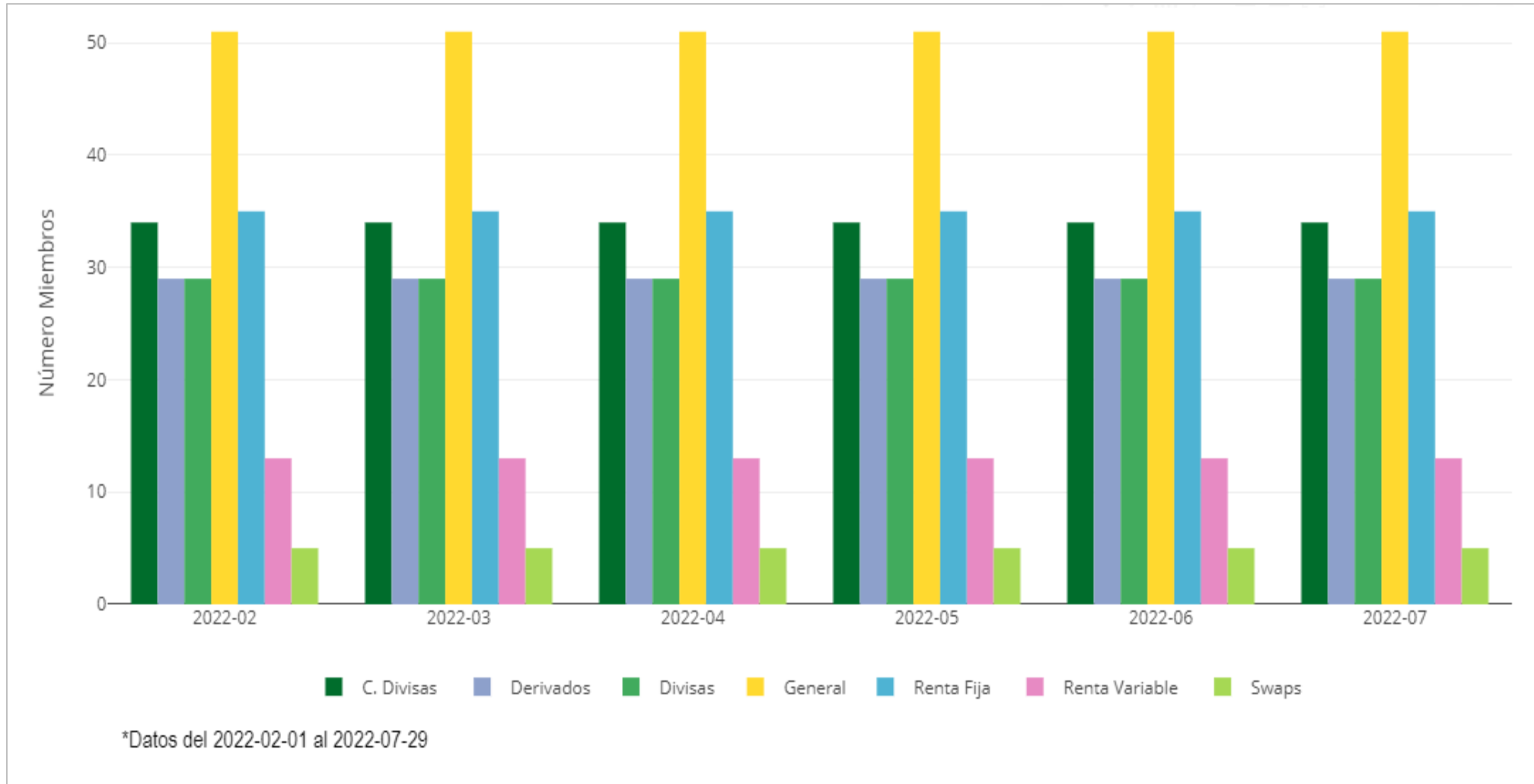


# Evolución de Mercado

---

Julio 2022

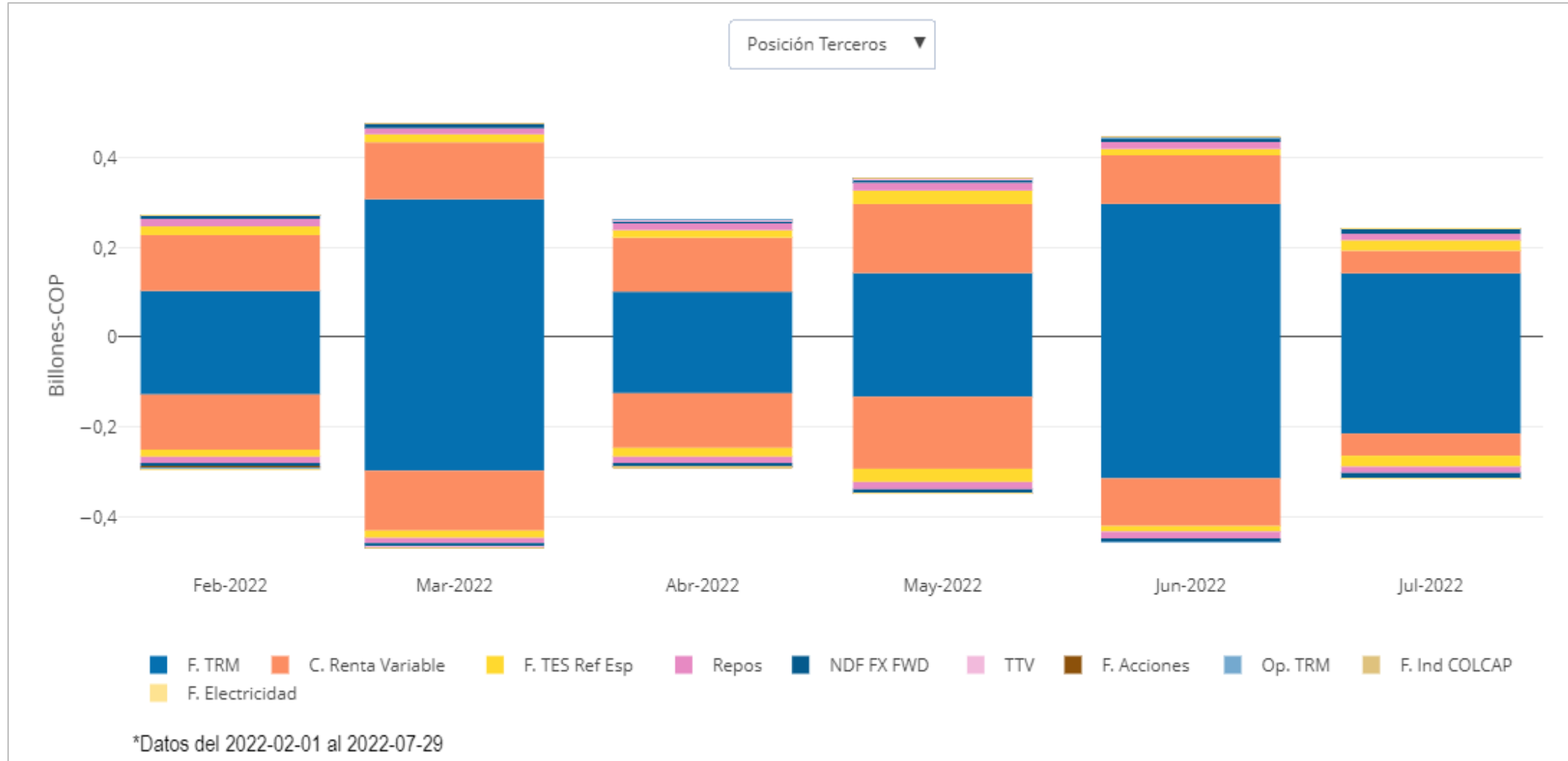


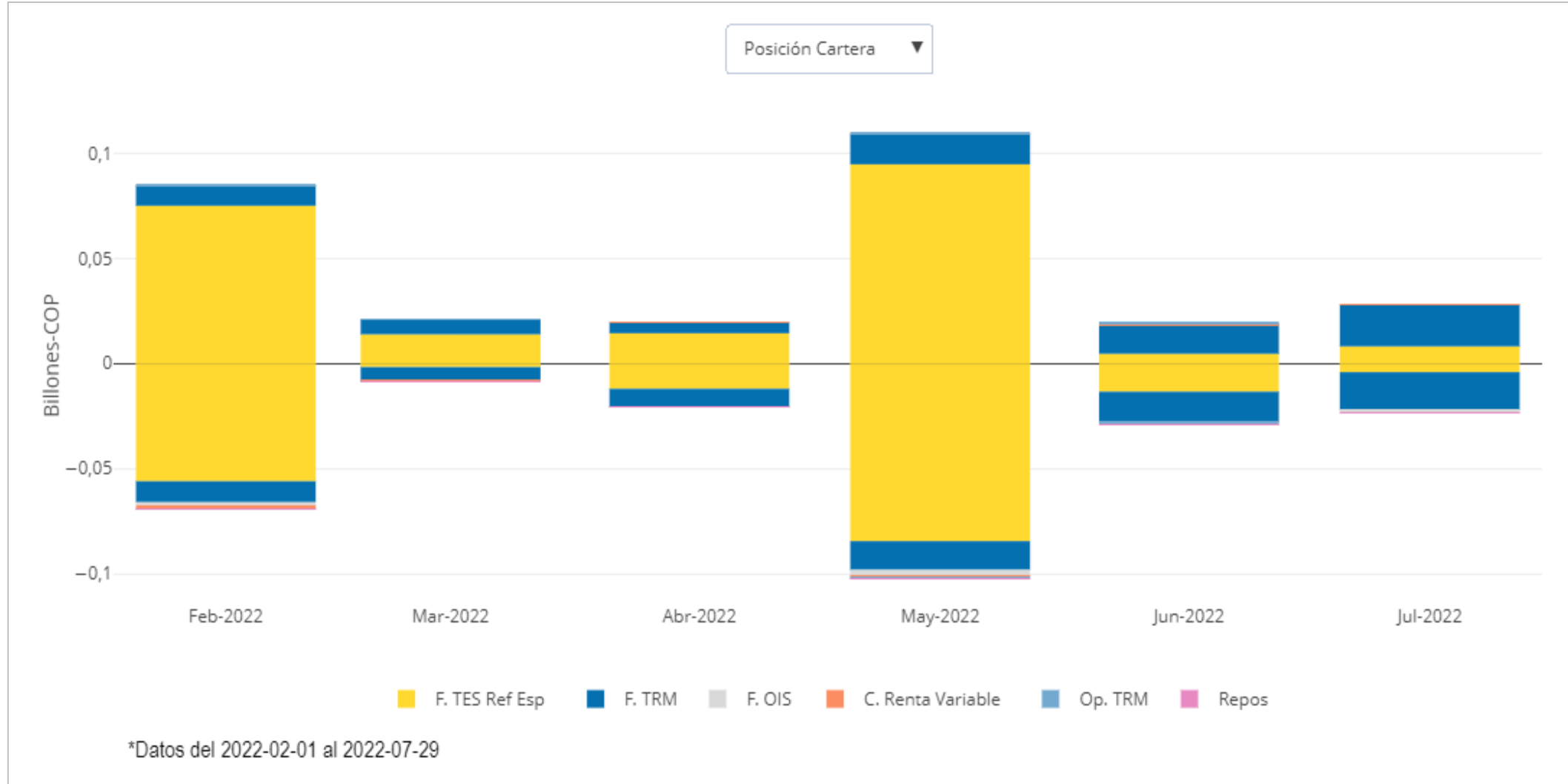
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$19,281,366	\$17,264,208	\$328,019,955	\$15,843,292	\$1,917,038,353
Renta Fija	TES	Simultaneas	40.69%	\$7,844,788	\$6,883,608	\$130,788,552	\$5,691,712	\$688,697,181
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	38.39%	\$7,401,723	\$6,201,691	\$117,832,125	\$6,111,324	\$739,470,161
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.70%	\$2,448,373	\$2,648,239	\$50,316,532	\$2,272,864	\$275,016,505
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.50%	\$867,657	\$749,101	\$14,232,922	\$769,998	\$93,169,711
Derivados	TRM	F. TRM	1.32%	\$253,928	\$432,220	\$8,212,185	\$442,712	\$53,568,206
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	1.06%	\$204,171	\$63,362	\$1,203,882	\$127,702	\$15,451,999
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.52%	\$100,445	\$100,393	\$1,907,468	\$95,022	\$11,497,698
Derivados	OIS	OIS IBR	0.40%	\$77,395	\$80,061	\$1,521,155	\$146,746	\$17,756,206

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
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.35%	\$67,338	\$61,415	\$1,166,882	\$138,564	\$16,766,301
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.08%	\$15,100	\$14,937	\$283,807	\$16,251	\$1,966,338
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$349	\$623	\$11,833	\$1,061	\$128,369
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$99	\$115	\$2,191	\$501	\$60,588
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$72	\$1,376	\$590	\$71,444
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$72	\$1,372	\$23	\$2,802
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$1,160	\$22,042	\$1,689	\$204,410
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$60	\$1,134	\$1,958	\$236,976
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$0	\$1,245	\$23,647	\$9,806	\$1,186,484

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 T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$144	\$17,384
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$834	\$15,850	\$1,447	\$175,090
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$25,000	\$475,000	\$13,178	\$1,594,500









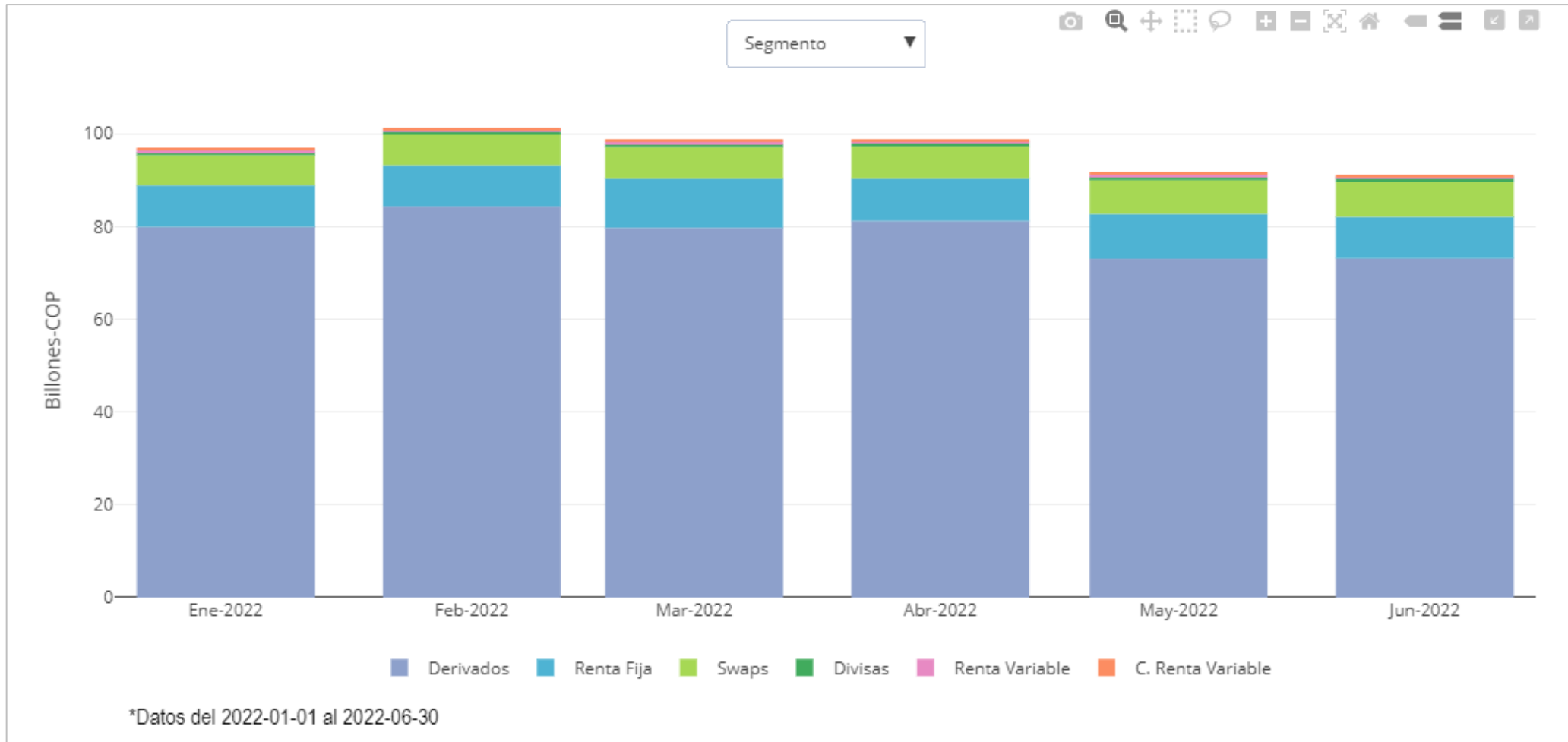




Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$100,657,670	\$96,910,507	\$96,190,275
Derivados	TRM	NDF FX FWD	52.77%	\$53,113,018	\$52,009,448	\$45,277,252
Renta Fija	TES	Simultaneas	12.91%	\$12,991,413	\$10,612,062	\$9,657,033
Derivados	OIS	OIS IBR	11.58%	\$11,658,350	\$12,082,892	\$20,177,638
Swaps	OIS LP	OIS LP	7.93%	\$7,979,000	\$7,714,053	\$7,008,975
Derivados	TRM	F. TRM	6.32%	\$6,361,962	\$5,957,332	\$4,888,571
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	4.84%	\$4,871,510	\$4,765,621	\$4,764,014
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	1.87%	\$1,886,565	\$1,901,000	\$2,190,241
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	0.70%	\$700,923	\$640,662	\$672,675

Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	OIS	F. OIS	0.55%	\$557,587	\$662,966	\$760,416
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.41%	\$408,584	\$419,546	\$487,868
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.09%	\$90,300	\$102,990	\$233,496
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.01%	\$14,630	\$15,340	\$16,503
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.01%	\$9,838	\$11,670	\$26,242
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.01%	\$8,090	\$8,259	\$10,706
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$3,805	\$2,979	\$2,852
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$1,342	\$1,122	\$4,357
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$750	\$1,342	\$2,635

Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$0	\$1,223	\$8,657
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$144



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	\$1,428,500	\$1,314,447	\$1,000,616
1Y-2Y	\$2,473,000	\$2,391,158	\$2,176,835
2Y-5Y	\$3,025,500	\$2,971,500	\$2,884,607
5Y-10Y	\$1,052,000	\$1,036,947	\$946,917
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



# croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte