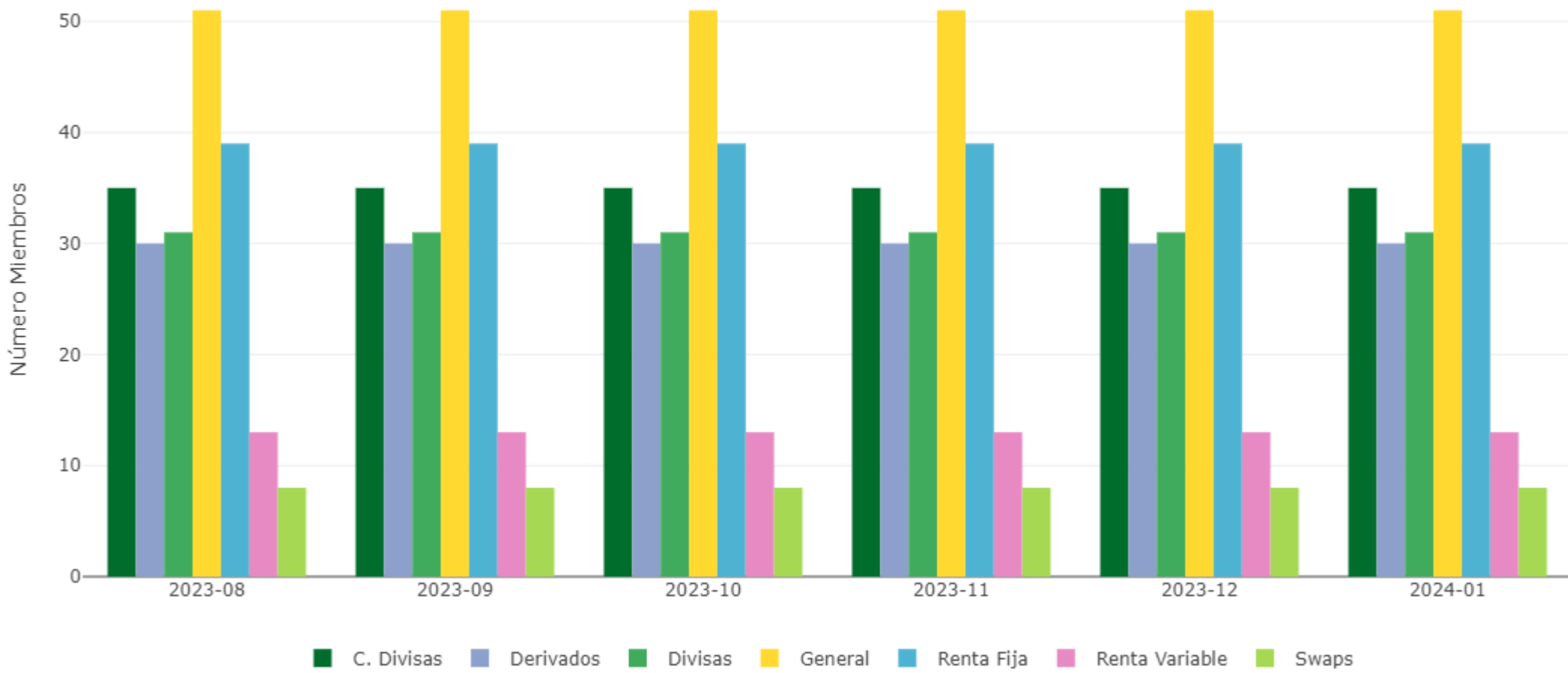


Evolución de Mercado

Enero 2024



*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31

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%	\$26,274,786	\$23,268,118	\$488,630,472	\$20,585,989	\$2,511,490,622
Renta Fija	TES	Simultaneas	59.27%	\$15,572,323	\$12,117,548	\$254,468,504	\$9,693,735	\$1,182,635,687
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	22.17%	\$5,824,591	\$5,601,970	\$117,641,363	\$5,271,270	\$643,094,969
Derivados	TRM	NDF FX FWD	7.83%	\$2,058,552	\$2,521,986	\$52,961,709	\$2,835,162	\$345,889,733
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.21%	\$844,466	\$940,985	\$19,760,678	\$826,425	\$100,823,831
Derivados	OIS	OIS IBR	3.17%	\$833,834	\$154,316	\$3,240,635	\$129,235	\$15,766,650
Renta Fija	TES	TTV DP	2.93%	\$769,538	\$895,755	\$18,810,851	\$844,850	\$103,071,697
Derivados	F. TES	F. TES	0.45%	\$119,303	\$163,316	\$3,429,636	\$137,736	\$16,803,767
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.38%	\$100,863	\$100,950	\$2,119,955	\$101,085	\$12,332,421

Registros del 1 al 9 de un total de 20
*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31

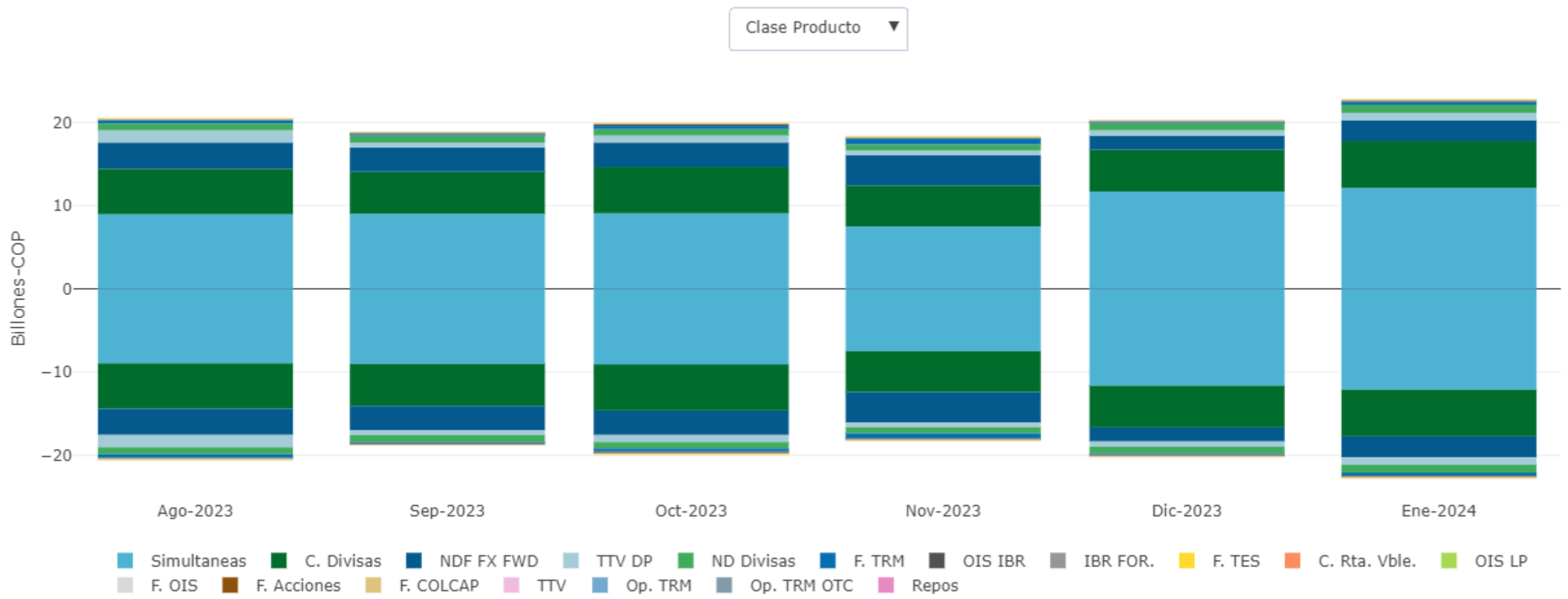


Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	F. TRM	0.35%	\$93,221	\$687,410	\$14,435,608	\$667,869	\$81,479,964
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.19%	\$49,604	\$65,476	\$1,374,999	\$57,387	\$7,001,163
Derivados	OIS	F. OIS	0.02%	\$5,124	\$2,401	\$50,417	\$5,004	\$610,429
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.01%	\$3,246	\$6,793	\$142,645	\$6,588	\$803,739
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$122	\$850	\$17,852	\$801	\$97,738
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$29	\$600	\$62	\$7,616
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$3,800	\$79,798	\$1,198	\$146,141
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$10	\$1,279
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$5	\$670

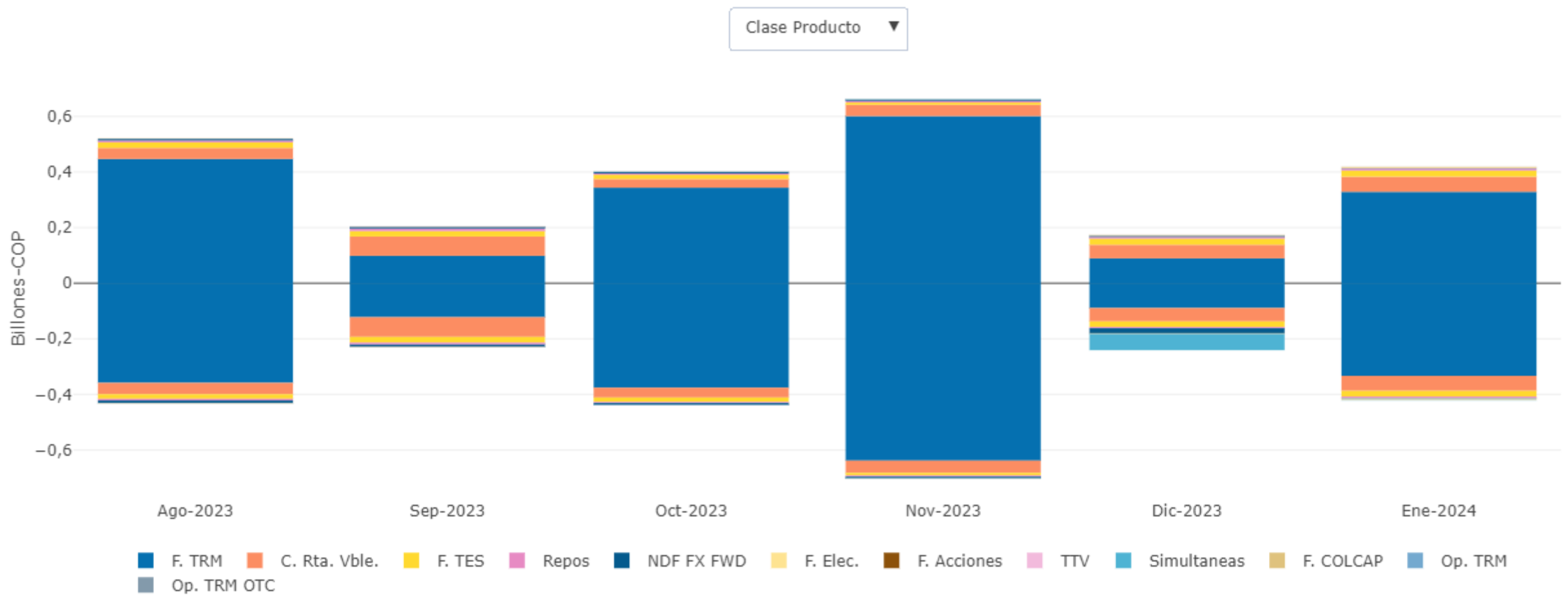
Registros del 10 al 18 de un total de 20
*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



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
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$534	\$11,222	\$411	\$50,129
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$4,000	\$84,000	\$7,156	\$873,000



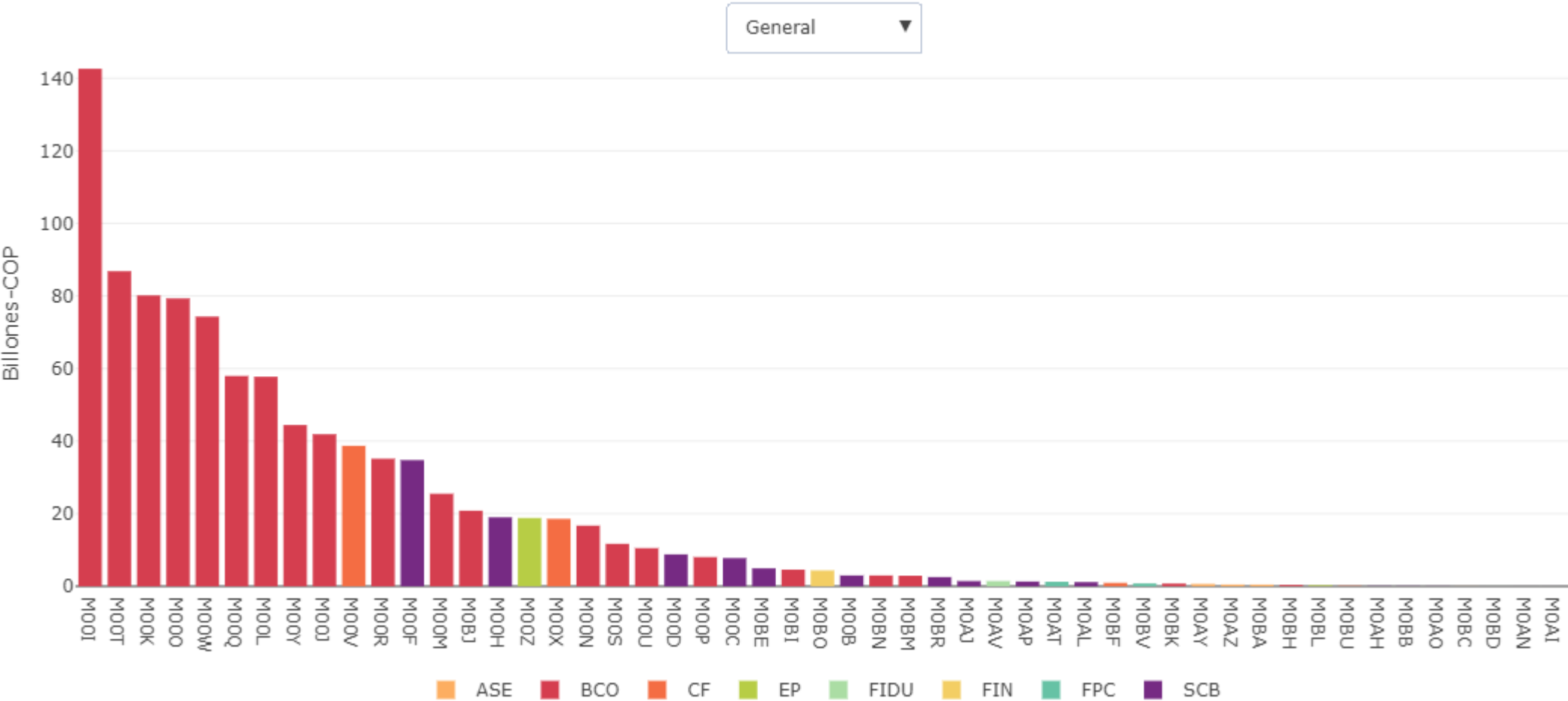
*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



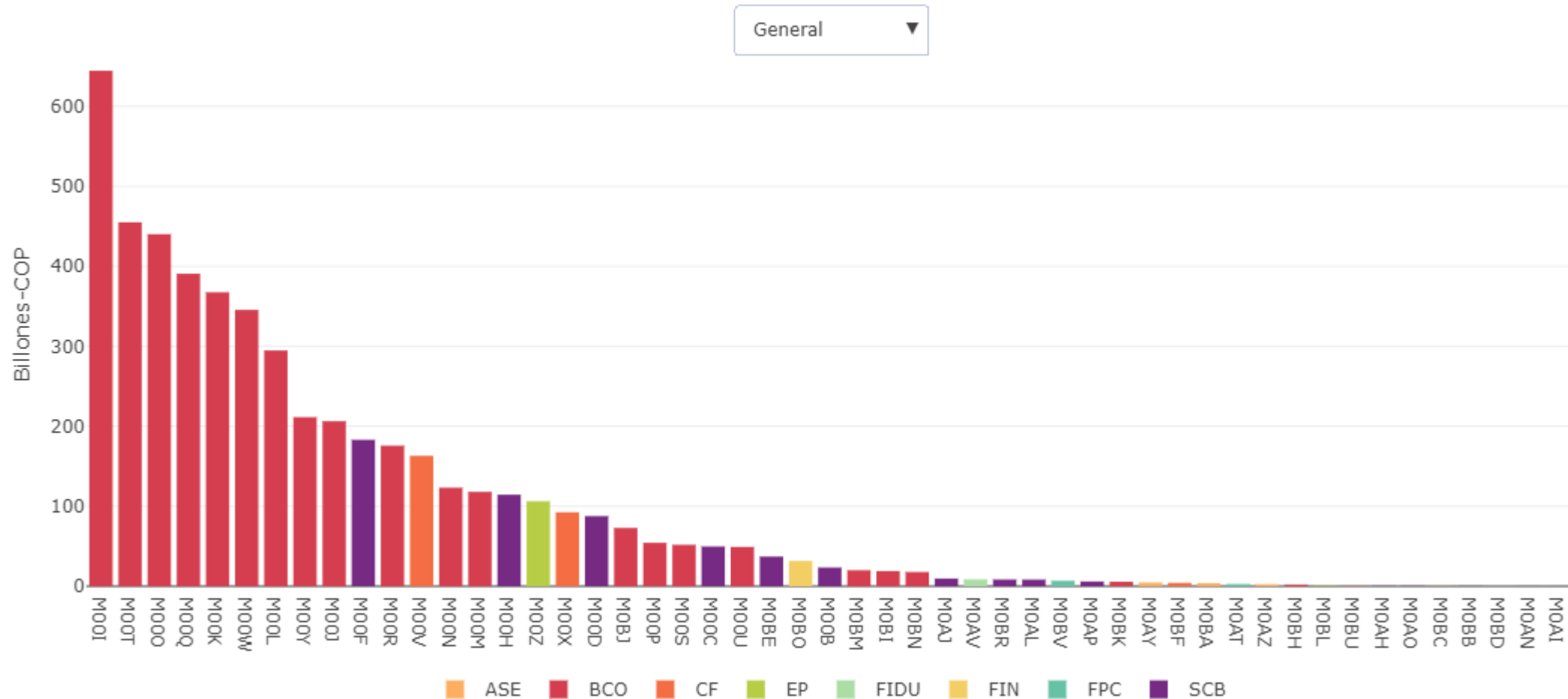
*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	Posición Abierta Compra Último Día M-COP	Posición Abierta Venta Último Día M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$129,164,250	\$129,164,246	\$120,835,112	\$120,835,112	\$122,173,219	\$122,173,225
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$51,910,202	\$51,910,202	\$48,566,489	\$48,566,489	\$53,130,218	\$53,130,218
Derivados	OIS	OIS IBR	\$20,804,458	\$20,804,458	\$19,156,903	\$19,156,903	\$19,637,685	\$19,637,685
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$20,454,508	\$20,454,508	\$16,862,129	\$16,862,129	\$13,459,001	\$13,459,001
Derivados	TRM	F. TRM	\$13,039,707	\$13,039,707	\$13,276,704	\$13,276,704	\$13,385,985	\$13,385,985
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$10,233,500	\$10,233,500	\$10,255,071	\$10,255,071	\$10,499,279	\$10,499,279
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$6,403,630	\$6,403,630	\$6,274,695	\$6,274,695	\$6,447,086	\$6,447,086
Derivados	F. TES	F. TES	\$3,431,698	\$3,431,698	\$3,084,981	\$3,084,981	\$2,380,948	\$2,380,948
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,118,225	\$1,118,225	\$1,287,214	\$1,287,214	\$1,293,881	\$1,293,881



Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	Posición Abierta Compra Último Día M-COP	Posición Abierta Venta Último Día M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Periodo M-COP
Renta Fija	TES	TTV DP	\$769,538	\$769,538	\$895,755	\$895,755	\$844,850	\$844,850
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$600,627	\$600,627	\$789,431	\$789,431	\$723,381	\$723,381
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$190,306	\$190,306	\$181,516	\$181,516	\$209,725	\$209,725
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$91,965	\$91,965	\$58,597	\$58,597	\$30,629	\$30,629
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$82,786	\$82,782	\$113,073	\$113,073	\$100,318	\$100,324
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$22,774	\$22,774	\$20,955	\$20,955	\$16,976	\$16,976
Derivados	TRM	Op. TRM	\$9,097	\$9,097	\$9,149	\$9,149	\$11,105	\$11,105
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$1,229	\$1,229	\$1,266	\$1,266	\$1,124	\$1,124
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$1	\$1	\$1,185	\$1,185	\$895	\$895

Registros del 10 al 18 de un total de 19

*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31

Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	Posición Abierta Compra Último Día M-COP	Posición Abierta Venta Último Día M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$0	\$0	\$0	\$0	\$132	\$132

Rango ▾	Posición Abierta Último Día M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP ▾
0M-1M	\$56,000	\$74,143	\$115,086
1M-3M	\$204,000	\$155,286	\$151,914
3M-6M	\$202,000	\$164,143	\$176,361
6M-9M	\$591,500	\$596,738	\$301,209
9M-1Y	\$98,500	\$219,405	\$407,262
1Y-18M	\$619,000	\$505,524	\$383,086
18M-2Y	\$315,000	\$192,833	\$262,734
2Y-5Y	\$360,000	\$368,048	\$331,762
5Y-7Y	\$132,000	\$126,095	\$150,262
7Y-10Y	\$68,500	\$68,500	\$90,939

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2023-08-01 al 2024-01-31



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte