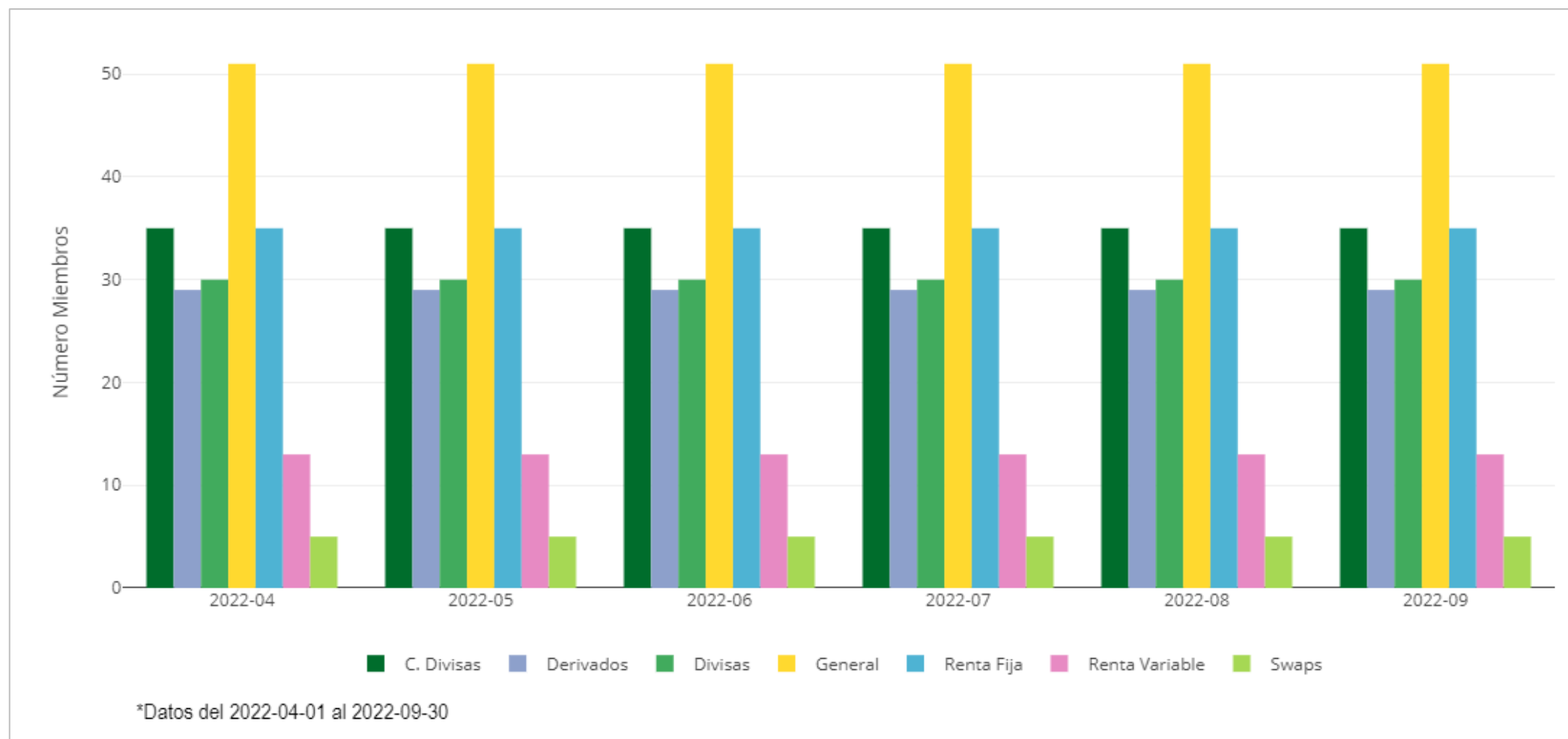


# Evolución de Mercado

---

Septiembre 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% | \$25,228,109               | \$14,829,668                               | \$326,252,702                        | \$15,768,610                            | \$1,939,539,018                   |
| Renta Fija  | TES             | Simultaneas    | 44.82%  | \$11,306,737               | \$5,451,211                                | \$119,926,638                        | \$5,729,169                             | \$704,687,760                     |
| C. Divisas  | C. Divisas      | C. Divisas     | 30.08%  | \$7,589,738                | \$5,353,296                                | \$117,772,520                        | \$5,907,690                             | \$726,645,900                     |
| Derivados   | TRM             | NDF FX FWD     | 17.50%  | \$4,414,730                | \$2,320,184                                | \$51,044,057                         | \$2,315,280                             | \$284,779,494                     |
| Divisas     | ND Divisas      | Divisas T1     | 3.85%   | \$971,947                  | \$727,931                                  | \$16,014,481                         | \$758,014                               | \$93,235,709                      |
| Derivados   | TRM             | F. TRM         | 1.27%   | \$321,194                  | \$393,943                                  | \$8,666,737                          | \$498,412                               | \$61,304,649                      |
| Derivados   | F. TES          | F. TES Ref Esp | 0.78%   | \$197,804                  | \$31,706                                   | \$697,538                            | \$119,384                               | \$14,684,282                      |
| Renta Fija  | TES             | TTV DP         | 0.67%   | \$169,368                  | \$262,237                                  | \$5,769,218                          | \$93,730                                | \$11,528,803                      |
| Derivados   | OIS             | OIS IBR        | 0.43%   | \$109,605                  | \$73,480                                   | \$1,616,554                          | \$90,283                                | \$11,104,771                      |

Registros del 1 al 9 de un total de 22

Anterior 1 2 3 Siguiete

\*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30

| 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.      | 0.40% | \$100,712                | \$100,694                                | \$2,215,279                        | \$97,673                              | \$12,013,798                    |   |           |
| C. Renta Variable                        | C. Renta Variable | C. Renta Variable | 0.14% | \$34,286                 | \$53,726                                 | \$1,181,981                        | \$105,641                             | \$12,993,795                    |   |           |
| Renta Variable                           | Repos y TTV       | Repos             | 0.03% | \$7,970                  | \$12,173                                 | \$267,810                          | \$15,325                              | \$1,885,009                     |   |           |
| Derivados                                | TRM               | Opcion TRM        | 0.01% | \$1,862                  | \$210                                    | \$4,621                            | \$1,336                               | \$164,364                       |   |           |
| Divisas                                  | ND Divisas        | Divisas T2        | 0.01% | \$1,615                  | \$37,078                                 | \$815,711                          | \$16,033                              | \$1,972,060                     |   |           |
| Derivados                                | F. Renta Variable | F. acc liq ent    | 0.00% | \$542                    | \$743                                    | \$16,336                           | \$793                                 | \$97,565                        |   |           |
| Derivados                                | F. Renta Variable | F. acc liq dif    | 0.00% | \$0                      | \$649                                    | \$14,280                           | \$409                                 | \$50,352                        |   |           |
| Derivados                                | F. Electricidad   | F. Electricidad   | 0.00% | \$0                      | \$81                                     | \$1,774                            | \$30                                  | \$3,631                         |   |           |
| Derivados                                | F. Renta Variable | F. ind COLCAP     | 0.00% | \$0                      | \$127                                    | \$2,798                            | \$233                                 | \$28,673                        |   |           |
| Registros del 10 al 18 de un total de 22 |                   |                   |       |                          |                                          | Anterior                           | 1                                     | 2                               | 3 | Siguiente |
| *Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30      |                   |                   |       |                          |                                          |                                    |                                       |                                 |   |           |

| 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             | F. OIS     | 0.00% | \$0                        | \$1,374                                    | \$30,232                             | \$1,608                                 | \$197,747                         |
| Divisas        | ND Divisas      | Divisas T3 | 0.00% | \$0                        | \$0                                        | \$0                                  | \$2                                     | \$268                             |
| Renta Variable | Repos y TTV     | TTV        | 0.00% | \$0                        | \$688                                      | \$15,136                             | \$1,060                                 | \$130,387                         |
| Swaps          | OIS LP          | OIS LP     | 0.00% | \$0                        | \$8,136                                    | \$179,000                            | \$16,504                                | \$2,030,000                       |

Registros del 19 al 22 de un total de 22

Anterior

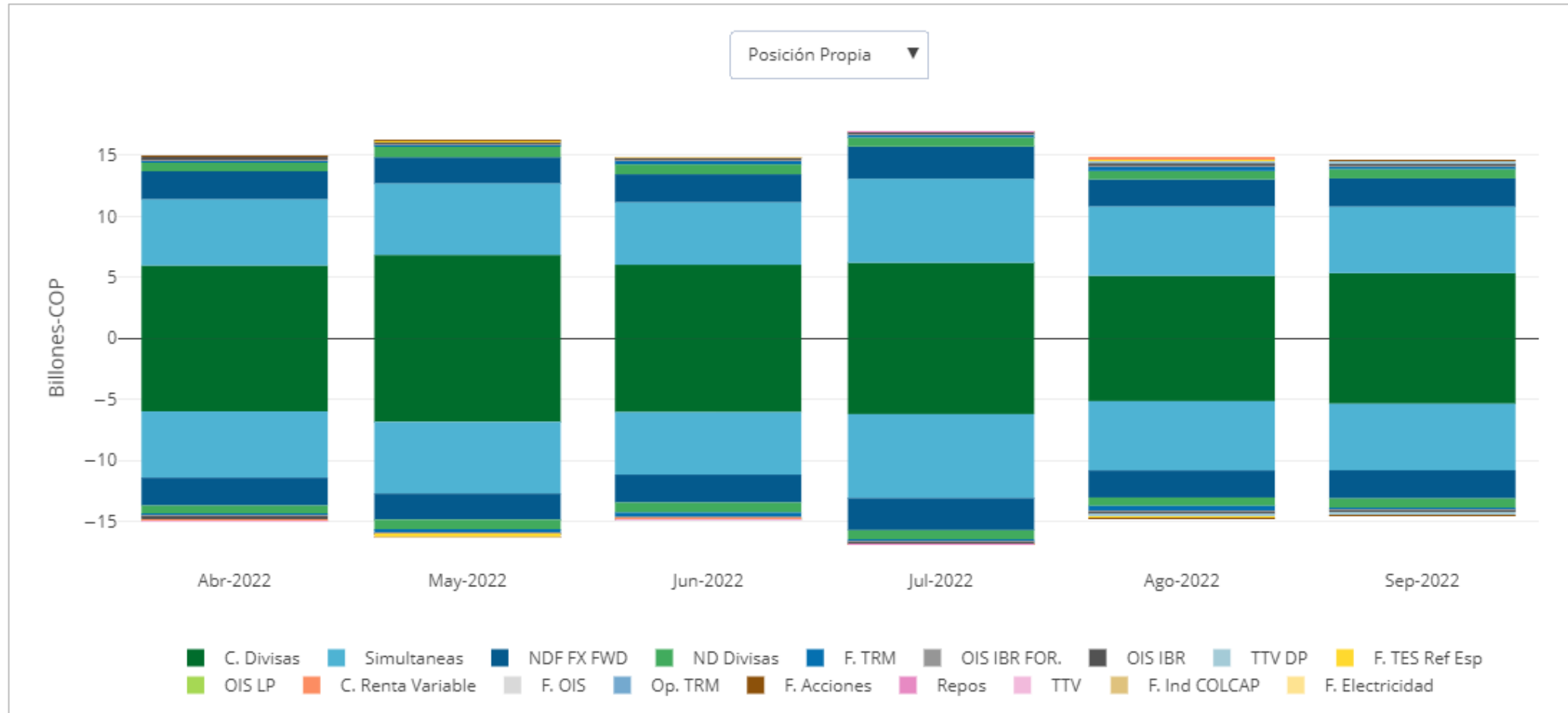
1

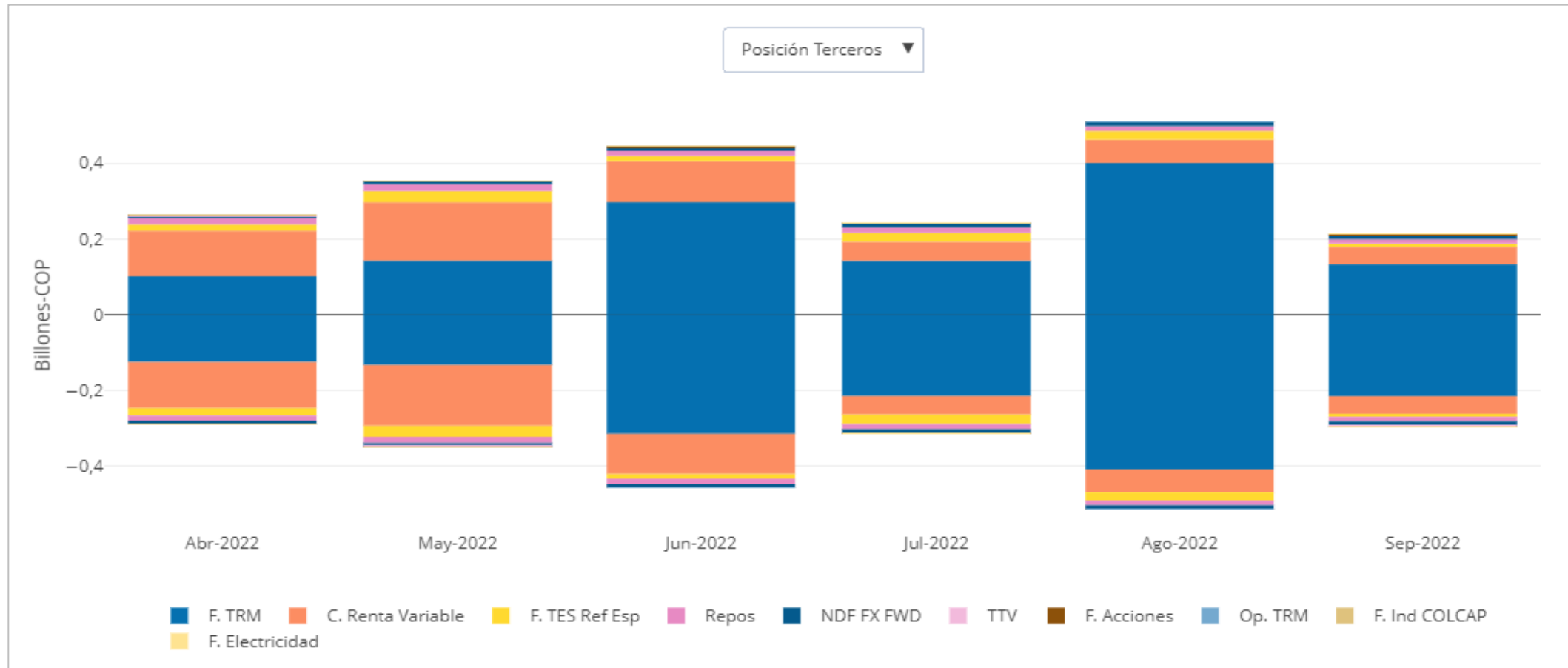
2

3

Siguiente

\*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30











| Segmento ▾  | Tipo Producto ▾ | Producto ▾     | % ▾     | Posición Abierta Último Día M-COP ▾ | Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP ▾ | Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP ▾ |
|-------------|-----------------|----------------|---------|-------------------------------------|-----------------------------------------------------|--------------------------------------------------|
| Consolidado | Consolidado     | Consolidado    | 100.00% | \$100,477,841                       | \$94,752,356                                        | \$93,775,492                                     |
| Derivados   | TRM             | NDF FX FWD     | 51.34%  | \$51,581,490                        | \$50,077,708                                        | \$47,821,802                                     |
| Renta Fija  | TES             | Simultaneas    | 11.76%  | \$11,821,043                        | \$8,079,361                                         | \$9,174,673                                      |
| Derivados   | OIS             | OIS IBR        | 11.04%  | \$11,089,713                        | \$11,173,091                                        | \$14,643,234                                     |
| Derivados   | TRM             | F. TRM         | 8.61%   | \$8,650,490                         | \$8,328,593                                         | \$5,880,911                                      |
| Swaps       | OIS LP          | OIS LP         | 8.22%   | \$8,254,500                         | \$8,141,045                                         | \$7,221,561                                      |
| Derivados   | OIS             | OIS IBR FOR.   | 5.35%   | \$5,378,004                         | \$5,288,704                                         | \$4,901,525                                      |
| Derivados   | F. TES          | F. TES Ref Esp | 1.86%   | \$1,863,967                         | \$1,887,751                                         | \$2,116,397                                      |
| Divisas     | ND Divisas      | Divisas T1     | 0.86%   | \$860,057                           | \$615,441                                           | \$661,522                                        |

Registros del 1 al 9 de un total de 21

Anterior

1

2

3

Siguiente

\*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30

| Segmento          | Tipo Producto     | Producto          | %     | Posición Abierta Último Día M-COP | Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP | Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP |
|-------------------|-------------------|-------------------|-------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| Renta Variable    | Repos y TTV       | Repos             | 0.40% | \$405,890                         | \$420,928                                         | \$454,682                                      |
| Derivados         | OIS               | F. OIS            | 0.32% | \$321,903                         | \$312,021                                         | \$563,563                                      |
| Renta Fija        | TES               | TTV DP            | 0.17% | \$169,368                         | \$262,237                                         | \$93,730                                       |
| C. Renta Variable | C. Renta Variable | C. Renta Variable | 0.06% | \$56,024                          | \$98,252                                          | \$179,891                                      |
| Derivados         | F. Renta Variable | F. acc liq dif    | 0.01% | \$6,539                           | \$7,678                                           | \$9,650                                        |
| Derivados         | F. Electricidad   | F. Electricidad   | 0.01% | \$5,530                           | \$4,823                                           | \$3,267                                        |
| Derivados         | F. Renta Variable | F. acc liq ent    | 0.01% | \$5,250                           | \$9,567                                           | \$12,178                                       |
| Renta Variable    | Repos y TTV       | TTV               | 0.00% | \$4,203                           | \$1,675                                           | \$2,198                                        |
| Divisas           | ND Divisas        | Divisas T2        | 0.00% | \$1,615                           | \$36,445                                          | \$14,555                                       |

Registros del 10 al 18 de un total de 21

\*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30

Anterior 1 2 3 Siguiente

| Segmento ▾ | Tipo Producto ▾   | Producto ▾    | % ▾   | Posición Abierta<br>Último Día M-COP ▾ | Posición Abierta Promedio<br>Diario Último Mes M-COP ▾ | Posición Abierta Promedio<br>Diario Periodo M-COP ▾ |
|------------|-------------------|---------------|-------|----------------------------------------|--------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|
| Derivados  | TRM               | Opcion TRM    | 0.00% | \$1,396                                | \$5,932                                                | \$17,799                                            |
| Derivados  | F. Renta Variable | F. ind COLCAP | 0.00% | \$857                                  | \$1,103                                                | \$2,351                                             |
| Divisas    | ND Divisas        | Divisas T3    | 0.00% | \$0                                    | \$0                                                    | \$2                                                 |

Registros del 19 al 21 de un total de 21

Anterior

1

2

3

Siguiente

\*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30

| 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                               | \$1,504,000                       | \$1,361,205                                       | \$1,013,317                                    |
| 1Y-2Y                               | \$2,623,500                       | \$2,634,614                                       | \$2,286,776                                    |
| 2Y-5Y                               | \$3,203,000                       | \$3,128,591                                       | \$2,936,760                                    |
| 5Y-10Y                              | \$1,079,000                       | \$1,067,955                                       | \$975,846                                      |
| 10Y-15Y                             | \$0                               | \$0                                               | \$0                                            |
| *Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31 |                                   |                                                   |                                                |



# crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte