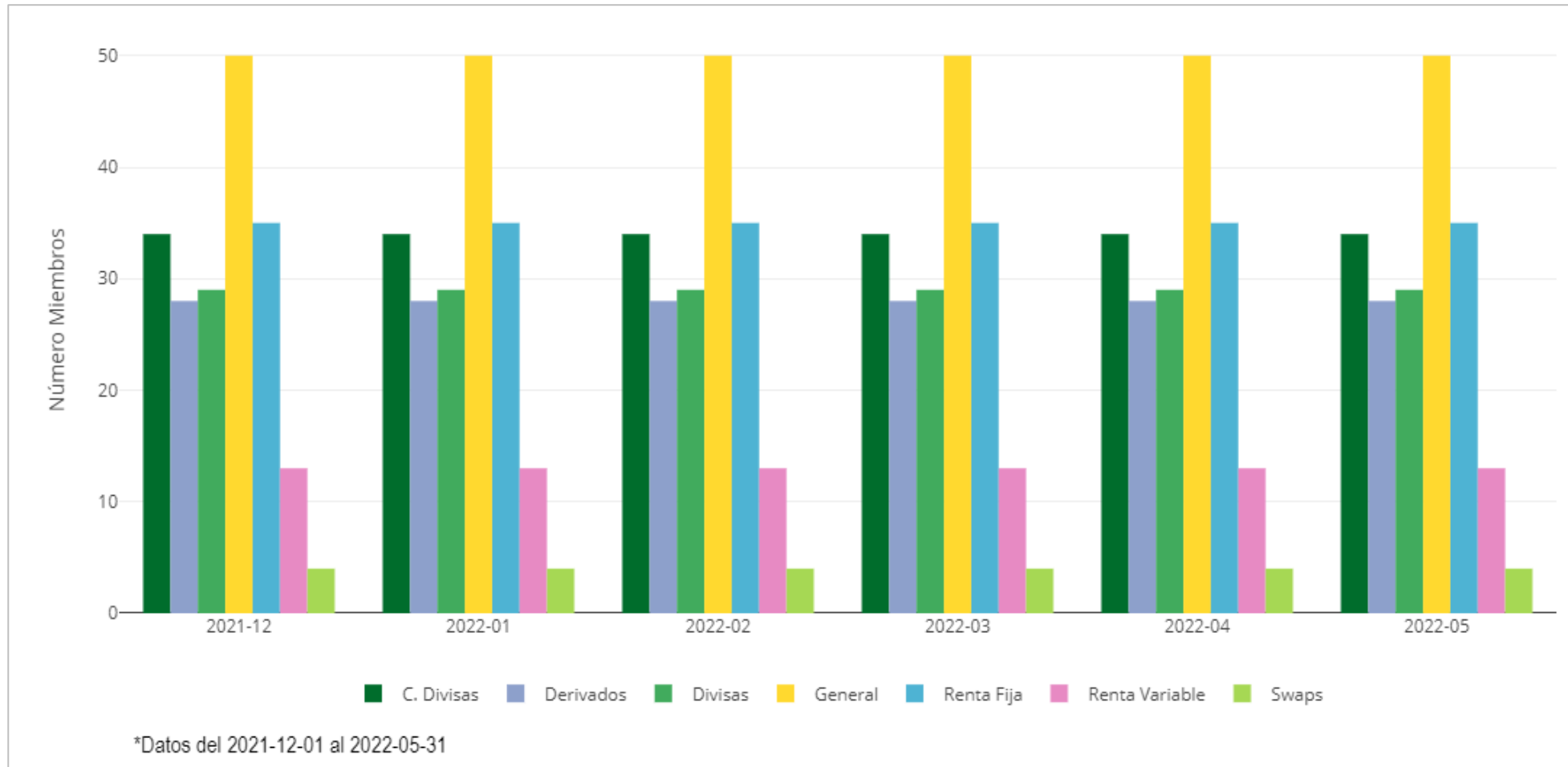


Evolución de Mercado

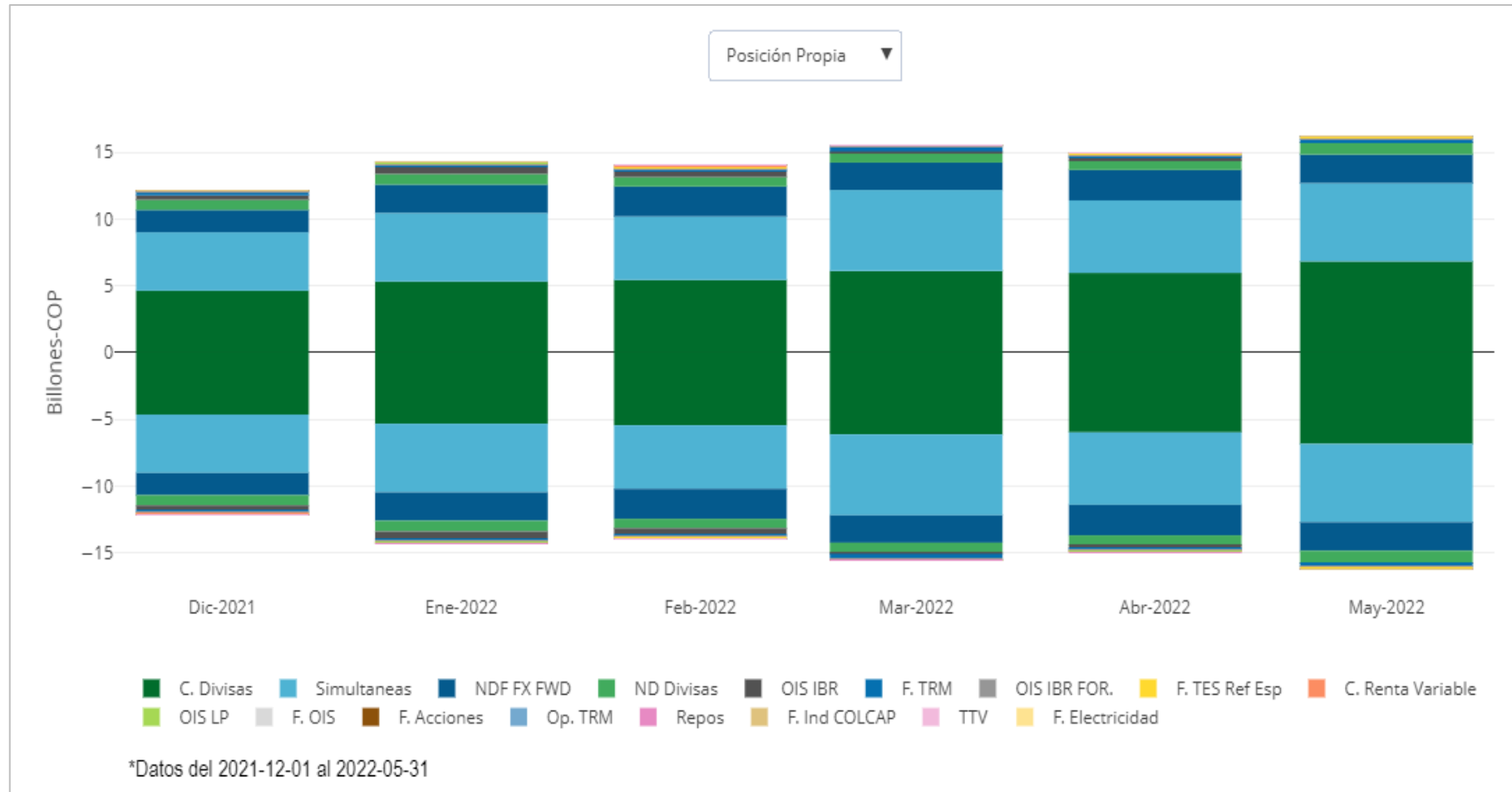
Mayo 2022

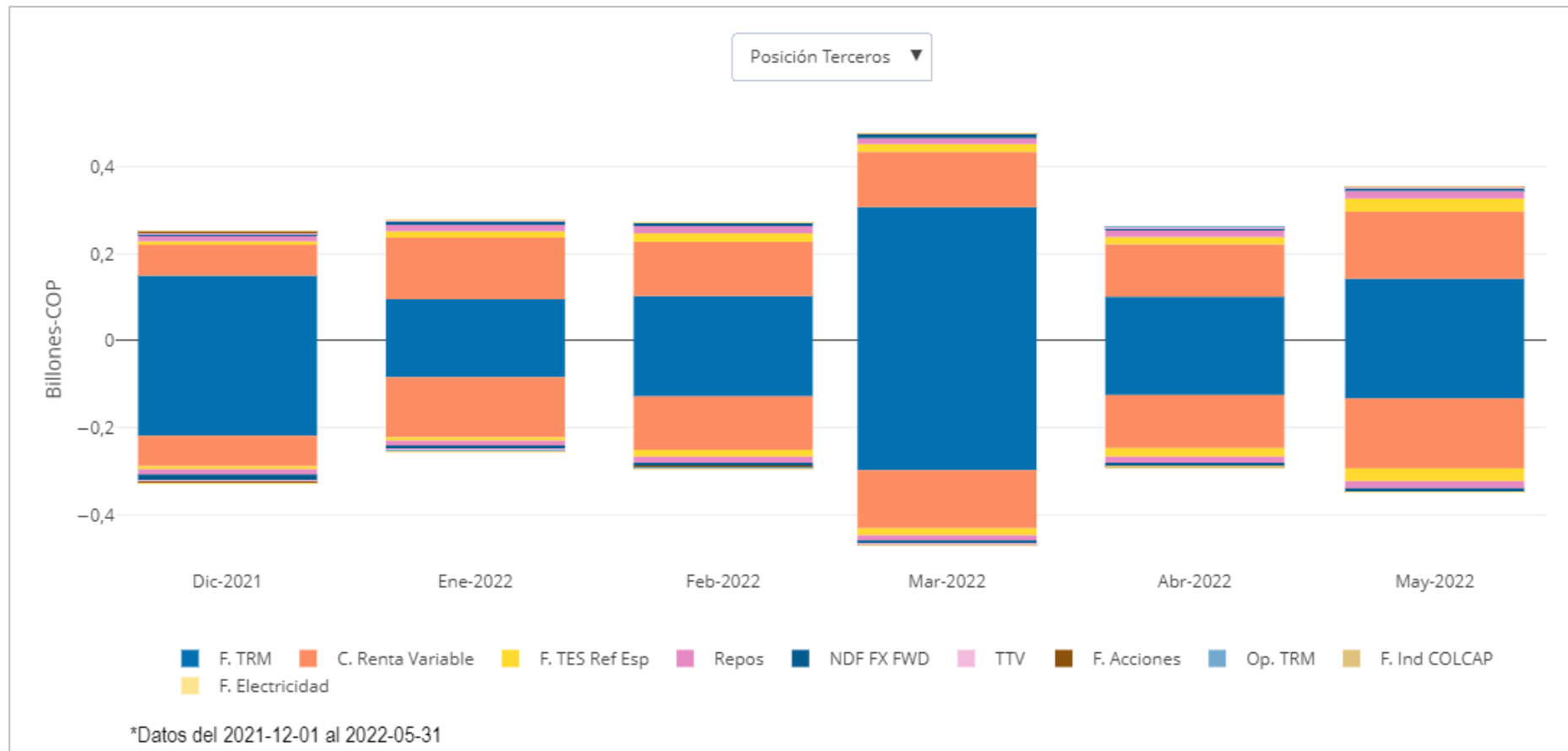


Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$20,202,010	\$16,738,803	\$351,514,872	\$14,926,223	\$1,835,925,453
Renta Fija	TES	Simultaneas	37.31%	\$7,538,245	\$5,868,718	\$123,243,085	\$5,286,816	\$650,278,374
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	34.68%	\$7,005,822	\$6,842,718	\$143,697,087	\$5,732,238	\$705,065,276
