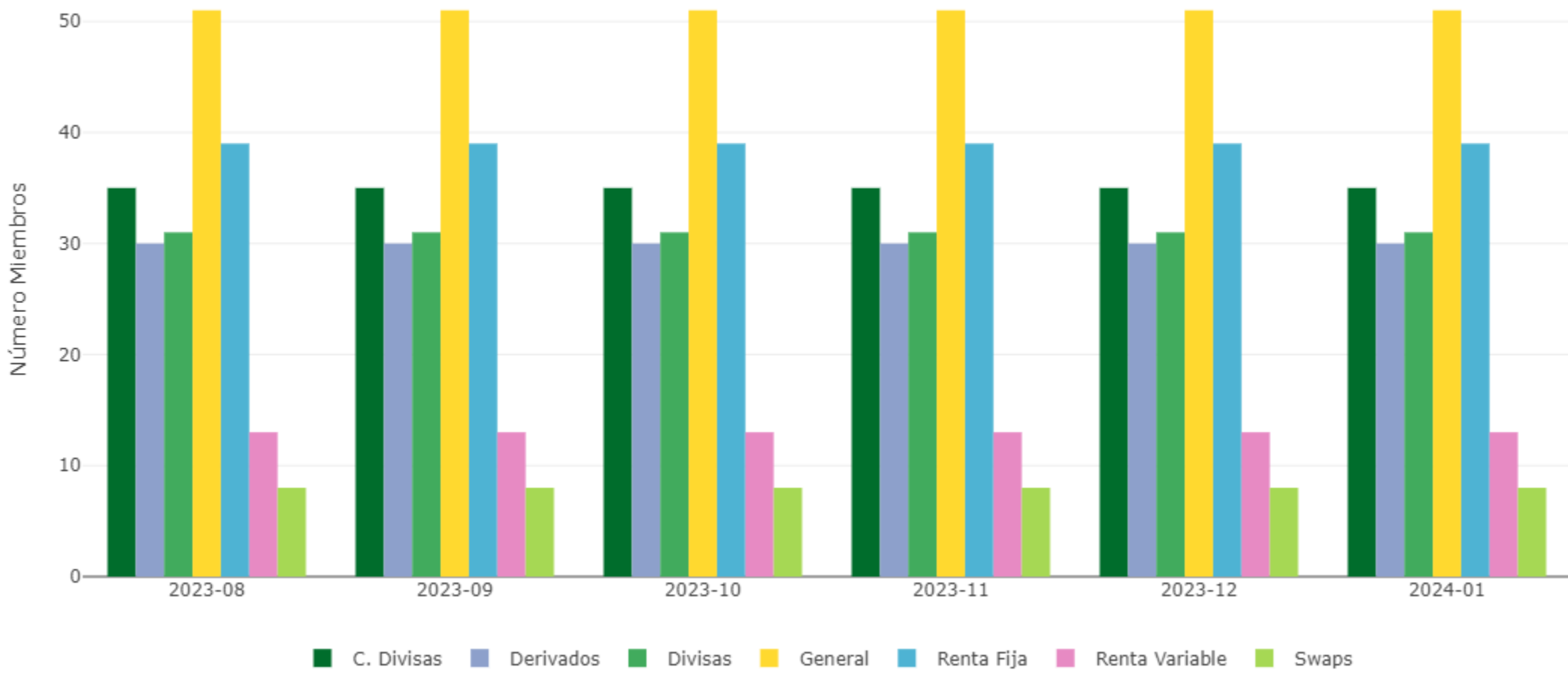


# Evolución de Mercado

---

Enero 2025



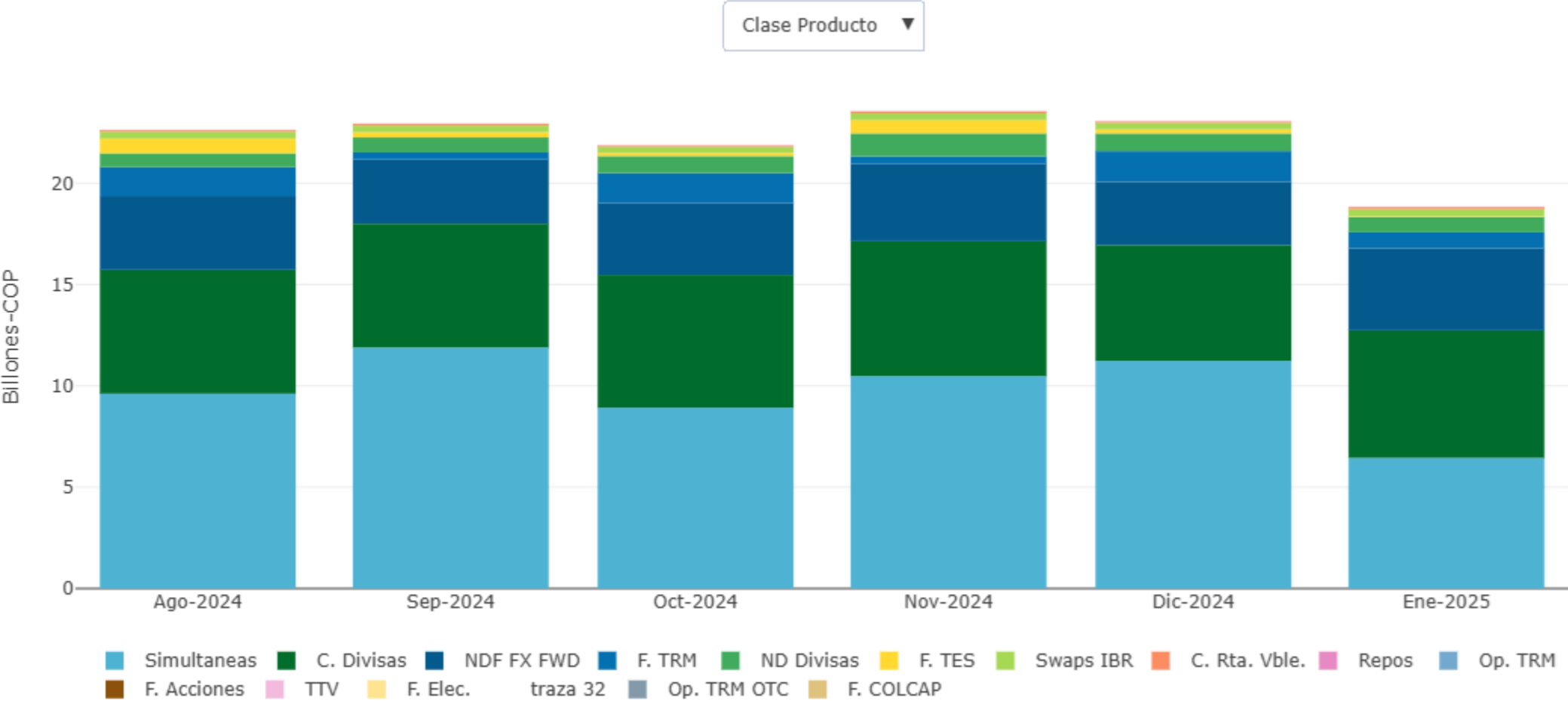
\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31

| 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% | \$18,535,172             | \$18,841,023                             | \$395,661,479                      | \$22,114,859                          | \$2,720,127,600                 |
| C. Divisas        | C. Divisas     | C. Divisas     | 31.75%  | \$5,885,373              | \$6,294,394                              | \$132,182,267                      | \$6,239,759                           | \$767,490,359                   |
| Renta Fija        | TES            | Simultaneas    | 30.80%  | \$5,708,289              | \$6,444,221                              | \$135,328,645                      | \$9,736,673                           | \$1,197,610,740                 |
| Derivados         | TRM            | NDF FX FWD     | 26.41%  | \$4,894,361              | \$4,043,822                              | \$84,920,266                       | \$3,552,489                           | \$436,956,164                   |
| Swaps             | Swaps IBR      | Swaps IBR      | 5.77%   | \$1,069,000              | \$339,476                                | \$7,129,000                        | \$326,825                             | \$40,199,500                    |
| Divisas           | ND Divisas     | ND Divisas     | 3.62%   | \$671,889                | \$756,373                                | \$15,883,840                       | \$835,074                             | \$102,714,078                   |
| C. Renta Variable | C. Rta. Vble.  | C. Rta. Vble.  | 0.77%   | \$143,420                | \$102,828                                | \$2,159,380                        | \$80,434                              | \$9,893,332                     |
| Derivados         | TRM            | F. TRM         | 0.71%   | \$130,872                | \$796,062                                | \$16,717,306                       | \$995,856                             | \$122,490,300                   |
| Derivados         | F. TES         | F. TES         | 0.09%   | \$16,148                 | \$46,266                                 | \$971,591                          | \$332,716                             | \$40,924,007                    |

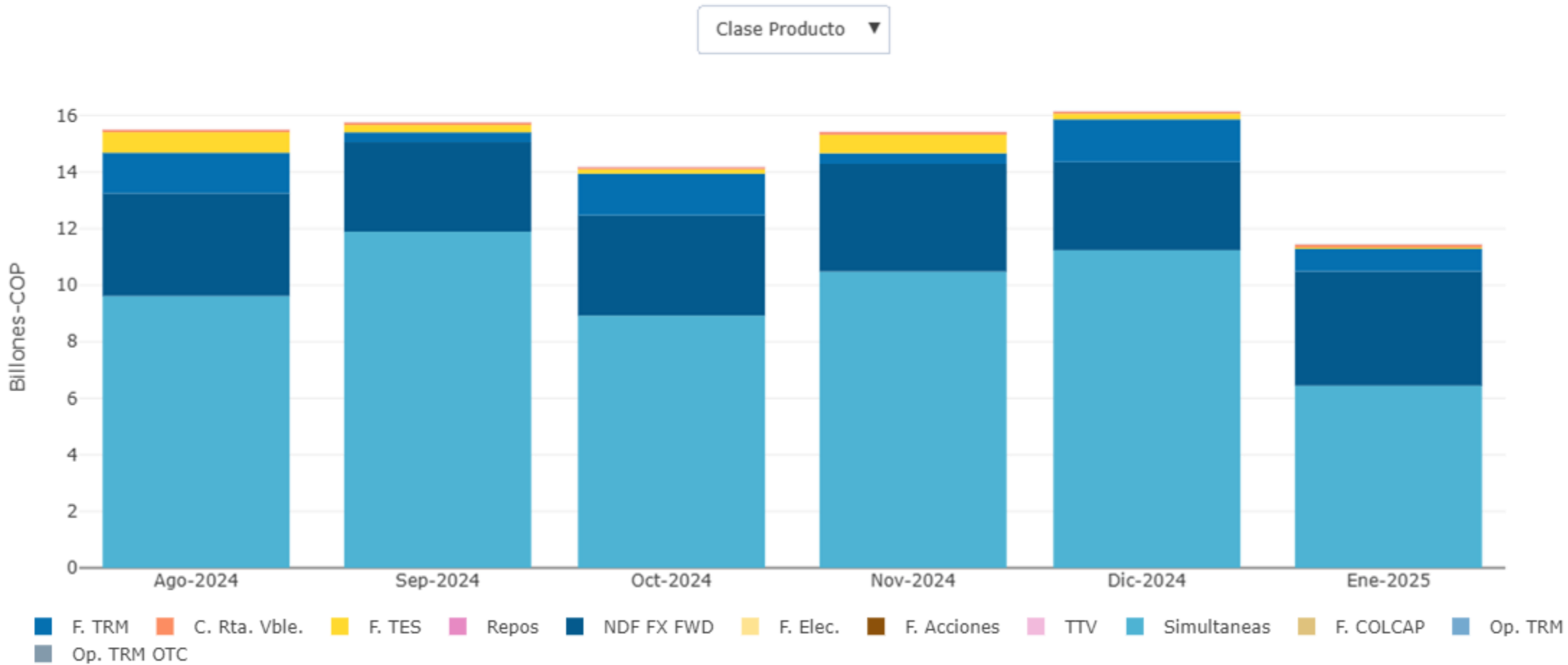
Registros del 1 al 9 de un total de 17  
\*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

| 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    | Repos          | 0.07% | \$13,140                 | \$9,111                                  | \$191,326                          | \$9,894                               | \$1,216,916                     |
| Renta Variable | Repos y TTV    | TTV            | 0.01% | \$2,007                  | \$980                                    | \$20,572                           | \$1,205                               | \$148,212                       |
| Derivados      | F. Rta. Vble.  | F. Acciones    | 0.00% | \$651                    | \$958                                    | \$20,109                           | \$1,255                               | \$154,375                       |
| Derivados      | F. Rta. Vble.  | F. COLCAP      | 0.00% | \$23                     | \$1                                      | \$23                               | \$1                                   | \$85                            |
| Derivados      | F. Elec.       | F. Elec.       | 0.00% | \$0                      | \$111                                    | \$2,335                            | \$676                                 | \$83,185                        |
| Derivados      | TRM            | Op. TRM        | 0.00% | \$0                      | \$3,921                                  | \$82,351                           | \$1,506                               | \$185,259                       |
| Derivados      | TRM            | Op. TRM OTC    | 0.00% | \$0                      | \$260                                    | \$5,469                            | \$115                                 | \$14,089                        |
| Swaps          |                |                | 0.00% | \$0                      | \$2,238                                  | \$47,000                           | \$382                                 | \$47,000                        |

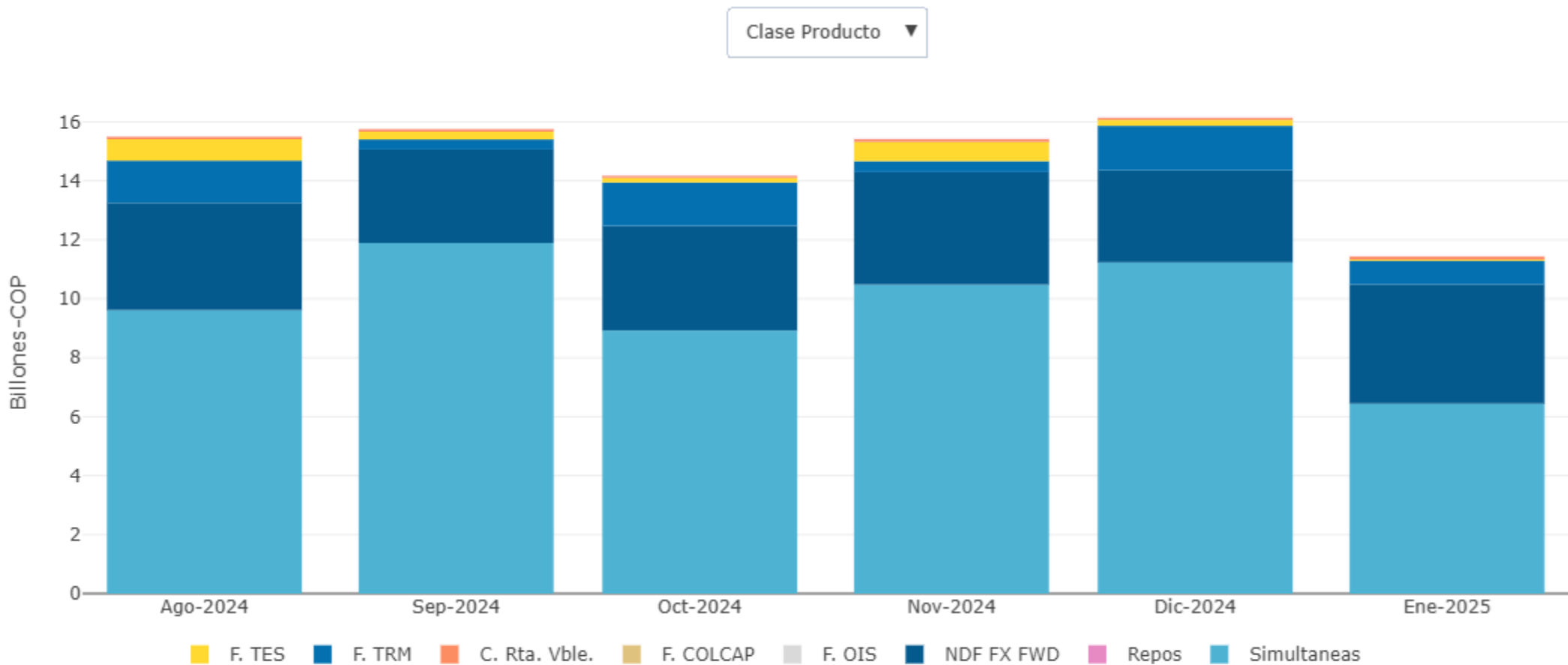
Registros del 10 al 17 de un total de 17  
\*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



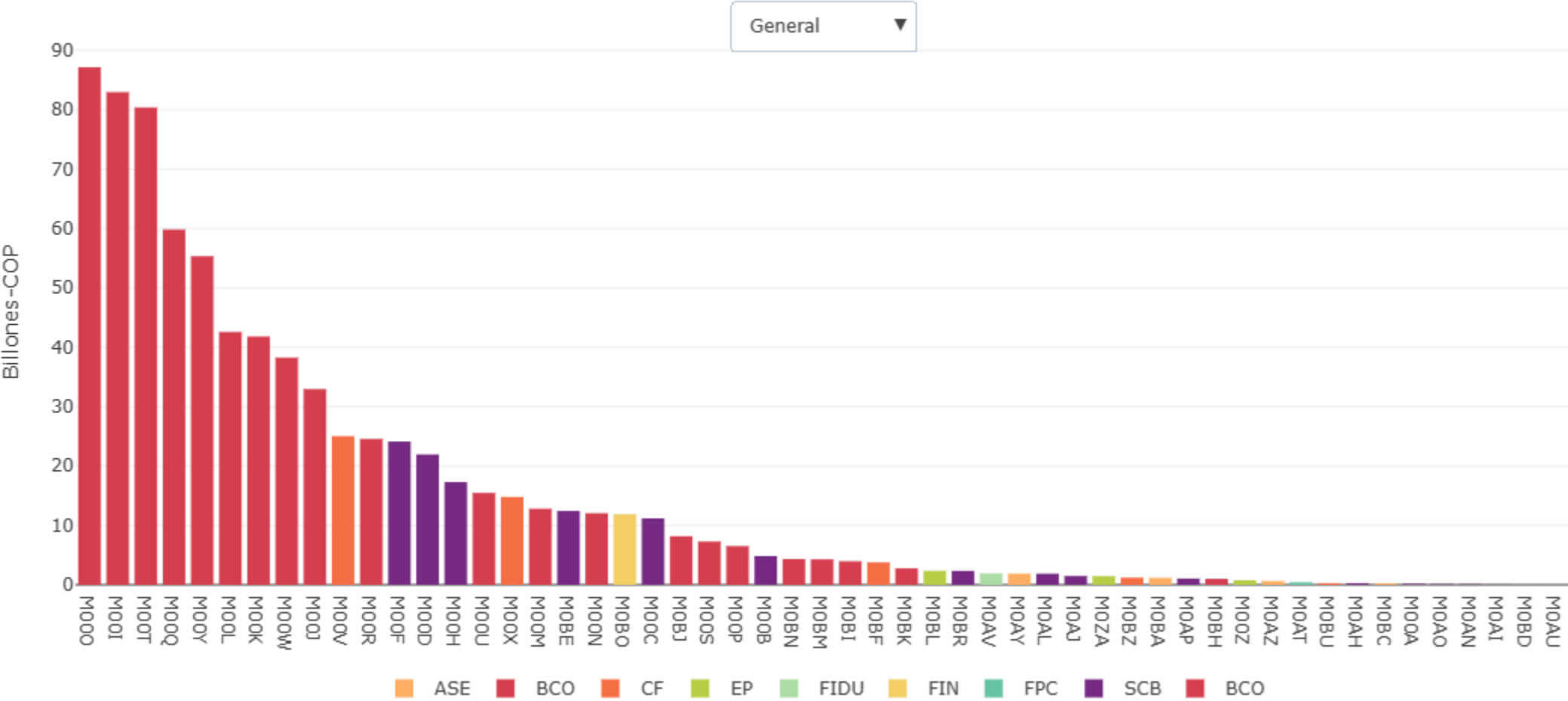
\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31



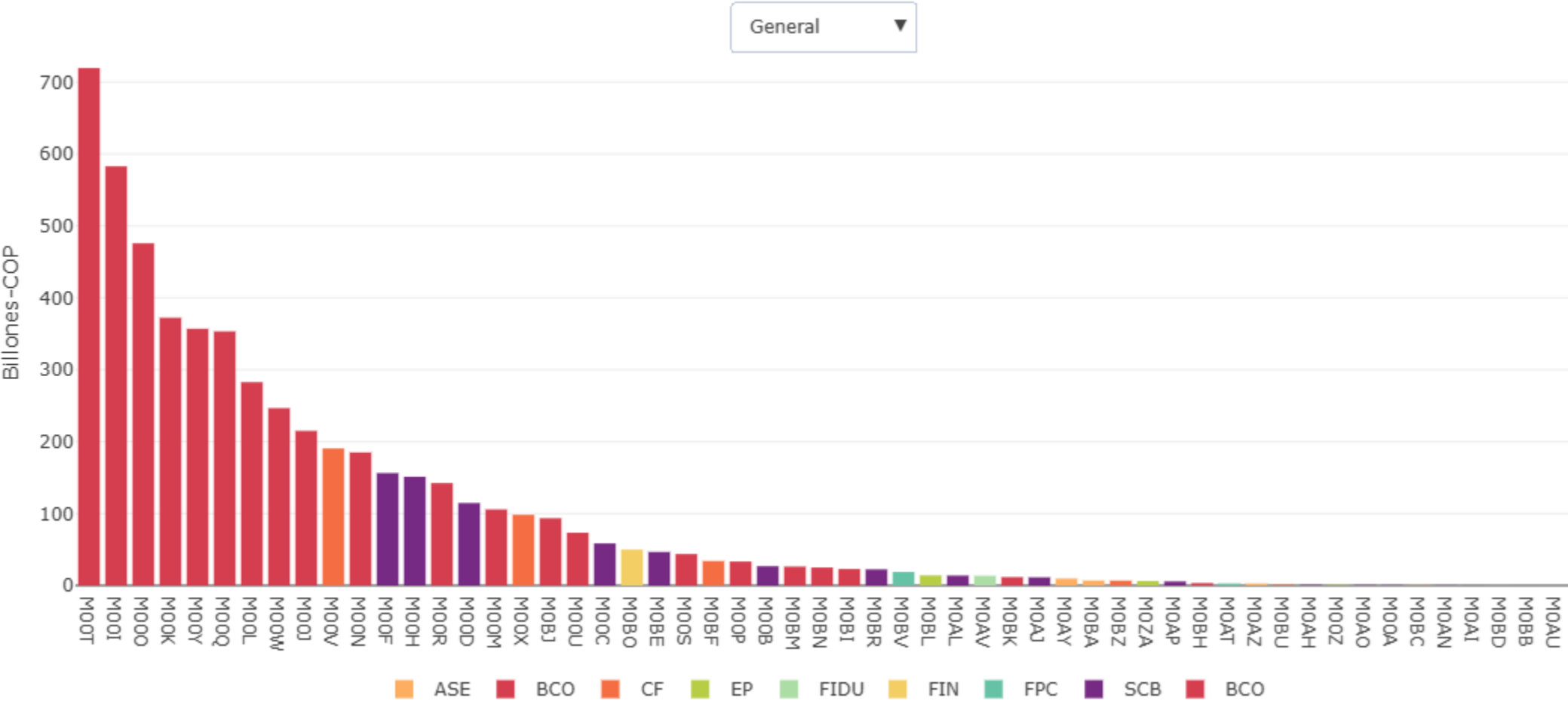
\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31



\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31



\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31



\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31

| 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    | \$169,074,474                            | \$169,074,474                           | \$162,230,230                                            | \$162,230,321                                           | \$156,158,611                                         | \$156,158,707                                        |
| Derivados         | TRM            | NDF FX FWD     | \$86,054,608                             | \$86,054,608                            | \$83,725,465                                             | \$83,725,465                                            | \$77,458,288                                          | \$77,458,288                                         |
| Swaps             | Swaps IBR      | Swaps IBR      | \$41,935,000                             | \$41,935,000                            | \$39,861,810                                             | \$39,861,810                                            | \$36,040,341                                          | \$36,040,341                                         |
| Derivados         | TRM            | F. TRM         | \$19,586,740                             | \$19,586,740                            | \$17,489,271                                             | \$17,489,271                                            | \$17,244,059                                          | \$17,244,059                                         |
| Renta Fija        | TES            | Simultaneas    | \$11,988,986                             | \$11,988,986                            | \$11,779,597                                             | \$11,779,597                                            | \$14,762,026                                          | \$14,762,026                                         |
| Derivados         | F. TES         | F. TES         | \$7,435,088                              | \$7,435,088                             | \$7,275,733                                              | \$7,275,733                                             | \$6,433,603                                           | \$6,433,603                                          |
| Divisas           | ND Divisas     | ND Divisas     | \$596,924                                | \$596,924                               | \$654,281                                                | \$654,281                                               | \$732,845                                             | \$732,845                                            |
| Derivados         | OIS            | OIS IBR        | \$398,700                                | \$398,700                               | \$485,533                                                | \$485,533                                               | \$2,050,035                                           | \$2,050,035                                          |
| C. Renta Variable | C. Rta. Vble.  | C. Rta. Vble.  | \$319,502                                | \$319,502                               | \$169,598                                                | \$169,689                                               | \$147,960                                             | \$148,056                                            |

Registros del 1 al 9 de un total de 19  
\*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

| 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 |
|----------------|----------------|----------------|------------------------------------------|-----------------------------------------|----------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------|------------------------------------------------------|
| Renta Variable | Repos y TTV    | Repos          | \$309,358                                | \$309,358                               | \$308,206                                                | \$308,206                                               | \$302,656                                             | \$302,656                                            |
| Derivados      | F. Elec.       | F. Elec.       | \$163,115                                | \$163,115                               | \$161,829                                                | \$161,829                                               | \$173,148                                             | \$173,148                                            |
| Derivados      | OIS            | F. OIS         | \$98,818                                 | \$98,818                                | \$113,271                                                | \$113,271                                               | \$317,480                                             | \$317,480                                            |
| Derivados      | TRM            | Op. TRM        | \$86,179                                 | \$86,179                                | \$69,280                                                 | \$69,280                                                | \$48,254                                              | \$48,254                                             |
| Swaps          |                |                | \$47,000                                 | \$47,000                                | \$13,429                                                 | \$13,429                                                | \$2,293                                               | \$2,293                                              |
| Derivados      | F. Rta. Vble.  | F. Acciones    | \$30,406                                 | \$30,406                                | \$38,705                                                 | \$38,705                                                | \$29,935                                              | \$29,935                                             |
| Renta Variable | Repos y TTV    | TTV            | \$14,484                                 | \$14,484                                | \$3,422                                                  | \$3,422                                                 | \$3,216                                               | \$3,216                                              |
| Derivados      | TRM            | Op. TRM OTC    | \$9,567                                  | \$9,567                                 | \$8,978                                                  | \$8,978                                                 | \$3,211                                               | \$3,211                                              |
| Derivados      | F. Rta. Vble.  | F. COLCAP      | \$0                                      | \$0                                     | \$21                                                     | \$21                                                    | \$80                                                  | \$80                                                 |

\*Datos del 2023-08-01 al 2025-01-31

| 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 | IBR FOR.       | IBR FOR.       | \$0                                      | \$0                                     | \$71,802                                                 | \$71,802                                                | \$409,182                                             | \$409,182                                            |

Registros del 19 al 19 de un total de 19  
\*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



| Reango | Posición Abierta Último Día M-COP | Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP | Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP |
|--------|-----------------------------------|---------------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 0M-1M  | \$1,256,500                       | \$1,349,833                                       | \$2,142,016                                    |
| 1M-3M  | \$1,722,500                       | \$1,194,857                                       | \$1,593,512                                    |
| 3M-6M  | \$2,029,000                       | \$1,845,476                                       | \$1,140,996                                    |
| 6M-9M  | \$1,752,000                       | \$1,525,548                                       | \$1,196,589                                    |
| 9M-1Y  | \$438,500                         | \$542,167                                         | \$1,037,654                                    |
| 1Y-18M | \$719,500                         | \$953,000                                         | \$883,919                                      |
| 18M-2Y | \$1,006,250                       | \$787,821                                         | \$654,171                                      |
| 2Y-5Y  | \$276,500                         | \$285,119                                         | \$384,858                                      |
| 5Y-7Y  | \$76,500                          | \$86,357                                          | \$83,504                                       |
| 7Y-10Y | \$94,250                          | \$100,679                                         | \$98,821                                       |

Registros del 1 al 10 de un total de 10  
\*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



# crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte