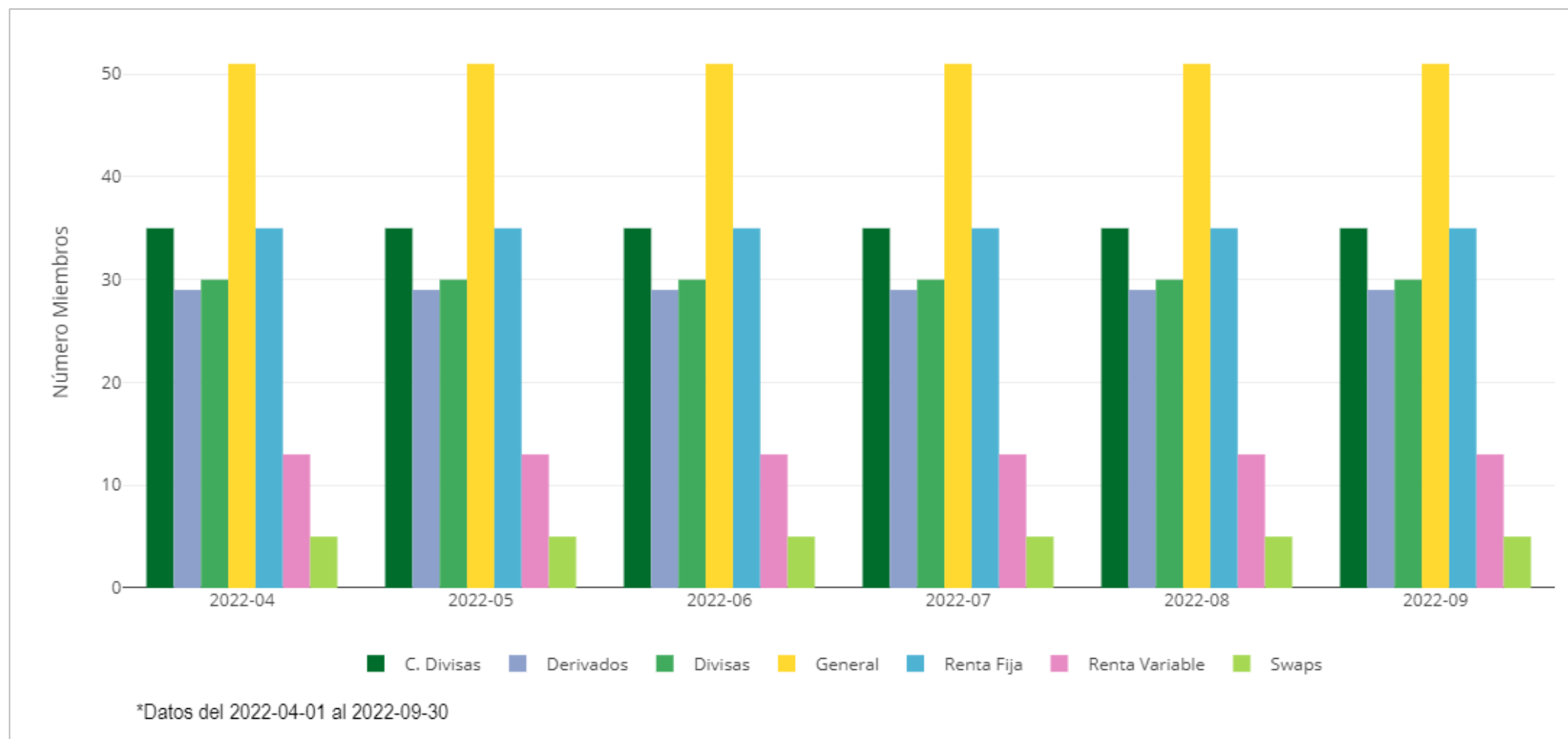


Evolución de Mercado

Agosto 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

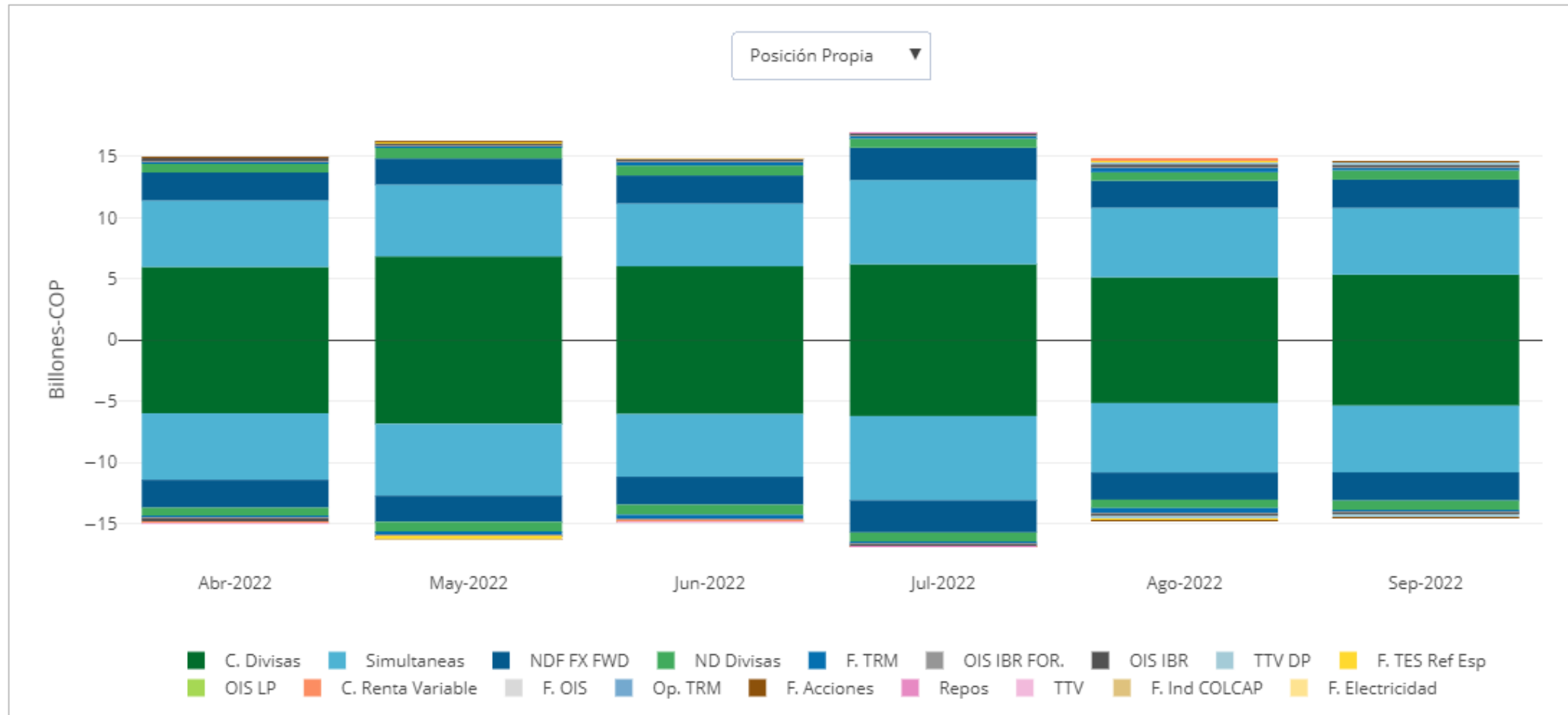
1

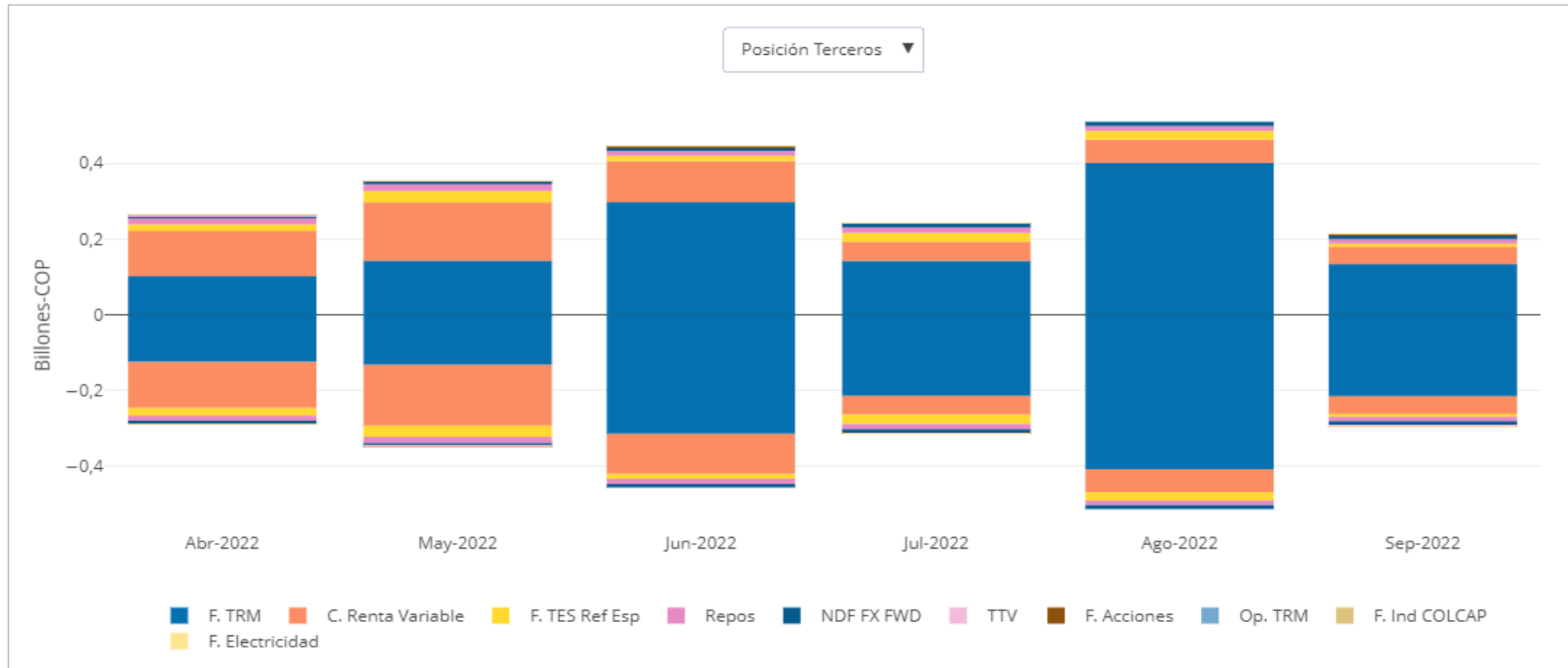
2

3

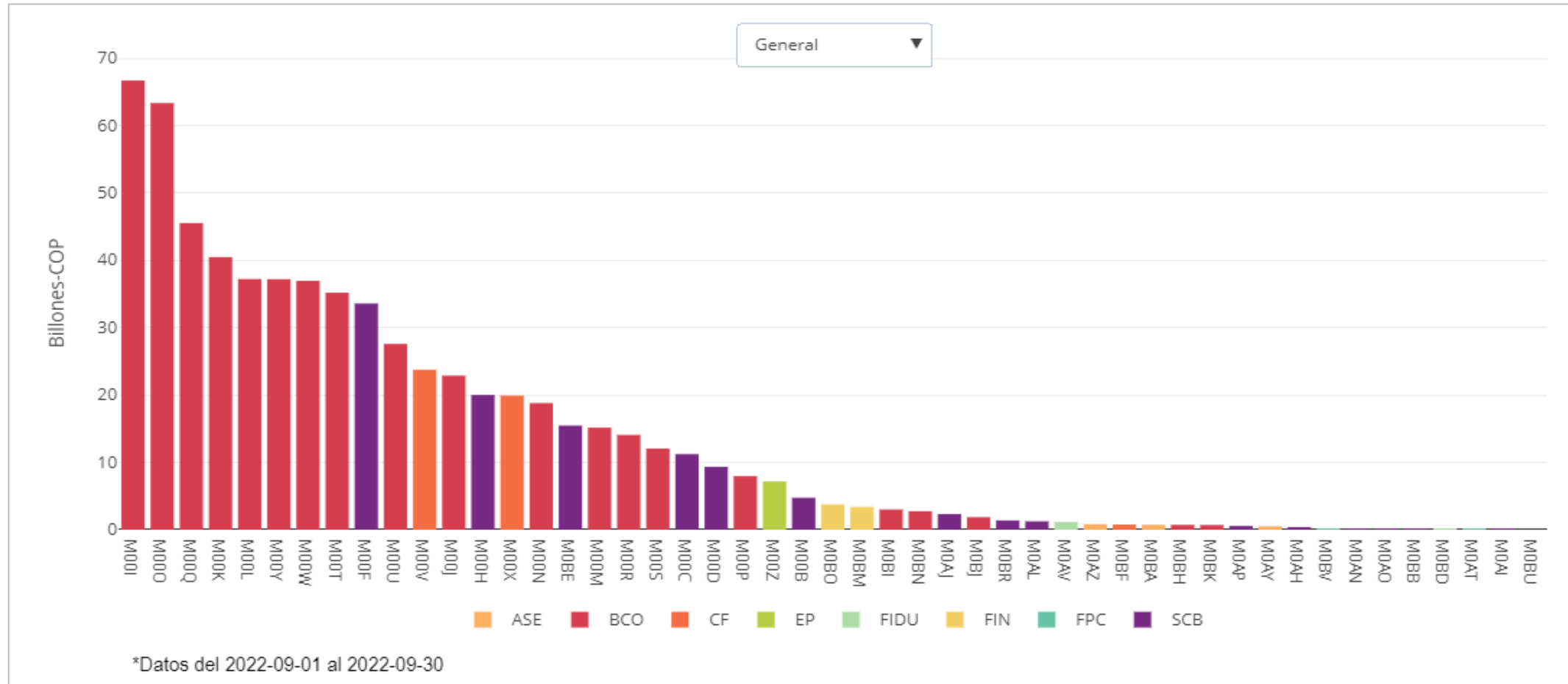
Siguiente

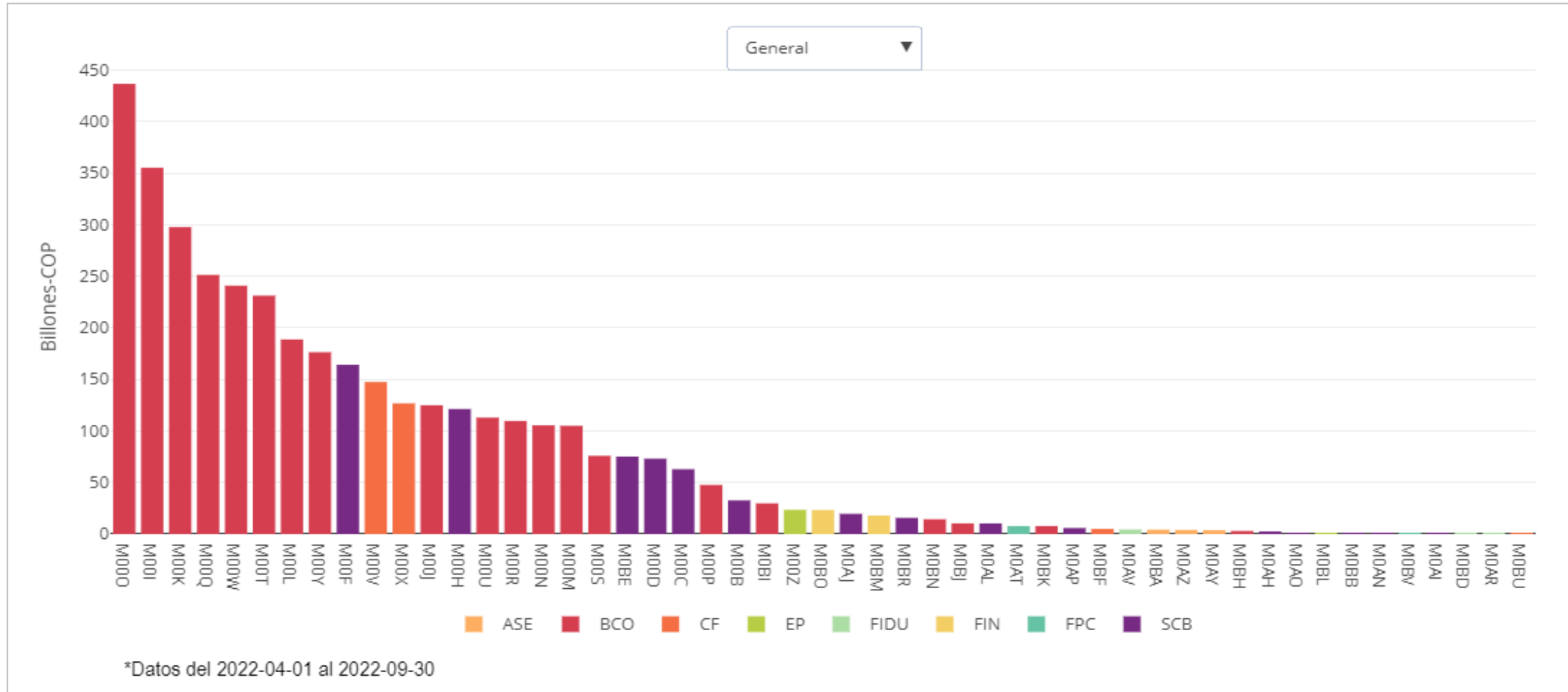
*Datos del 2022-04-01 al 2022-09-30











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 Último Día M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP ▾	Posición Abierta Promedio 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			



cra

Cámara de Riesgo Central de Contraparte