Derivados	TRM	NDF FX FWD	11.67%	\$2,357,654	\$2,145,142	\$45,047,979	\$2,086,500	\$256,639,518
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	6.84%	\$1,382,092	\$173,983	\$3,653,642	\$147,990	\$18,202,729
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.84%	\$978,646	\$870,510	\$18,280,703	\$766,328	\$94,258,354
Derivados	TRM	F. TRM	1.93%	\$389,571	\$344,173	\$7,227,630	\$368,438	\$45,317,837
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	1.43%	\$287,986	\$23,464	\$492,754	\$12,612	\$1,551,236
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.70%	\$142,347	\$267,542	\$5,618,392	\$124,907	\$15,363,576

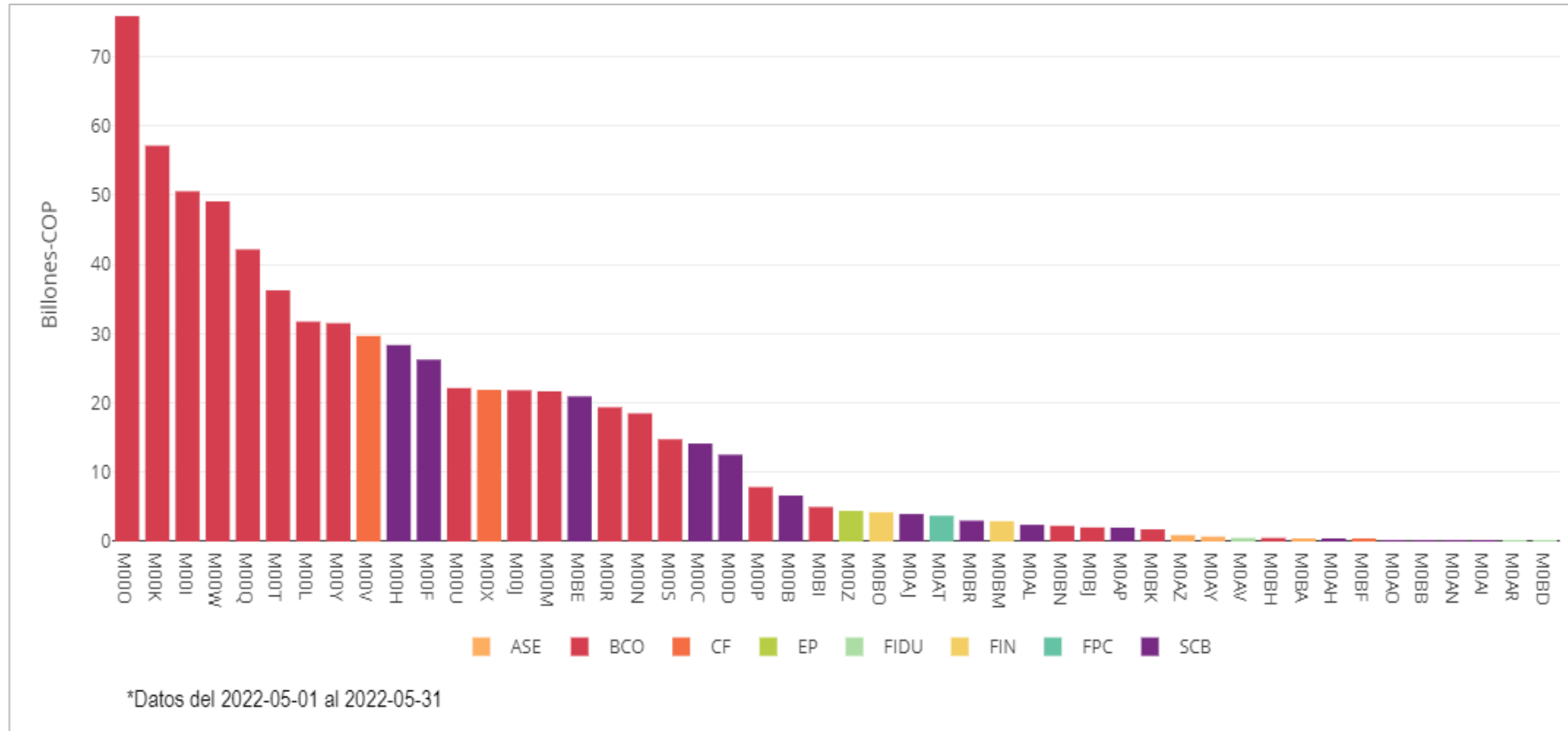
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.46%	\$93,382	\$93,347	\$1,960,279	\$93,031	\$11,442,777
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.10%	\$19,999	\$17,926	\$376,443	\$15,523	\$1,909,314
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$2,559	\$1,102	\$23,141	\$2,744	\$337,567
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.01%	\$2,373	\$430	\$9,028	\$1,421	\$174,732
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$838	\$653	\$13,704	\$865	\$106,431
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$497	\$289	\$6,068	\$949	\$116,788
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$17	\$361	\$28	\$3,401
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$4,858	\$102,027	\$1,712	\$210,617
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$61,577	\$1,293,121	\$268,255	\$32,995,362

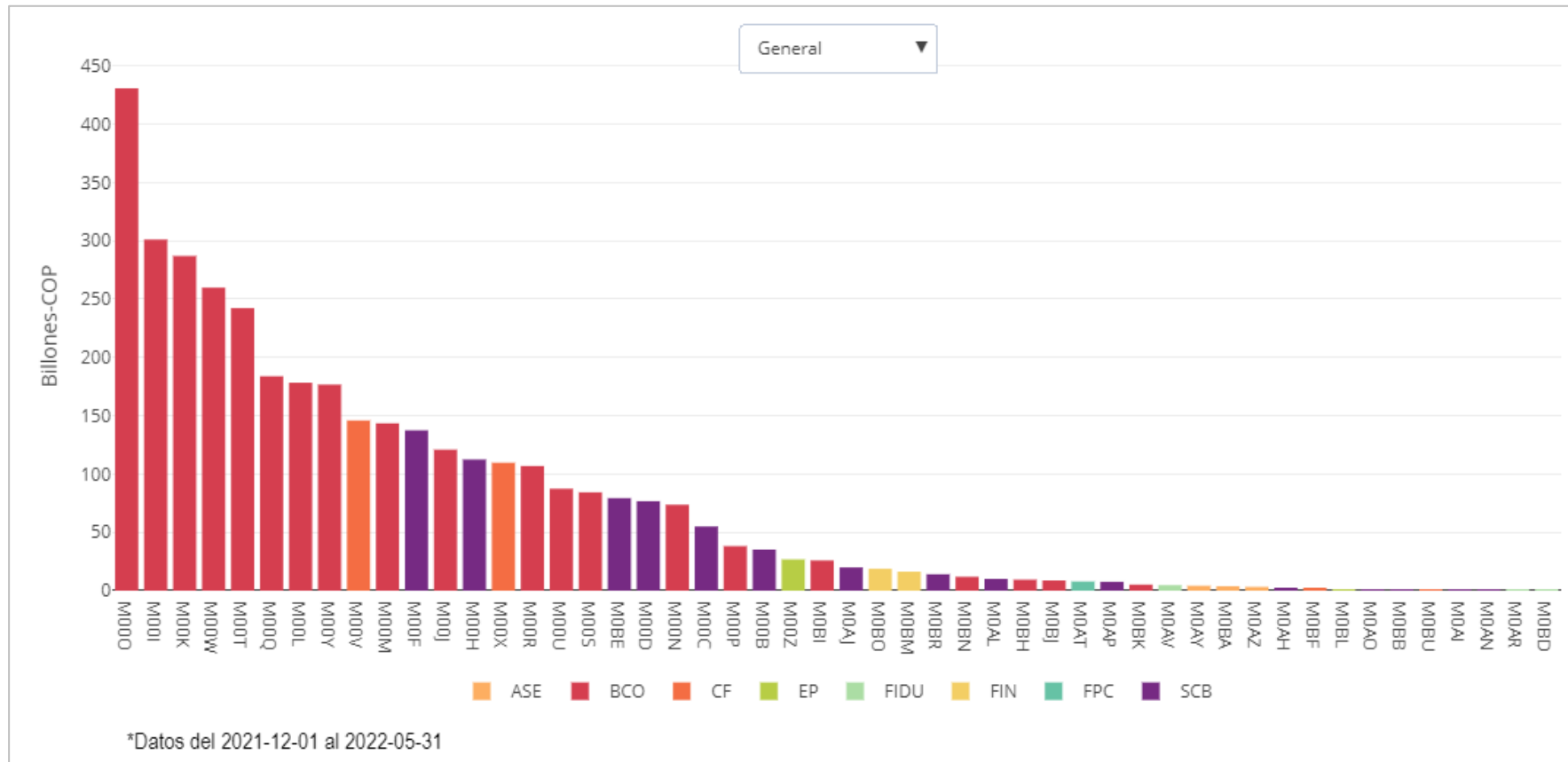
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M- COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$2,496	\$52,426	\$1,504	\$184,948
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$139	\$17,116
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$19,857	\$417,000	\$14,224	\$1,749,500











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	\$92,894,508	\$92,894,508	\$91,559,648	\$91,559,648	\$95,962,599	\$95,962,597
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$42,946,755	\$42,946,755	\$44,576,856	\$44,576,856	\$42,464,177	\$42,464,177
Derivados	OIS	OIS IBR	\$14,495,860	\$14,495,860	\$15,785,463	\$15,785,463	\$23,648,955	\$23,648,955
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$12,850,710	\$12,850,710	\$9,709,757	\$9,709,757	\$9,480,302	\$9,480,302
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$7,386,000	\$7,386,000	\$7,293,000	\$7,293,000	\$6,730,268	\$6,730,268
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	\$4,828,978	\$4,828,978	\$4,729,330	\$4,729,330	\$4,734,960	\$4,734,960
Derivados	TRM	F. TRM	\$4,312,030	\$4,312,030	\$4,778,159	\$4,778,159	\$4,445,265	\$4,445,265
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	\$2,510,528	\$2,510,528	\$2,438,464	\$2,438,464	\$2,033,714	\$2,033,714
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$1,339,807	\$1,339,807	\$245,468	\$245,468	\$241,913	\$241,911

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	\$756,266	\$756,266	\$782,514	\$782,514	\$665,360	\$665,360
Derivados	OIS	F. OIS	\$694,914	\$694,914	\$688,988	\$688,988	\$921,482	\$921,482
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$478,857	\$478,857	\$462,754	\$462,754	\$500,379	\$500,379
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$203,285	\$203,285	\$18,409	\$18,409	\$11,644	\$11,644
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$60,203	\$60,203	\$20,563	\$20,563	\$27,841	\$27,841
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$11,208	\$11,208	\$10,656	\$10,656	\$22,905	\$22,905
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$11,094	\$11,094	\$11,172	\$11,172	\$14,557	\$14,557
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$3,511	\$3,511	\$2,060	\$2,060	\$6,497	\$6,497
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,629	\$2,629	\$2,552	\$2,552	\$2,710	\$2,710

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
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$1,875	\$1,875	\$3,483	\$3,483	\$9,530	\$9,530
Dívisas	ND Dívisas	Dívisas T3	\$0	\$0	\$0	\$0	\$139	\$139



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	\$1,147,500	\$1,083,548	\$856,098
1Y-2Y	\$2,419,000	\$2,369,952	\$2,181,886
2Y-5Y	\$2,815,500	\$2,870,405	\$2,801,980
5Y-10Y	\$1,004,000	\$969,095	\$890,305
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0
*Datos del 2021-12-01 al 2022-05-31			



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte