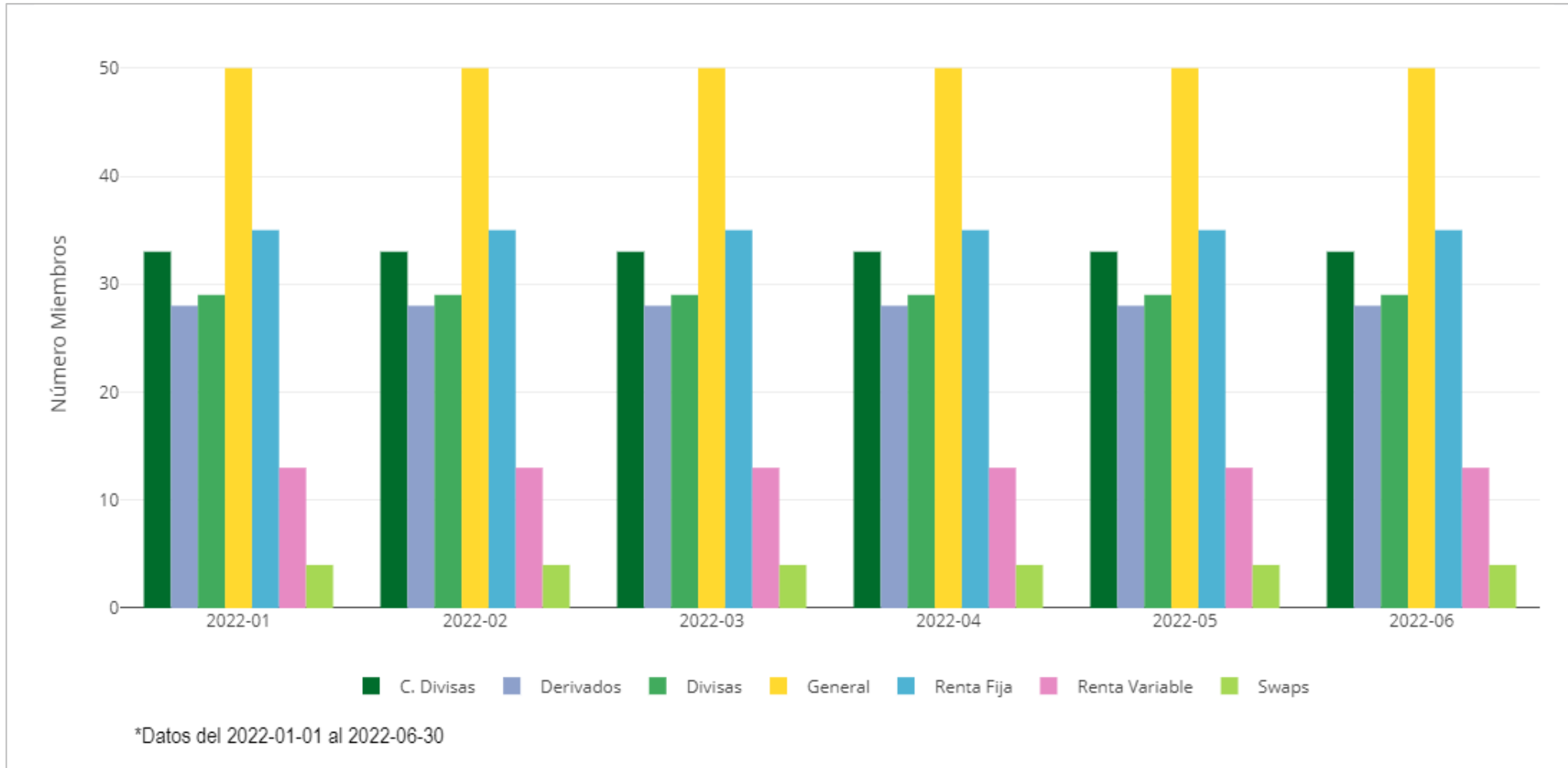


Evolución de Mercado

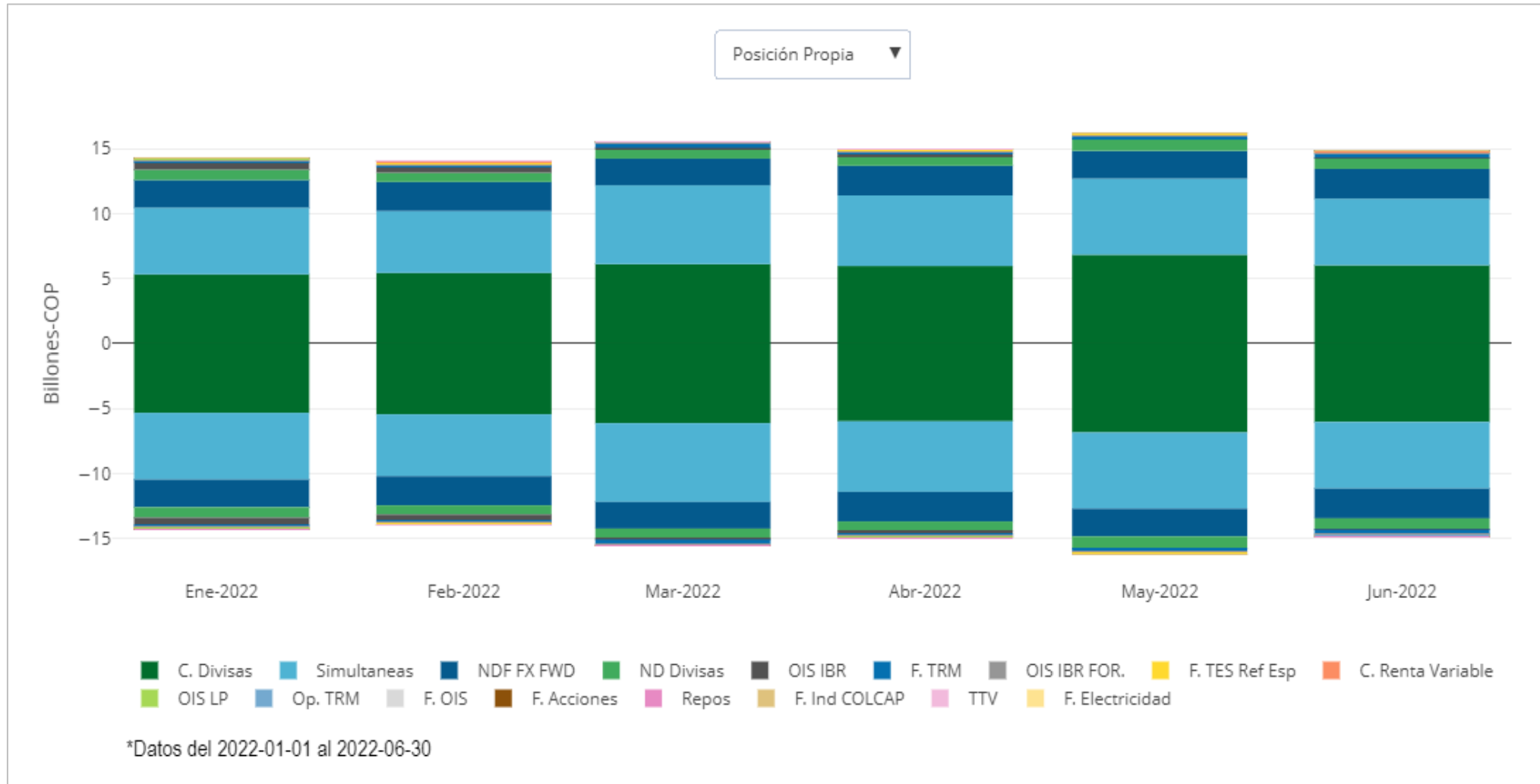
Junio 2022

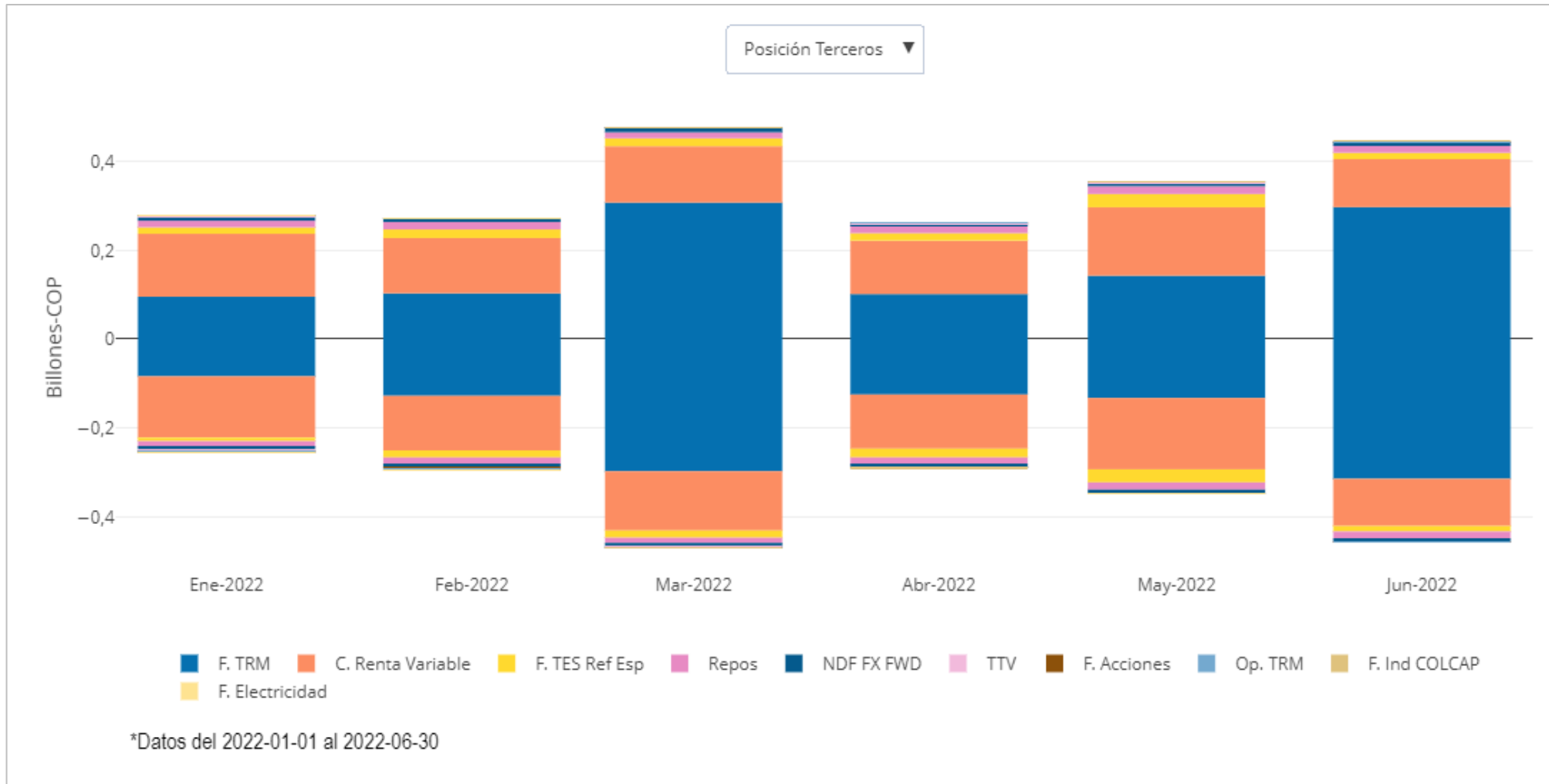


Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$19,322,247	\$15,308,303	\$306,166,051	\$15,411,453	\$1,880,197,231
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	42.88%	\$8,285,872	\$6,036,560	\$120,731,194	\$5,969,441	\$728,271,815
Renta Fija	TES	Simultaneas	35.45%	\$6,849,244	\$5,125,298	\$102,505,960	\$5,416,116	\$660,766,192
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.15%	\$2,347,994	\$2,295,462	\$45,909,233	\$2,191,535	\$267,367,293
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	6.06%	\$1,171,508	\$808,620	\$16,172,392	\$776,648	\$94,751,075
Derivados	TRM	F. TRM	2.06%	\$398,095	\$661,665	\$13,233,305	\$409,744	\$49,988,731
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.61%	\$118,822	\$127,588	\$2,551,755	\$155,382	\$18,956,579
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.52%	\$100,202	\$97,453	\$1,949,051	\$93,818	\$11,445,842
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.12%	\$22,325	\$56,337	\$1,126,744	\$125,306	\$15,287,274

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
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.07%	\$13,000	\$16,950	\$339,000	\$14,676	\$1,790,500
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.06%	\$11,019	\$16,797	\$335,949	\$16,223	\$1,979,201
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.01%	\$2,758	\$5,513	\$110,259	\$10,830	\$1,321,239
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$772	\$822	\$16,440	\$1,930	\$235,409
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$637	\$1,848	\$36,951	\$1,181	\$144,084
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$1,090	\$21,791	\$737	\$89,938
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$26	\$3,207
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$130	\$2,593	\$586	\$71,493
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$1,495	\$182,368

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	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$51,320	\$1,026,410	\$223,339	\$27,247,309
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$4,838	\$96,758	\$2,298	\$280,297
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$13	\$268	\$142	\$17,384



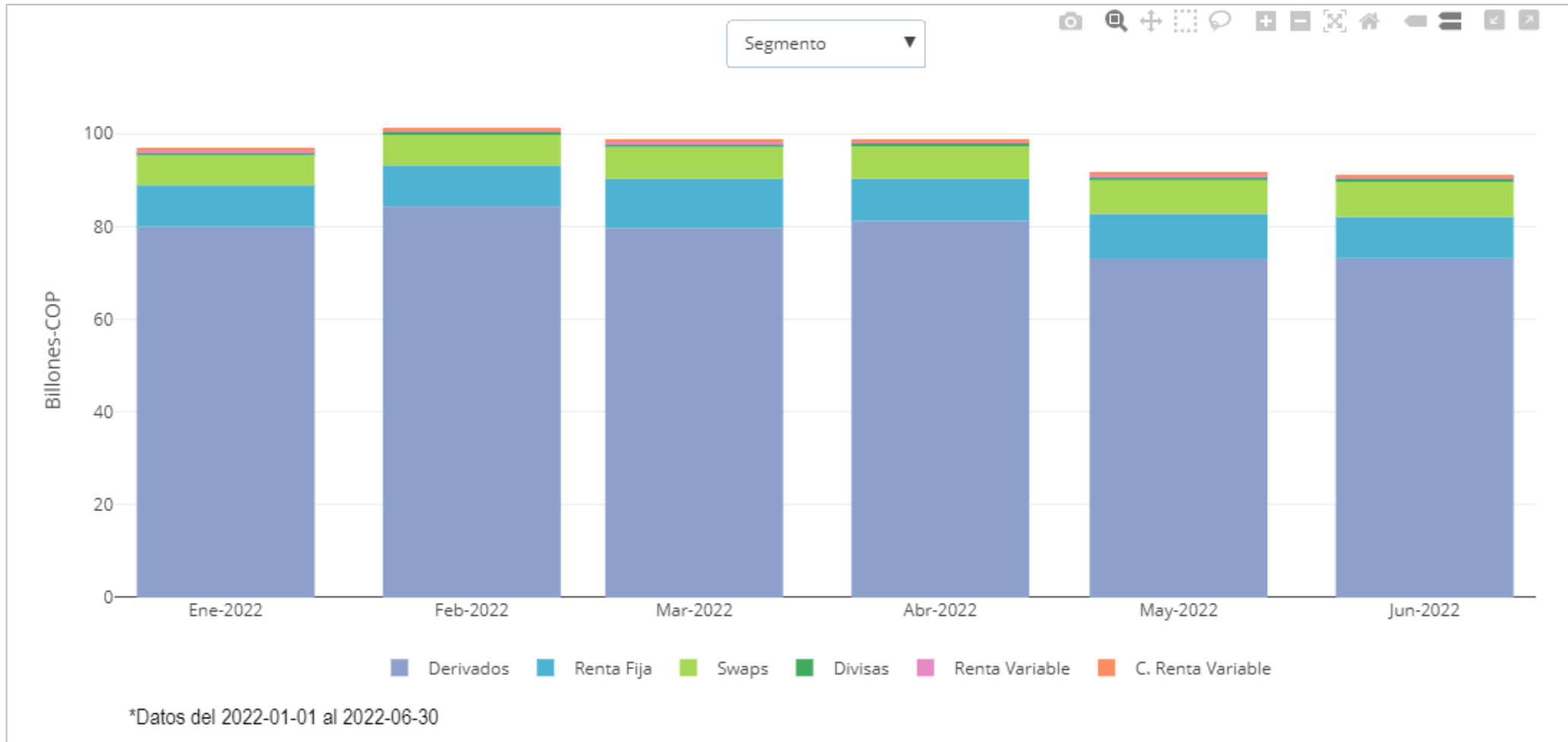




Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	OIS	F. OIS	\$676,146	\$676,146	\$677,828	\$677,828	\$836,656	\$836,656
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$449,704	\$449,704	\$470,883	\$470,883	\$493,585	\$493,585
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$234,514	\$234,514	\$274,434	\$274,434	\$261,652	\$261,650
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$17,982	\$17,982	\$12,585	\$12,585	\$19,327	\$19,327
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$10,131	\$10,131	\$18,571	\$18,571	\$26,835	\$26,835
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$8,020	\$8,020	\$10,044	\$10,044	\$12,633	\$12,633
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,516	\$2,516	\$2,550	\$2,550	\$2,776	\$2,776
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$2,496	\$2,496	\$4,495	\$4,495	\$9,694	\$9,694
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$1,069	\$1,069	\$1,469	\$1,469	\$6,690	\$6,690

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 T1	\$756,266	\$756,266	\$782,514	\$782,514	\$665,360	\$665,360
Derivados	OIS	F. OIS	\$694,914	\$694,914	\$688,988	\$688,988	\$921,482	\$921,482
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$478,857	\$478,857	\$462,754	\$462,754	\$500,379	\$500,379
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$203,285	\$203,285	\$18,409	\$18,409	\$11,644	\$11,644
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$60,203	\$60,203	\$20,563	\$20,563	\$27,841	\$27,841
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$11,208	\$11,208	\$10,656	\$10,656	\$22,905	\$22,905
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$11,094	\$11,094	\$11,172	\$11,172	\$14,557	\$14,557
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$3,511	\$3,511	\$2,060	\$2,060	\$6,497	\$6,497
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,629	\$2,629	\$2,552	\$2,552	\$2,710	\$2,710

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
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$890	\$890	\$1,884	\$1,884	\$3,501	\$3,501
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	\$0	\$0	\$13	\$13	\$142	\$142



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	\$1,186,500	\$1,161,150	\$902,910
1Y-2Y	\$2,547,000	\$2,448,600	\$2,258,955
2Y-5Y	\$2,890,500	\$2,876,450	\$2,850,996
5Y-10Y	\$1,035,000	\$1,013,700	\$921,820
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte