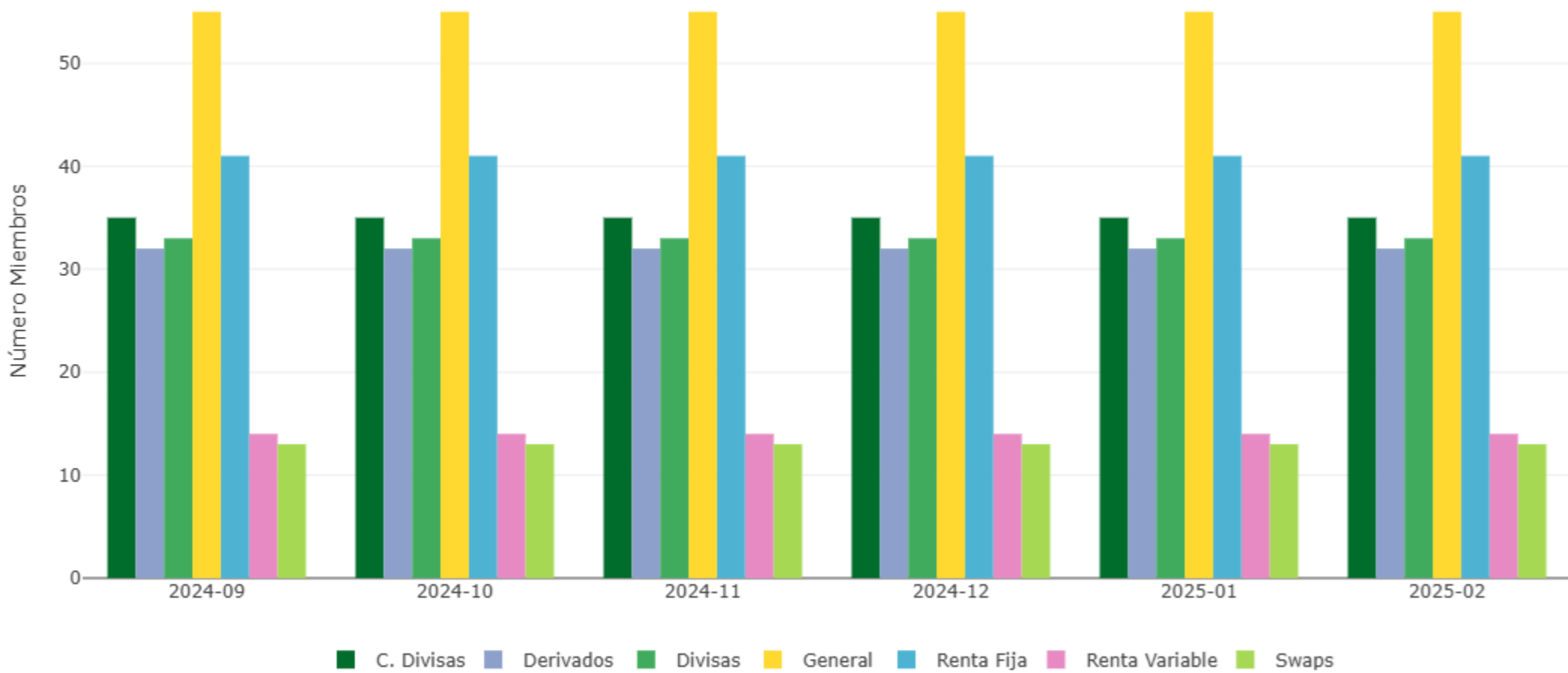


Evolución de Mercado

Febrero 2025



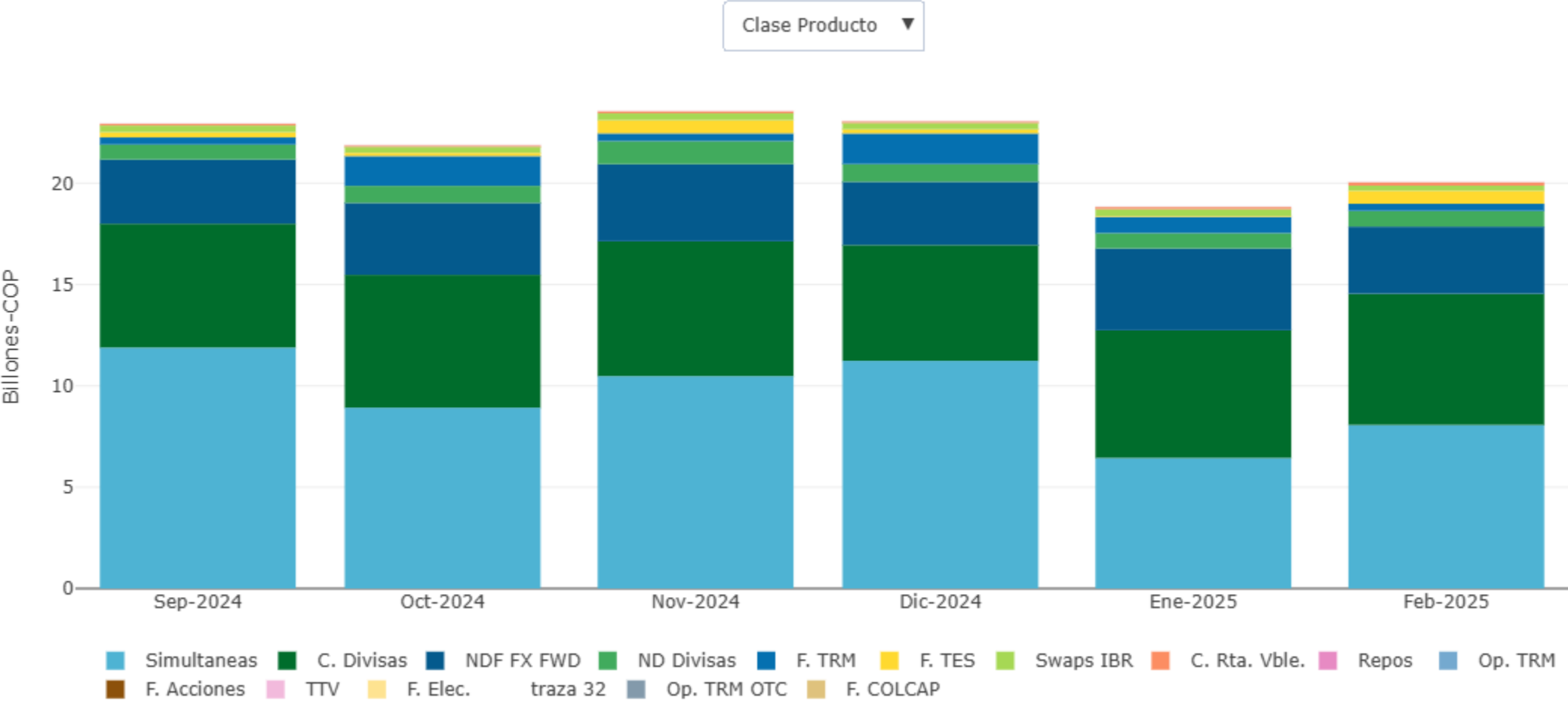
*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28

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%	\$23,156,433	\$20,055,375	\$401,107,496	\$21,695,466	\$2,668,542,293
Renta Fija	TES	Simultaneas	46.12%	\$10,679,346	\$8,072,215	\$161,444,293	\$9,485,665	\$1,166,736,760
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	28.28%	\$6,548,127	\$6,474,341	\$129,486,822	\$6,299,712	\$774,864,592
Derivados	TRM	NDF FX FWD	17.30%	\$4,005,577	\$3,312,058	\$66,241,168	\$3,500,146	\$430,517,992
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.23%	\$746,854	\$778,301	\$15,566,017	\$850,467	\$104,607,409
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	2.09%	\$483,156	\$154,536	\$3,090,720	\$92,429	\$11,368,810
Derivados	F. TES	F. TES	1.73%	\$399,920	\$644,824	\$12,896,477	\$319,740	\$39,328,081
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	0.83%	\$192,000	\$252,050	\$5,041,000	\$312,675	\$38,459,000
Derivados	TRM	F. TRM	0.39%	\$90,262	\$348,331	\$6,966,626	\$818,723	\$100,702,921

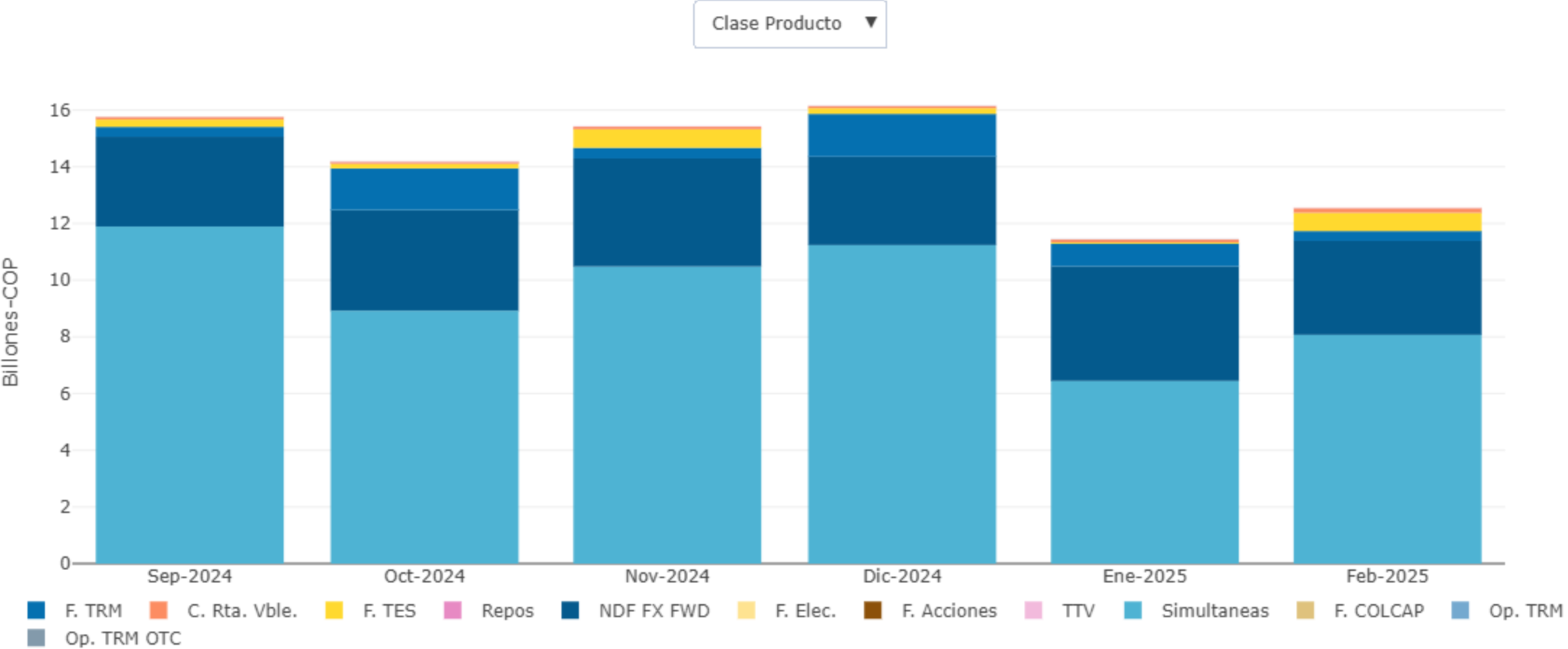
Registros del 1 al 9 de un total de 17
*Datos del 2024-09-01 al 2025-02-28

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	0.04%	\$10,009	\$11,670	\$233,404	\$10,452	\$1,285,553
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$591	\$2,274	\$45,482	\$1,247	\$153,364
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$591	\$1,086	\$21,710	\$1,366	\$167,978
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$1	\$85
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$3,333	\$66,661	\$815	\$100,244
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$42	\$838	\$1,481	\$182,138
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$314	\$6,278	\$166	\$20,366
Swaps			0.00%	\$0	\$0	\$0	\$382	\$47,000

Registros del 10 al 17 de un total de 17
*Datos del 2024-09-01 al 2025-02-28



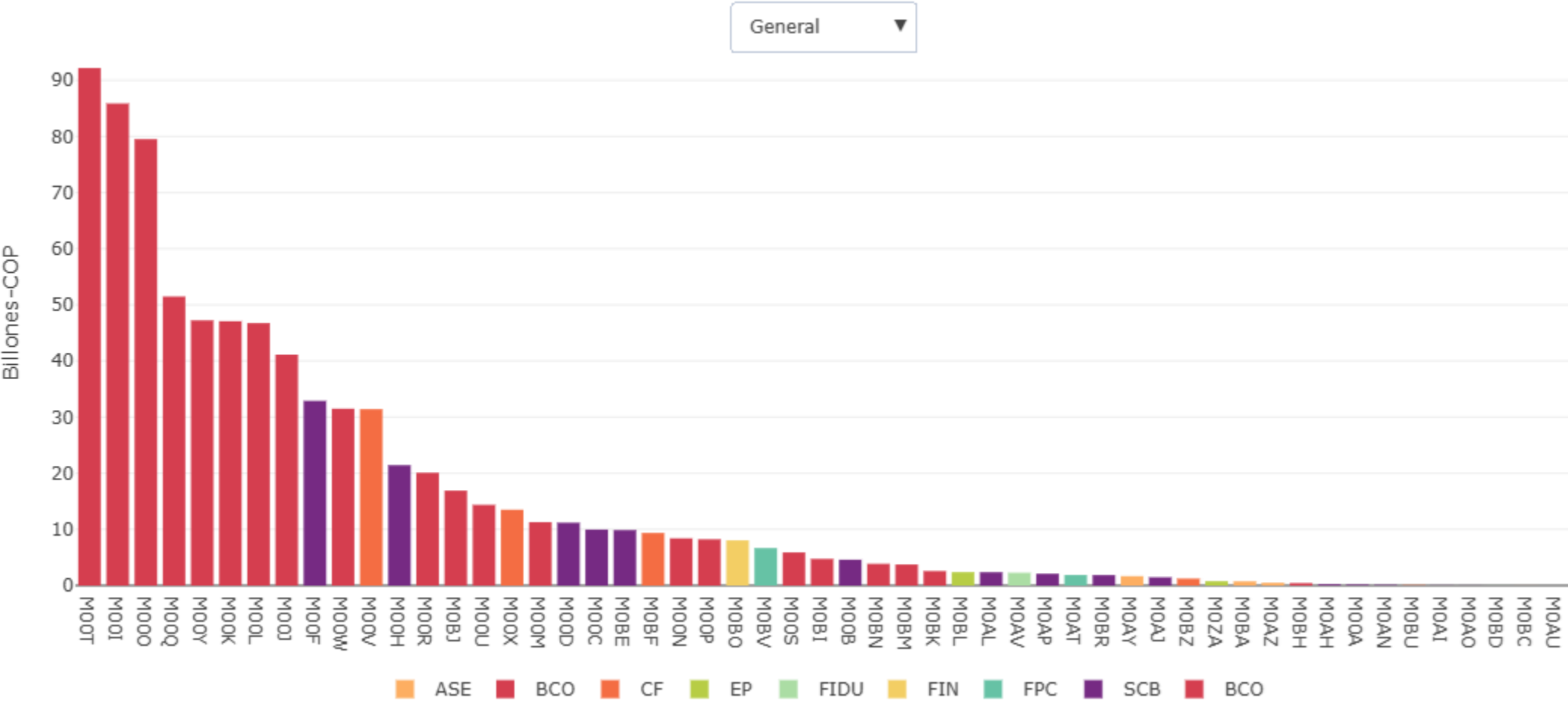
*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



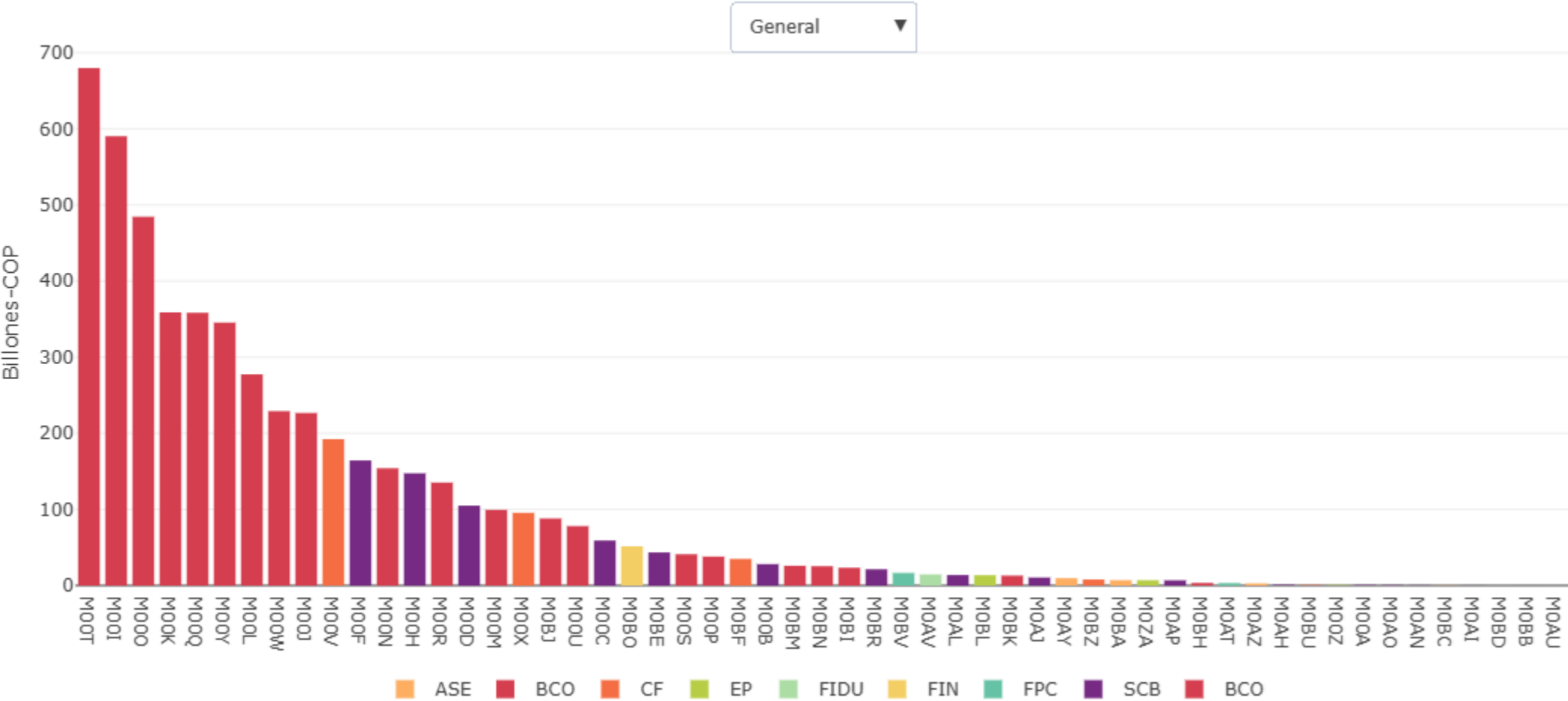
*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



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	\$167,775,231	\$167,775,231	\$164,873,746	\$164,873,746	\$158,614,528	\$158,614,624
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$81,410,173	\$81,410,173	\$83,389,812	\$83,389,812	\$79,020,630	\$79,020,630
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$42,460,500	\$42,460,500	\$42,622,375	\$42,622,375	\$37,927,459	\$37,927,459
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$18,123,480	\$18,123,480	\$13,265,309	\$13,265,309	\$14,721,488	\$14,721,488
Derivados	TRM	F. TRM	\$15,199,917	\$15,199,917	\$16,887,683	\$16,887,683	\$17,223,759	\$17,223,759
Derivados	F. TES	F. TES	\$8,299,478	\$8,299,478	\$6,668,941	\$6,668,941	\$6,181,293	\$6,181,293
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$605,172	\$605,172	\$646,555	\$646,555	\$738,811	\$738,811
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$586,317	\$586,317	\$249,344	\$249,345	\$168,015	\$168,111
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$351,797	\$351,797	\$323,499	\$323,499	\$303,525	\$303,525

*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28



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	OIS	OIS IBR	\$293,893	\$293,893	\$376,461	\$376,461	\$1,507,864	\$1,507,864
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$196,651	\$196,651	\$181,208	\$181,208	\$176,069	\$176,069
Derivados	TRM	Op. TRM	\$85,452	\$85,452	\$85,190	\$85,190	\$58,263	\$58,263
Derivados	OIS	F. OIS	\$69,123	\$69,123	\$82,490	\$82,490	\$251,826	\$251,826
Swaps			\$47,000	\$47,000	\$47,000	\$47,000	\$9,935	\$9,935
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$33,474	\$33,474	\$31,862	\$31,862	\$30,608	\$30,608
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$9,442	\$9,442	\$9,010	\$9,010	\$4,635	\$4,635
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$3,361	\$3,361	\$7,007	\$7,007	\$3,578	\$3,578
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$0	\$0	\$39	\$39

*Datos del 2023-09-01 al 2025-02-28

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	\$0	\$0	\$286,729	\$286,729

Registros del 19 al 19 de un total de 19
*Datos del 2024-09-01 al 2025-02-28



Reango ▾	Posición Abierta Último Día M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP ▾
0M-1M	\$1,266,500	\$1,139,000	\$2,058,028
1M-3M	\$1,764,500	\$1,738,750	\$1,657,703
3M-6M	\$1,448,500	\$1,939,550	\$1,294,549
6M-9M	\$1,629,000	\$1,611,675	\$1,283,439
9M-1Y	\$518,000	\$475,325	\$954,598
1Y-18M	\$952,000	\$940,025	\$892,642
18M-2Y	\$1,117,000	\$1,196,238	\$767,457
2Y-5Y	\$539,500	\$411,450	\$377,862
5Y-7Y	\$62,500	\$59,700	\$82,411
7Y-10Y	\$71,250	\$76,550	\$98,740

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2024-09-01 al 2025-02-28



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte