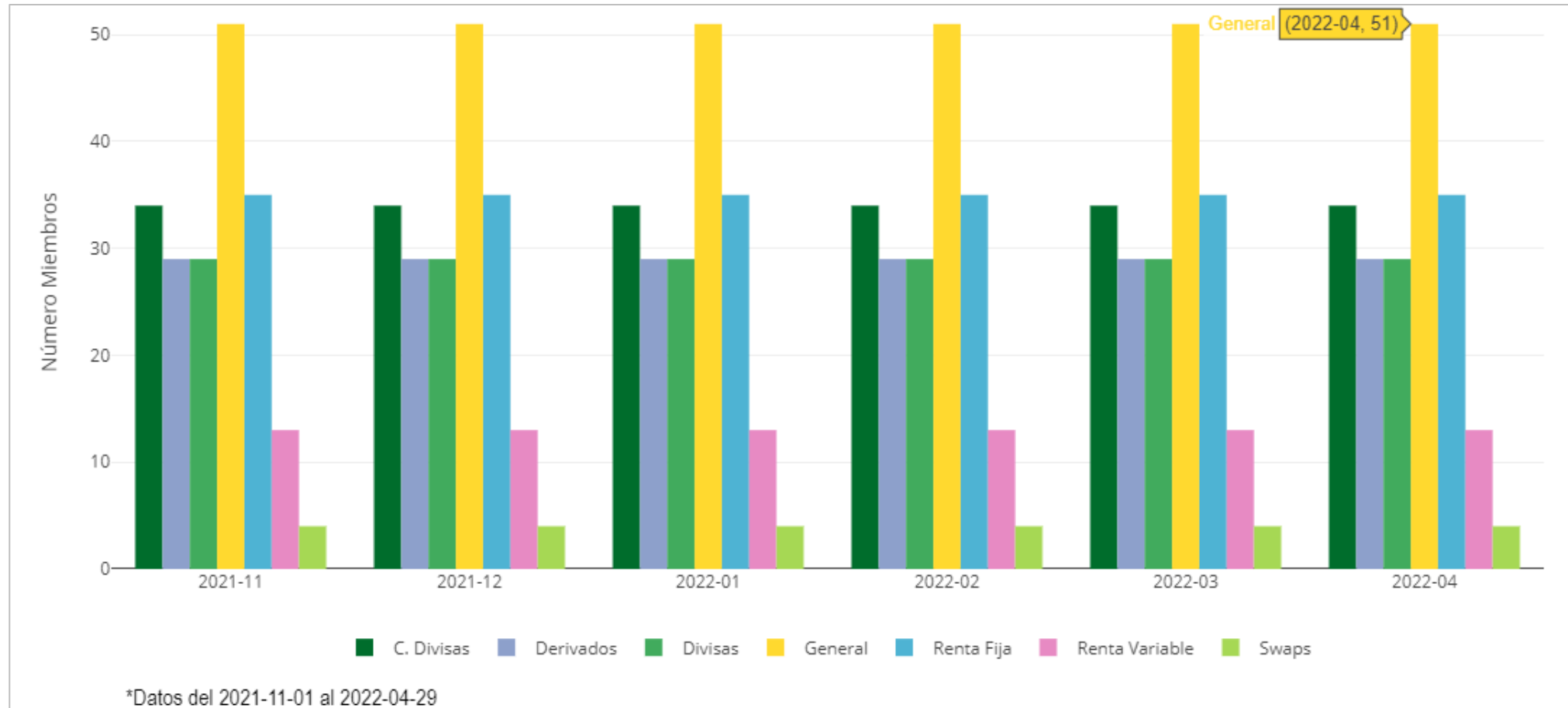


# Evolución de Mercado

---

Abril 2022



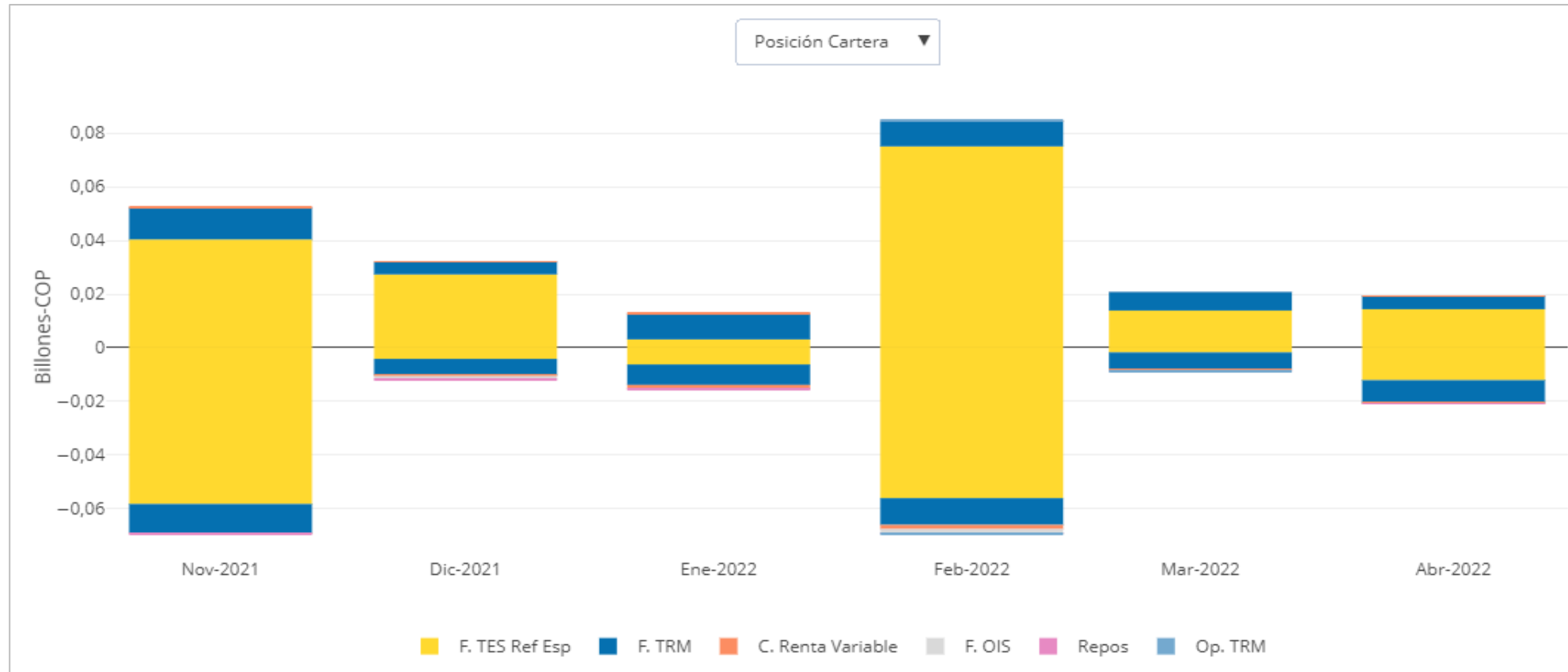
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$14,080,584	\$15,246,330	\$289,680,274	\$14,526,418	\$1,772,223,048
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	38.66%	\$5,443,810	\$5,976,952	\$113,562,093	\$5,524,611	\$674,002,588
Renta Fija	TES	Simultaneas	36.12%	\$5,085,431	\$5,435,293	\$103,270,562	\$5,143,644	\$627,524,624
Derivados	TRM	NDF FX FWD	17.11%	\$2,409,713	\$2,287,201	\$43,456,822	\$2,071,350	\$252,704,680
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	5.50%	\$774,158	\$734,809	\$13,961,376	\$763,287	\$93,121,043
Derivados	TRM	F. TRM	1.21%	\$169,958	\$269,308	\$5,116,847	\$351,198	\$42,846,152
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.66%	\$93,281	\$93,213	\$1,771,047	\$92,905	\$11,334,363
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.64%	\$90,662	\$145,713	\$2,768,546	\$137,273	\$16,747,343
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.04%	\$5,670	\$17,647	\$335,286	\$15,350	\$1,872,713

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	F. TES	F. TES Ref Esp	0.03%	\$4,602	\$75,102	\$1,426,933	\$105,595	\$12,882,607
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$1,679	\$2,239	\$42,537	\$3,659	\$446,423
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.01%	\$1,576	\$370	\$7,026	\$828	\$101,067
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$44	\$195	\$3,700	\$962	\$117,414
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$0	\$466	\$8,848	\$1,519	\$185,262
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$4	\$79	\$25	\$3,040
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$2,260	\$42,942	\$935	\$114,021
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$198,464	\$3,770,824	\$289,449	\$35,312,809
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$200	\$3,808	\$1,111	\$135,486

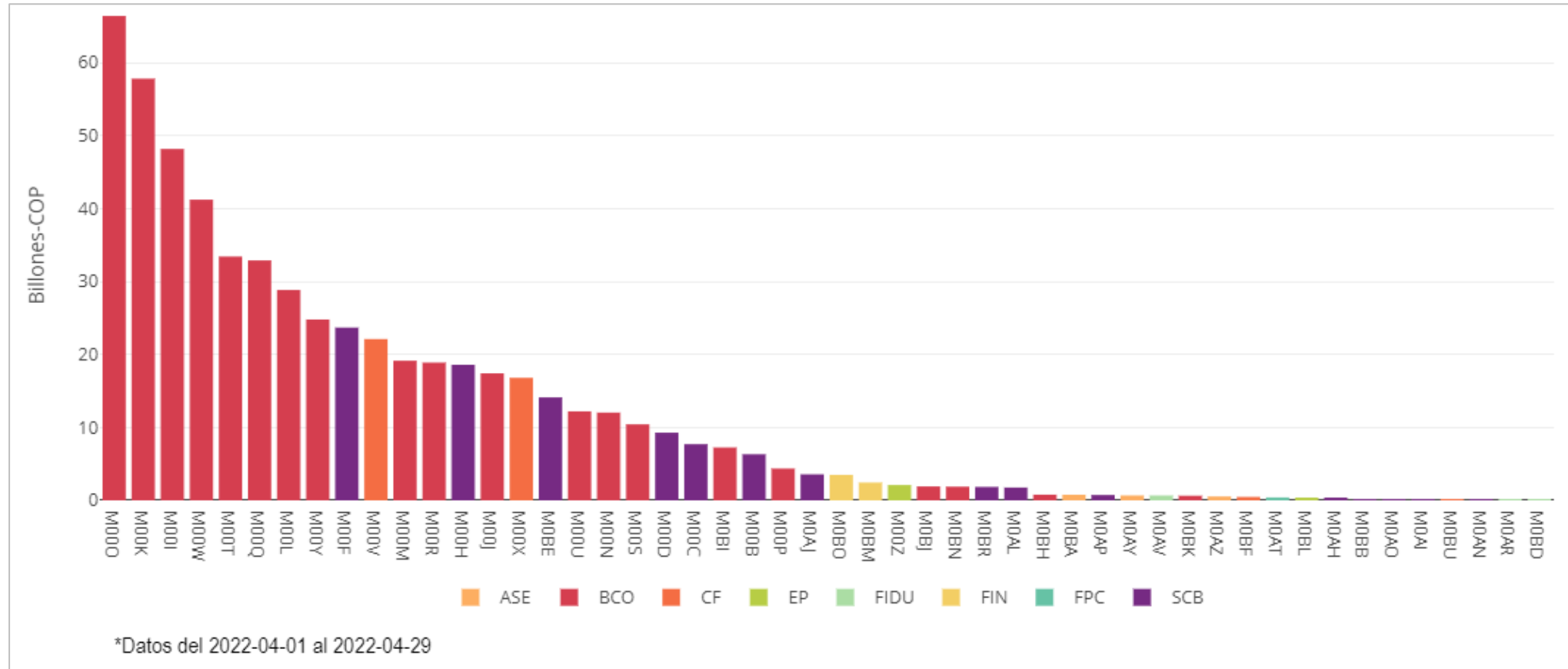
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$0	\$2,868	\$54,498	\$8,974	\$1,094,797
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$140	\$17,116
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$4,026	\$76,500	\$13,602	\$1,659,500









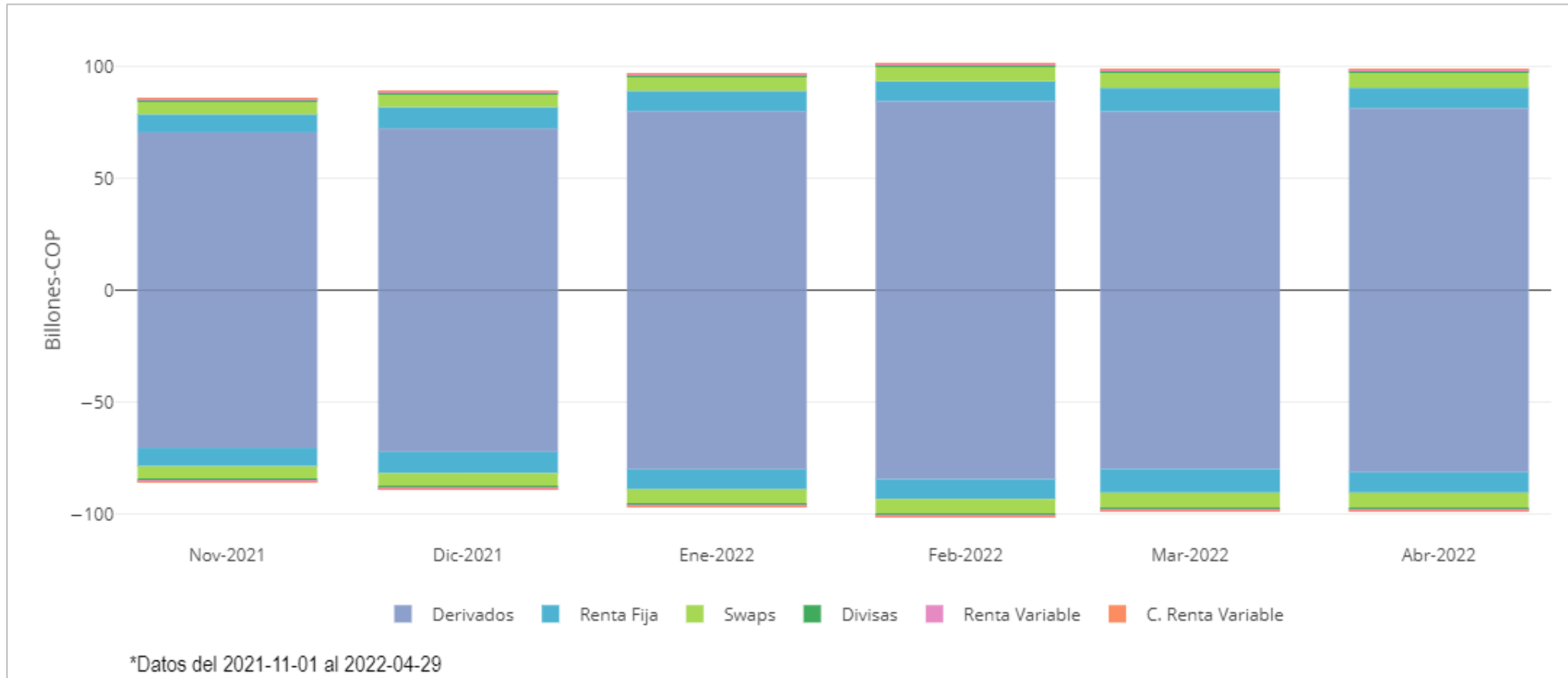




Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$102,953,403	\$102,953,403	\$98,803,213	\$98,803,213	\$95,010,700	\$95,010,698
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$47,818,763	\$47,818,763	\$44,694,547	\$44,694,547	\$41,933,346	\$41,933,346
Derivados	OIS	OIS IBR	\$22,089,145	\$22,089,145	\$24,097,602	\$24,097,602	\$24,170,678	\$24,170,678
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$12,450,132	\$12,450,132	\$9,114,216	\$9,114,216	\$9,219,689	\$9,219,689
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$7,034,000	\$7,034,000	\$7,013,421	\$7,013,421	\$6,434,820	\$6,434,820
Derivados	TRM	F. TRM	\$4,738,673	\$4,738,673	\$4,583,960	\$4,583,960	\$4,033,649	\$4,033,649
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	\$4,605,519	\$4,605,519	\$4,729,722	\$4,729,722	\$4,740,015	\$4,740,015
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	\$2,240,052	\$2,240,052	\$2,373,723	\$2,373,723	\$1,944,597	\$1,944,597
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	\$723,136	\$723,136	\$663,059	\$663,059	\$659,166	\$659,166

Segmento	Tipo Producto	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
Derivados	OIS	F. OIS	\$635,152	\$635,152	\$667,611	\$667,611	\$1,024,641	\$1,024,641
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$429,208	\$429,208	\$533,306	\$533,306	\$511,877	\$511,877
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$131,786	\$131,786	\$250,082	\$250,082	\$230,001	\$229,999
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$19,966	\$19,966	\$41,653	\$41,653	\$32,228	\$32,228
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$13,043	\$13,043	\$12,456	\$12,456	\$16,658	\$16,658
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$12,412	\$12,412	\$12,209	\$12,209	\$26,758	\$26,758
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$5,340	\$5,340	\$5,900	\$5,900	\$11,931	\$11,931
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$4,472	\$4,472	\$4,326	\$4,326	\$8,986	\$8,986
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,604	\$2,604	\$2,749	\$2,749	\$2,650	\$2,650

Segmento	Tipo Producto	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
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$0	\$0	\$2,672	\$2,672	\$8,869	\$8,869
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	\$0	\$0	\$0	\$0	\$140	\$140



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	\$1,030,500	\$1,001,763	\$770,209
1Y-2Y	\$2,254,000	\$2,236,789	\$2,070,008
2Y-5Y	\$2,875,500	\$2,906,342	\$2,737,639
5Y-10Y	\$874,000	\$868,526	\$856,963
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



# croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte