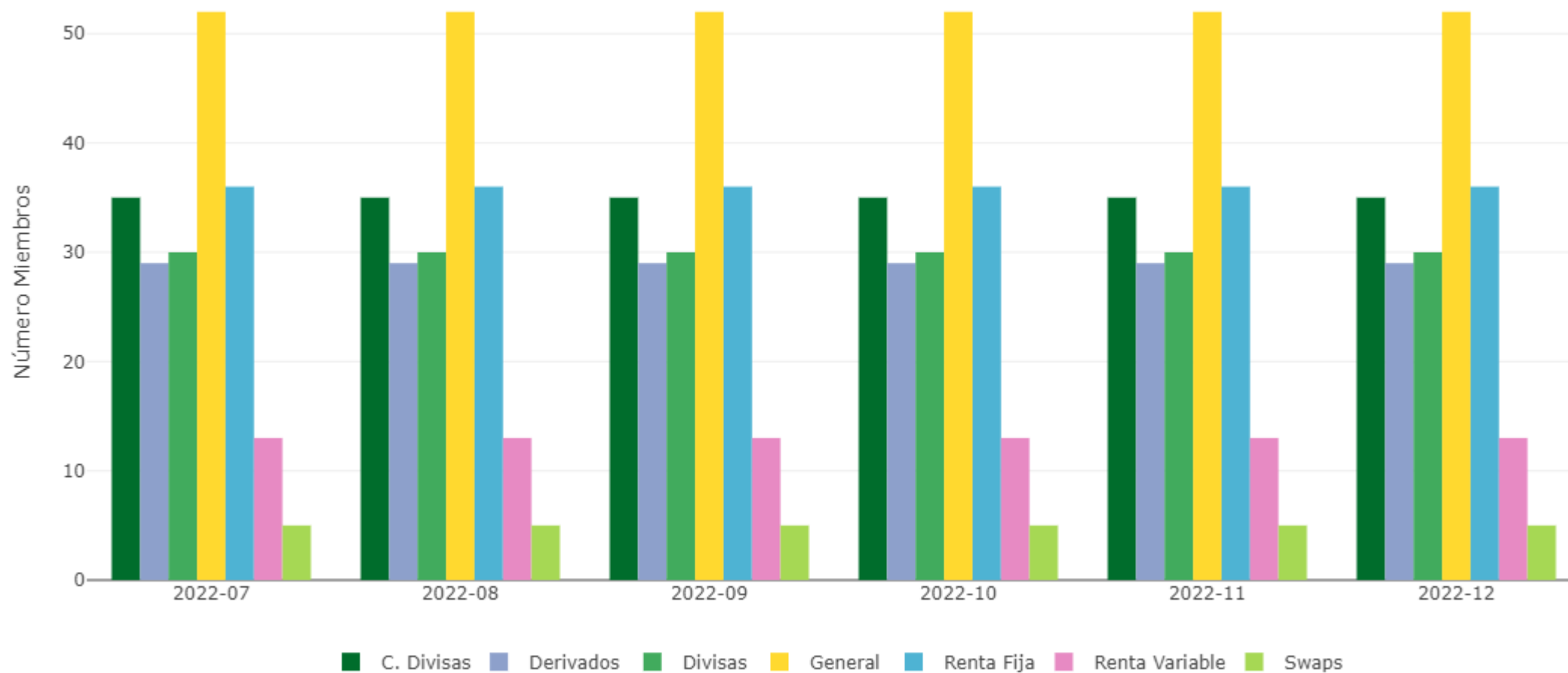


Evolución de Mercado

Diciembre 2022



*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29

Segmento	Grupo Producto	Clase 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	\$0	\$0	\$1,637	\$201,341
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$54,907	\$6,753,556
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$127	\$15,591
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$14,618	\$1,798,000
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$88	\$1,754	\$64	\$7,859
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$99	\$1,974	\$74	\$9,156
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$1,084	\$21,674	\$713	\$87,645
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.01%	\$1,105	\$1,307	\$26,134	\$792	\$97,426
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$2,091	\$12,614	\$252,281	\$13,343	\$1,641,183
Registros del 1 al 9 de un total de 19							Anterior	1 2 3 Sigui
*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29								

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29

Segmento	Grupo Producto	Clase 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	0.00%	\$0	\$21,138	\$422,752	\$105,929	\$13,029,218
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.67%	\$76,933	\$85,594	\$1,711,882	\$76,624	\$9,424,743
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.88%	\$101,042	\$100,983	\$2,019,655	\$100,722	\$12,388,746
Renta Fija	TES	TTV DP	2.39%	\$274,160	\$524,758	\$10,495,157	\$372,985	\$45,877,145
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.25%	\$373,514	\$707,434	\$14,148,682	\$763,514	\$93,912,194
Derivados	TRM	F. TRM	0.51%	\$58,355	\$1,104,025	\$22,080,492	\$640,886	\$78,829,026
Derivados	TRM	NDF FX FWD	8.84%	\$1,014,731	\$2,302,567	\$46,051,348	\$2,448,918	\$301,216,865
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	27.87%	\$3,200,465	\$4,388,080	\$87,761,598	\$5,500,983	\$676,620,942
Renta Fija	TES	Simultaneas	55.57%	\$6,381,132	\$6,573,097	\$131,461,935	\$5,959,903	\$733,068,086
Registros del 10 al 18 de un total de 19							Anterior	1 2 3 Sigui
*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29								

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29

Segmento	Grupo Producto	Clase 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%	\$11,483,527	\$15,822,866	\$316,457,319	\$16,056,738	\$1,974,978,721

Registros del 19 al 19 de un total de 19

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29

Anterior

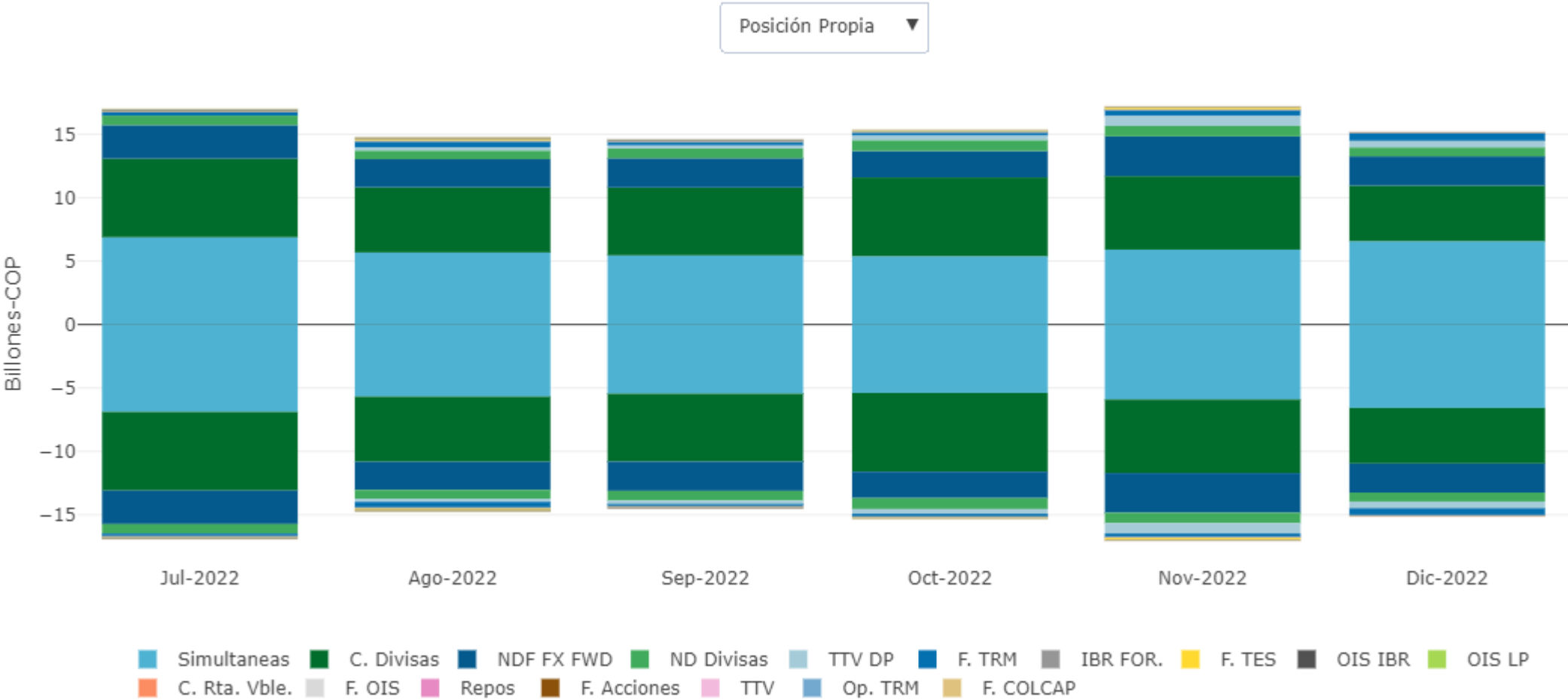
1

2

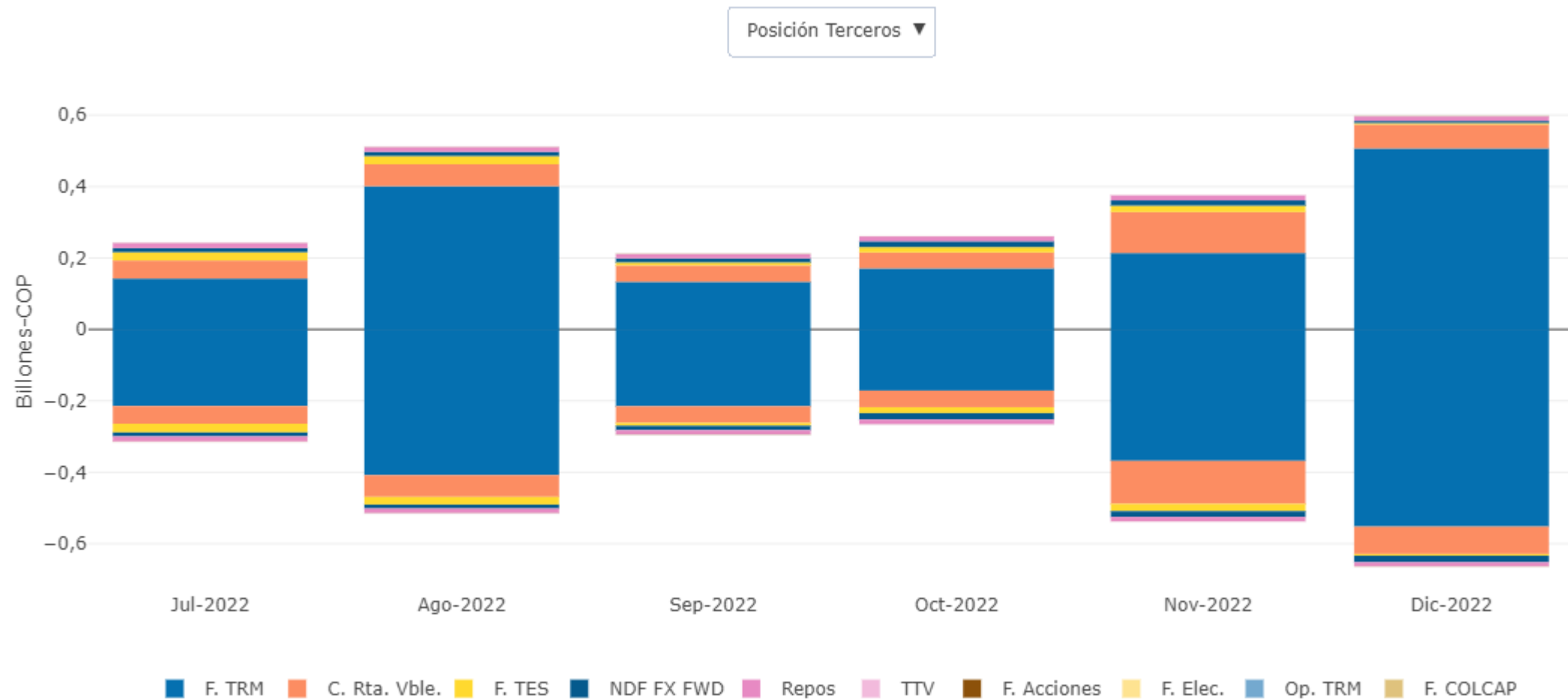
3

Siguiente

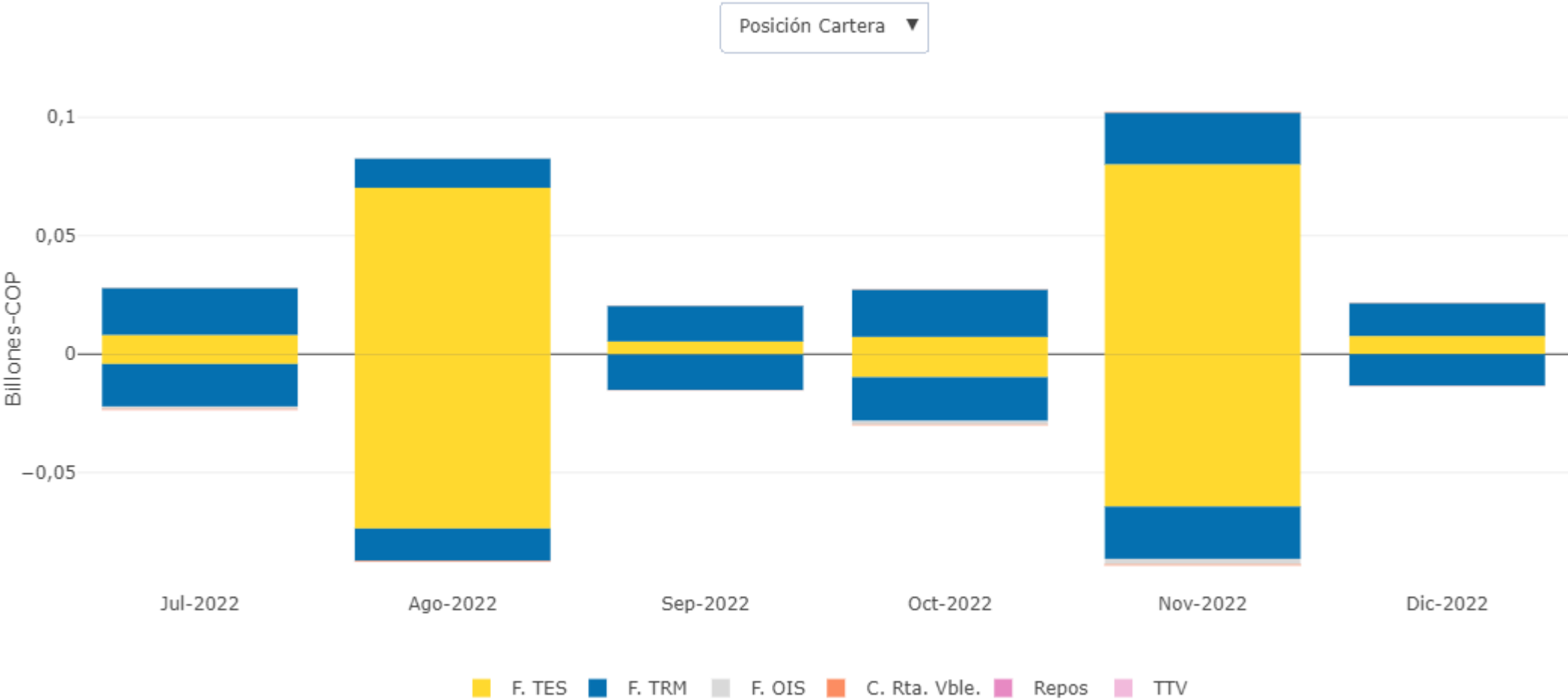
*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



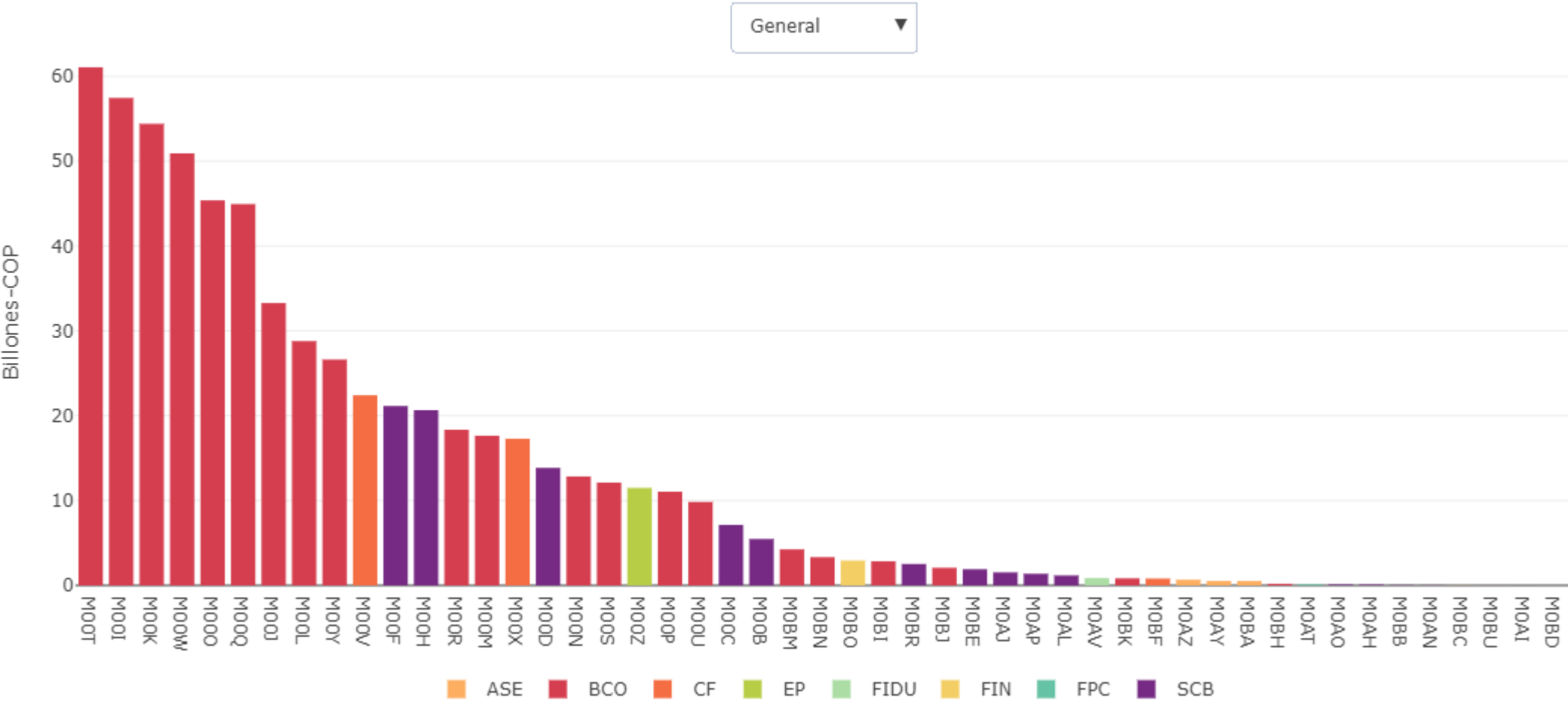
*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



Segmento	Grupo Producto	Clase 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	\$108,761,055	\$108,761,055	\$105,511,766	\$105,511,766	\$97,678,154	\$97,678,153		
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$51,822,500	\$51,822,500	\$52,828,007	\$52,828,007	\$50,972,431	\$50,972,431		
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$16,851,397	\$16,851,397	\$10,540,728	\$10,540,728	\$9,002,934	\$9,002,934		
Derivados	TRM	F. TRM	\$12,415,791	\$12,415,791	\$13,193,608	\$13,193,608	\$8,993,264	\$8,993,264		
Derivados	OIS	OIS IBR	\$9,834,594	\$9,834,594	\$10,489,963	\$10,489,963	\$11,188,596	\$11,188,596		
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$8,796,000	\$8,796,000	\$8,796,000	\$8,796,000	\$8,215,215	\$8,215,215		
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$5,647,252	\$5,647,252	\$5,639,666	\$5,639,666	\$5,303,118	\$5,303,118		
Derivados	F. TES	F. TES	\$1,894,615	\$1,894,615	\$1,895,451	\$1,895,451	\$1,996,283	\$1,996,283		
Derivados	OIS	F. OIS	\$410,626	\$410,626	\$410,146	\$410,146	\$423,009	\$423,009		
Registros del 1 al 9 de un total de 18							Anterior	1	2	Siguiente

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



Segmento	Grupo Producto	Clase 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
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$364,515	\$364,515	\$401,301	\$401,301	\$417,823	\$417,823
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$333,149	\$333,149	\$554,799	\$554,799	\$629,212	\$629,212
Renta Fija	TES	TTV DP	\$274,160	\$274,160	\$545,754	\$545,754	\$376,399	\$376,399
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$94,544	\$94,544	\$191,282	\$191,282	\$128,510	\$128,509
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$11,535	\$11,535	\$13,346	\$13,346	\$16,906	\$16,906
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$9,443	\$9,443	\$8,708	\$8,708	\$5,762	\$5,762
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$934	\$934	\$897	\$897	\$1,049	\$1,049
Derivados	TRM	Op. TRM	\$0	\$0	\$617	\$617	\$6,177	\$6,177
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$0	\$0	\$1,494	\$1,494	\$1,467	\$1,467

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior

1

2

Siguiente

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29

Rango Años	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0
5Y-10Y	\$1,126,000	\$1,126,000	\$1,086,545
0Y-1Y	\$2,091,000	\$2,032,100	\$1,474,878
1Y-2Y	\$2,628,500	\$2,654,125	\$2,631,683
2Y-5Y	\$2,950,500	\$2,983,775	\$3,022,110

*Datos del 2022-07-01 al 2022-12-29



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte