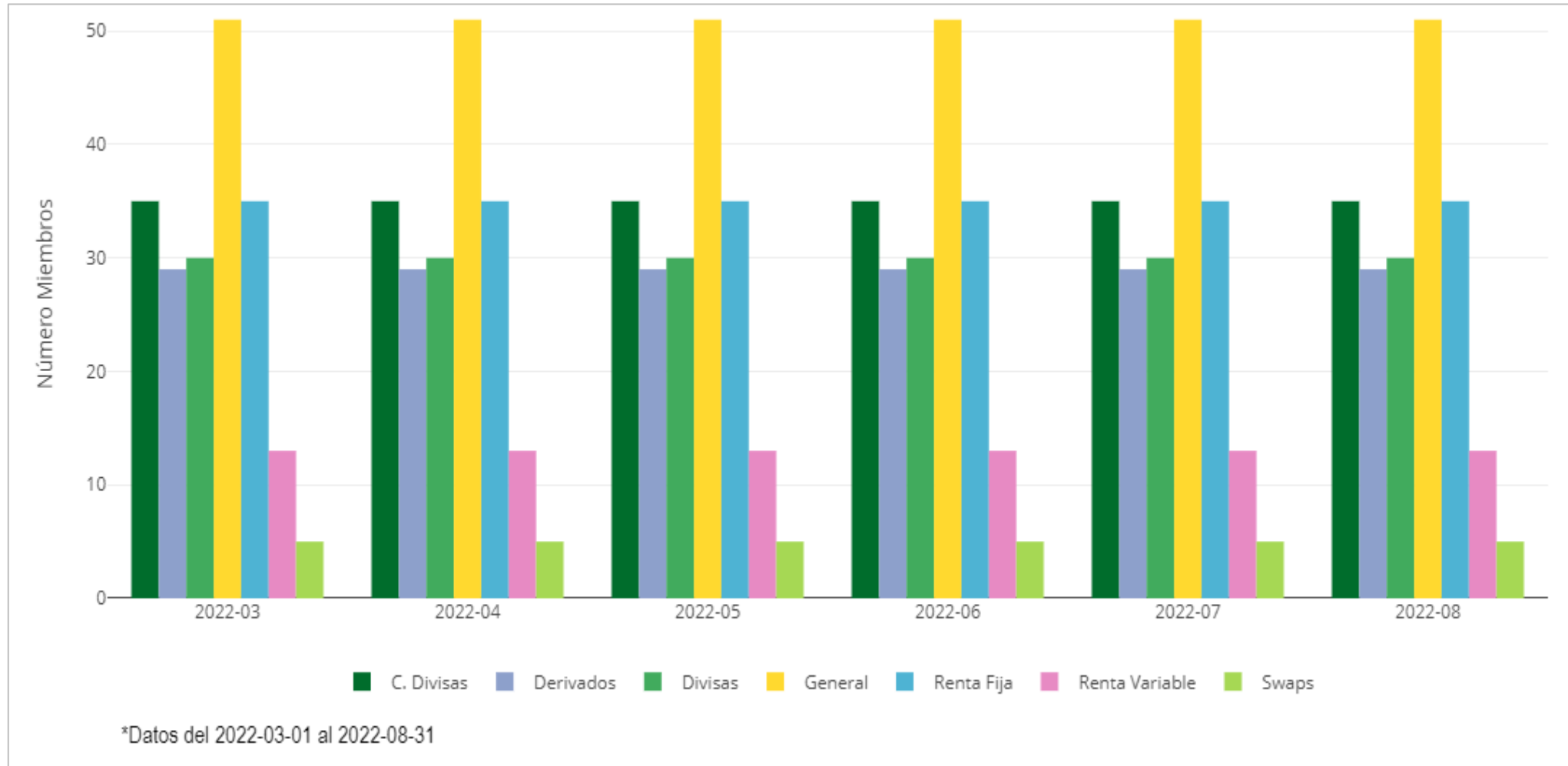


# Evolución de Mercado

---

Agosto 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% | \$18,529,282             | \$15,359,326                             | \$337,905,164                      | \$15,993,950                          | \$1,967,255,824                 |
| Renta Fija        | TES               | Simultaneas       | 40.19%  | \$7,447,599              | \$5,679,680                              | \$124,952,962                      | \$5,839,842                           | \$718,300,523                   |
| C. Divisas        | C. Divisas        | C. Divisas        | 21.34%  | \$3,954,373              | \$5,138,676                              | \$113,050,881                      | \$6,045,829                           | \$743,636,931                   |
| Derivados         | TRM               | NDF FX FWD        | 19.15%  | \$3,547,564              | \$2,227,494                              | \$49,004,871                       | \$2,268,335                           | \$279,005,238                   |
| Derivados         | TRM               | F. TRM            | 10.80%  | \$2,001,762              | \$856,725                                | \$18,847,946                       | \$543,622                             | \$66,865,460                    |
| Renta Fija        | TES               | TTV DP            | 2.89%   | \$536,093                | \$261,799                                | \$5,759,585                        | \$46,826                              | \$5,759,585                     |
| Divisas           | ND Divisas        | Divisas T1        | 2.57%   | \$476,938                | \$662,447                                | \$14,573,836                       | \$761,803                             | \$93,701,780                    |
| C. Renta Variable | C. Renta Variable | C. Renta Variable | 1.29%   | \$238,346                | \$75,954                                 | \$1,670,988                        | \$124,769                             | \$15,346,630                    |
| Derivados         | F. TES            | F. TES Ref Esp    | 1.12%   | \$208,157                | \$209,582                                | \$4,610,793                        | \$126,403                             | \$15,547,611                    |

Registros del 1 al 9 de un total de 22

Anterior  2 3 Siguiete

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31

| 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 FOR.    | 0.54% | \$100,531                | \$100,485                                | \$2,210,674                        | \$96,333                              | \$11,848,963                    |
| Divisas        | ND Divisas        | Divisas T2      | 0.06% | \$11,911                 | \$21,600                                 | \$475,191                          | \$12,886                              | \$1,584,988                     |
| Renta Variable | Repos y TTV       | Repos           | 0.03% | \$4,658                  | \$12,987                                 | \$285,713                          | \$15,586                              | \$1,917,106                     |
| Derivados      | F. Renta Variable | F. acc liq ent  | 0.00% | \$857                    | \$662                                    | \$14,570                           | \$1,002                               | \$123,196                       |
| Derivados      | F. Renta Variable | F. acc liq dif  | 0.00% | \$492                    | \$143                                    | \$3,137                            | \$494                                 | \$60,777                        |
| Derivados      | F. Electricidad   | F. Electricidad | 0.00% | \$0                      | \$2                                      | \$45                               | \$15                                  | \$1,857                         |
| Derivados      | F. Renta Variable | F. ind COLCAP   | 0.00% | \$0                      | \$16                                     | \$361                              | \$323                                 | \$39,786                        |
| Derivados      | OIS               | F. OIS          | 0.00% | \$0                      | \$23                                     | \$504                              | \$1,421                               | \$174,827                       |
| Derivados      | OIS               | OIS IBR         | 0.00% | \$0                      | \$85,305                                 | \$1,876,707                        | \$88,946                              | \$10,940,401                    |

Registros del 10 al 18 de un total de 22

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

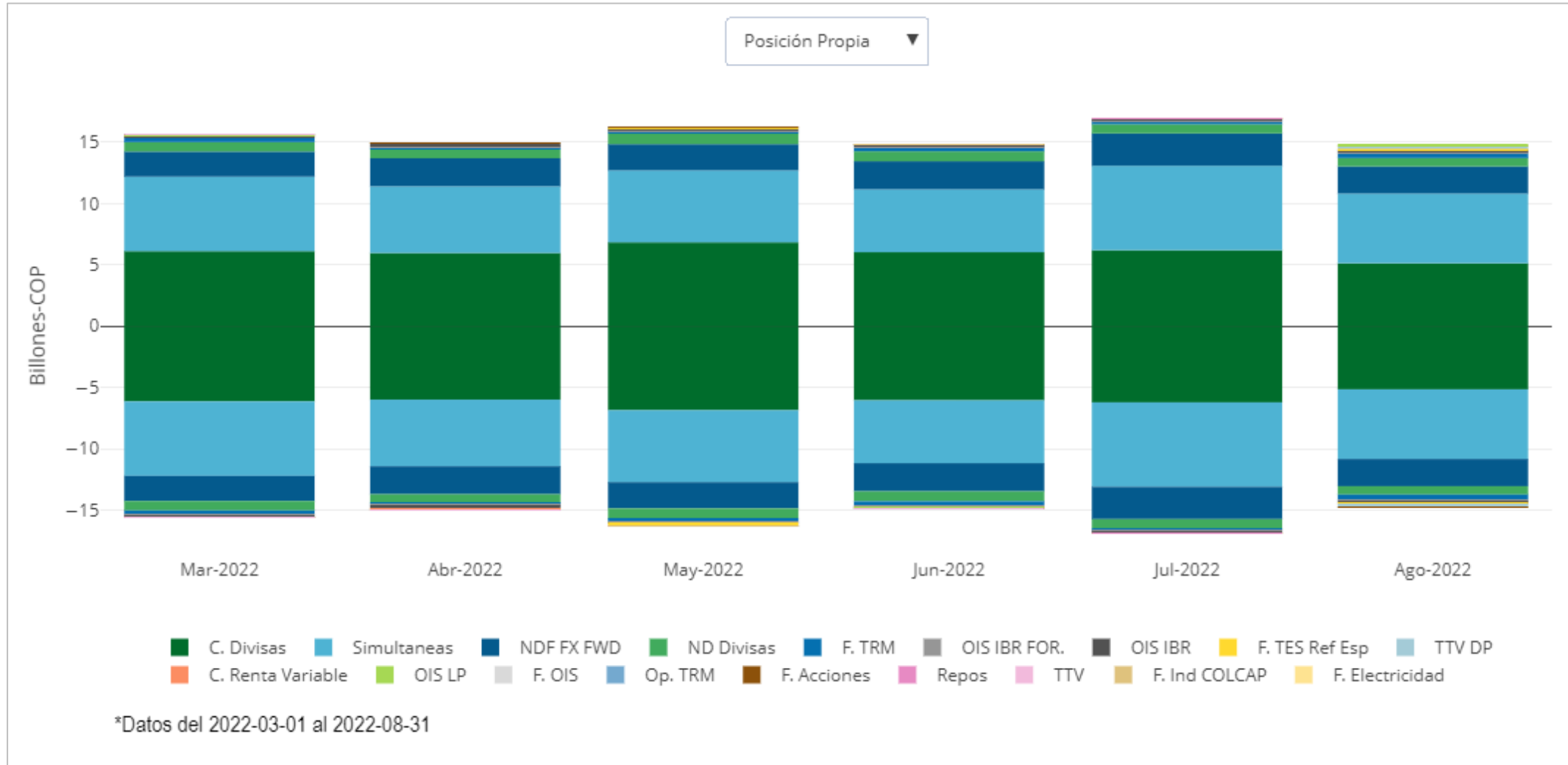
\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31

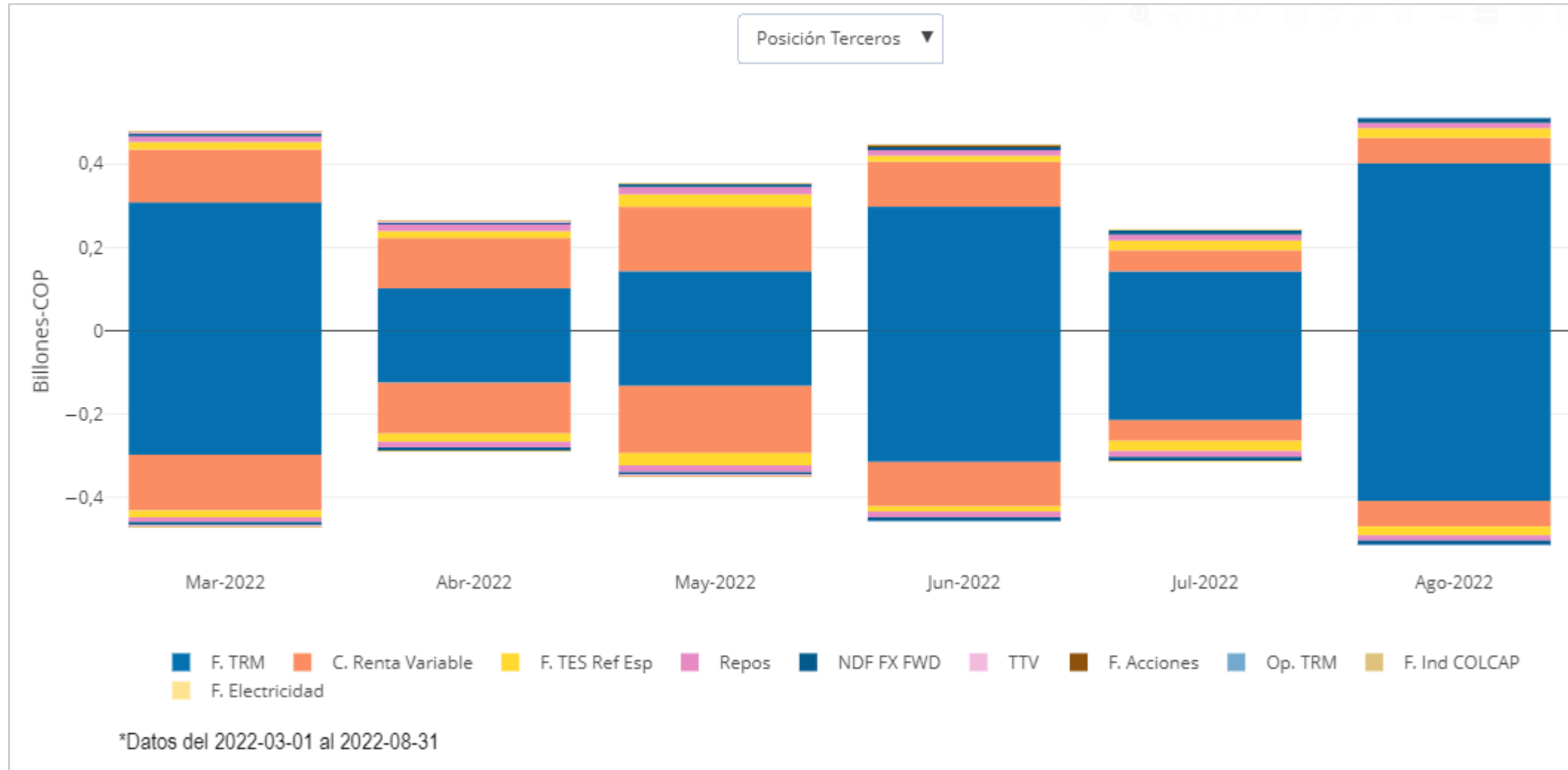
| Segmento       | Tipo Producto | Producto   | %     | Volumen Último Día M-COP | Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP | Volumen Acumulado Último Mes M-COP | Volumen Promedio Diario Periodo M-COP | Volumen Acumulado Periodo M-COP |
|----------------|---------------|------------|-------|--------------------------|--|------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------|
| Derivados      | TRM           | Opcion TRM | 0.00% | \$0                      | \$255                                    | \$5,617                            | \$1,469                               | \$180,654                       |
| Divisas        | ND Divisas    | Divisas T3 | 0.00% | \$0                      | \$0                                      | \$0                                | \$141                                 | \$17,384                        |
| Renta Variable | Repos y TTV   | TTV        | 0.00% | \$0                      | \$786                                    | \$17,283                           | \$1,221                               | \$150,128                       |
| Swaps          | OIS LP        | OIS LP     | 0.00% | \$0                      | \$24,705                                 | \$543,500                          | \$16,683                              | \$2,052,000                     |

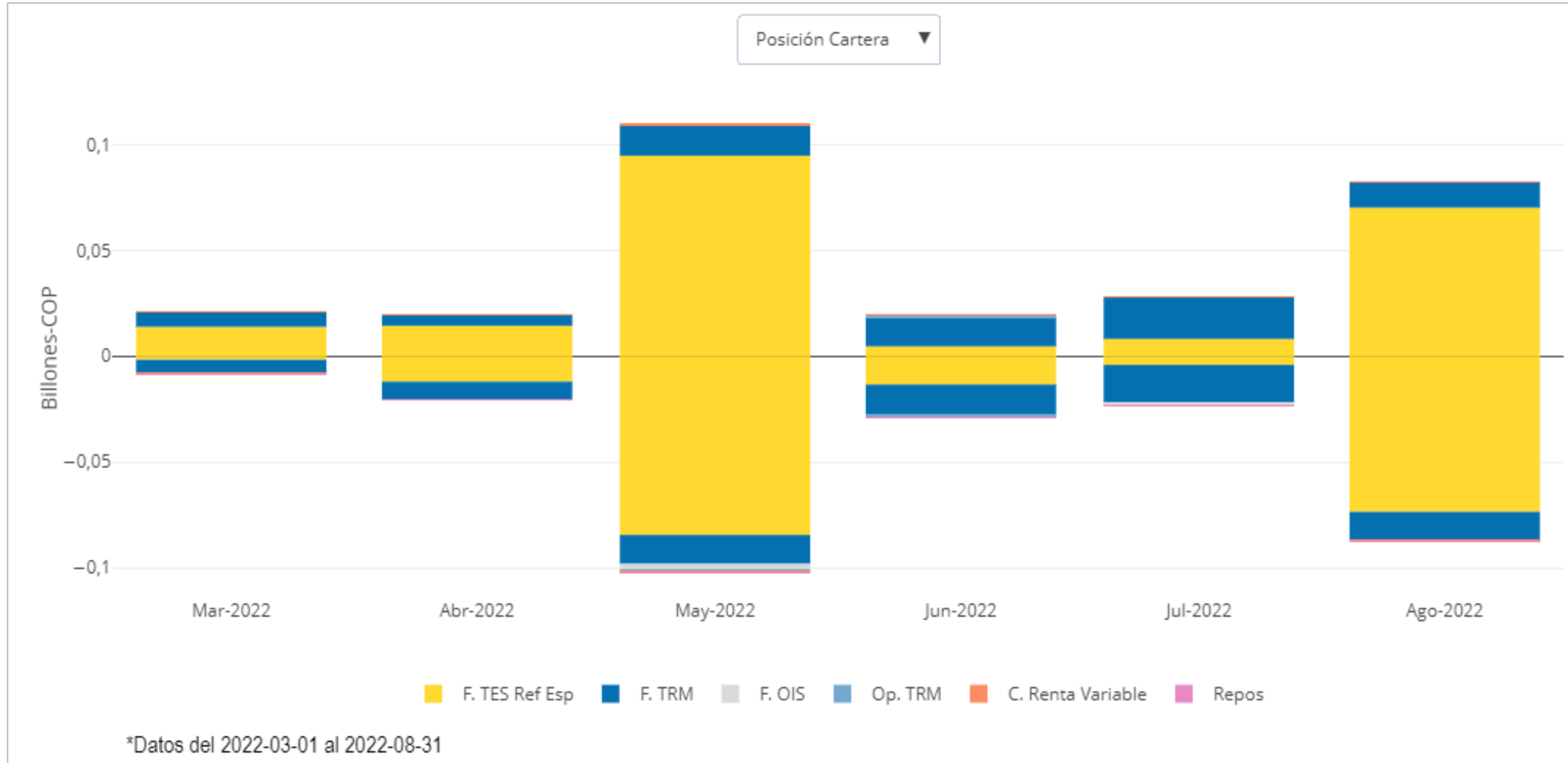
Registros del 19 al 22 de un total de 22

Anterior   1   2   **3**   Siguiente

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31



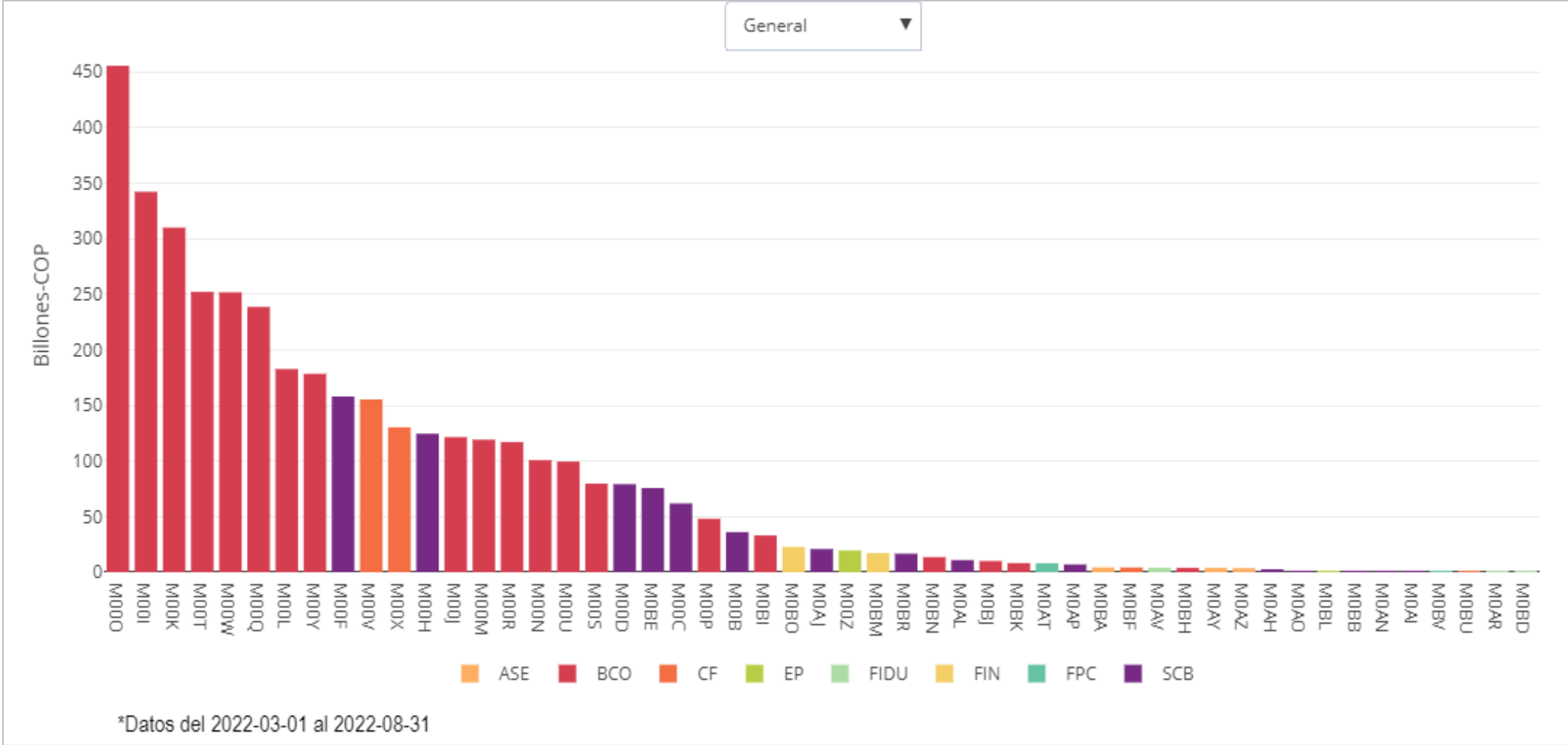








Ranking Miembros por Volumen Operado últimos seis meses



| 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% | \$100,452,508                     | \$92,751,309                                      | \$94,693,167                                   |
| Derivados   | TRM           | NDF FX FWD     | 50.20%  | \$50,429,816                      | \$48,460,415                                      | \$46,304,743                                   |
| Renta Fija  | TES           | Simultaneas    | 12.50%  | \$12,552,914                      | \$8,726,530                                       | \$9,623,308                                    |
| Derivados   | OIS           | OIS IBR        | 11.23%  | \$11,277,311                      | \$11,838,831                                      | \$17,192,283                                   |
| Derivados   | TRM           | F. TRM         | 8.42%   | \$8,459,970                       | \$6,588,280                                       | \$5,238,037                                    |
| Swaps       | OIS LP        | OIS LP         | 8.37%   | \$8,409,500                       | \$8,192,364                                       | \$7,212,699                                    |
| Derivados   | OIS           | OIS IBR FOR.   | 5.15%   | \$5,177,805                       | \$5,026,877                                       | \$4,799,175                                    |
| Derivados   | F. TES        | F. TES Ref Esp | 2.21%   | \$2,223,479                       | \$2,078,322                                       | \$2,205,194                                    |
| Renta Fija  | TES           | TTV DP         | 0.53%   | \$536,093                         | \$261,799   | \$46,826                                       |

Registros del 1 al 9 de un total de 21

Anterior 1 2 3 Siguiente

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31

| 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 |
|-------------------|-------------------|-------------------|-------|-----------------------------------|---|--|
| Renta Variable    | Repos y TTV       | Repos             | 0.40% | \$404,449                         | \$428,443   | \$475,277                                      |
| Divisas           | ND Divisas        | Divisas T1        | 0.39% | \$393,487                         | \$555,137   | \$664,864                                      |
| Derivados         | OIS               | F. OIS            | 0.30% | \$301,369                         | \$415,797   | \$651,662                                      |
| C. Renta Variable | C. Renta Variable | C. Renta Variable | 0.24% | \$245,287                         | \$118,784   | \$210,525                                      |
| Derivados         | TRM               | Opcion TRM        | 0.01% | \$13,293                          | \$11,020  | \$24,543                                       |
| Derivados         | F. Renta Variable | F. acc liq ent    | 0.01% | \$11,864                          | \$13,117  | \$13,684                                       |
| Derivados         | F. Renta Variable | F. acc liq dif    | 0.01% | \$8,764                           | \$8,591   | \$10,193                                       |
| Derivados         | F. Electricidad   | F. Electricidad   | 0.00% | \$3,804                           | \$3,743   | \$2,930  |
| Derivados         | F. Renta Variable | F. ind COLCAP     | 0.00% | \$1,294                           | \$1,315   | \$3,237  |

Registros del 10 al 18 de un total de 21

Anterior   1   **2**   3   Siguiente

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31



| 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% | \$1,129                           | \$19,908  | \$11,453                                       |
| Renta Variable | Repos y TTV   | TTV        | 0.00% | \$879                             | \$2,036   | \$2,392  |
| Divisas        | ND Divisas    | Divisas T3 | 0.00% | \$0                               | \$0   | \$141  |

Registros del 19 al 21 de un total de 21

Anterior   1   2   **3**   Siguiente

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31

| 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      | \$1,504,000                       | \$1,361,205                                       | \$1,013,317                                    |
| 1Y-2Y      | \$2,623,500                       | \$2,634,614                                       | \$2,286,776                                    |
| 2Y-5Y      | \$3,203,000                       | \$3,128,591                                       | \$2,936,760                                    |
| 5Y-10Y     | \$1,079,000                       | \$1,067,955                                       | \$975,846                                      |
| 10Y-15Y    | \$0                               | \$0   | \$0  |

\*Datos del 2022-03-01 al 2022-08-31





# croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte