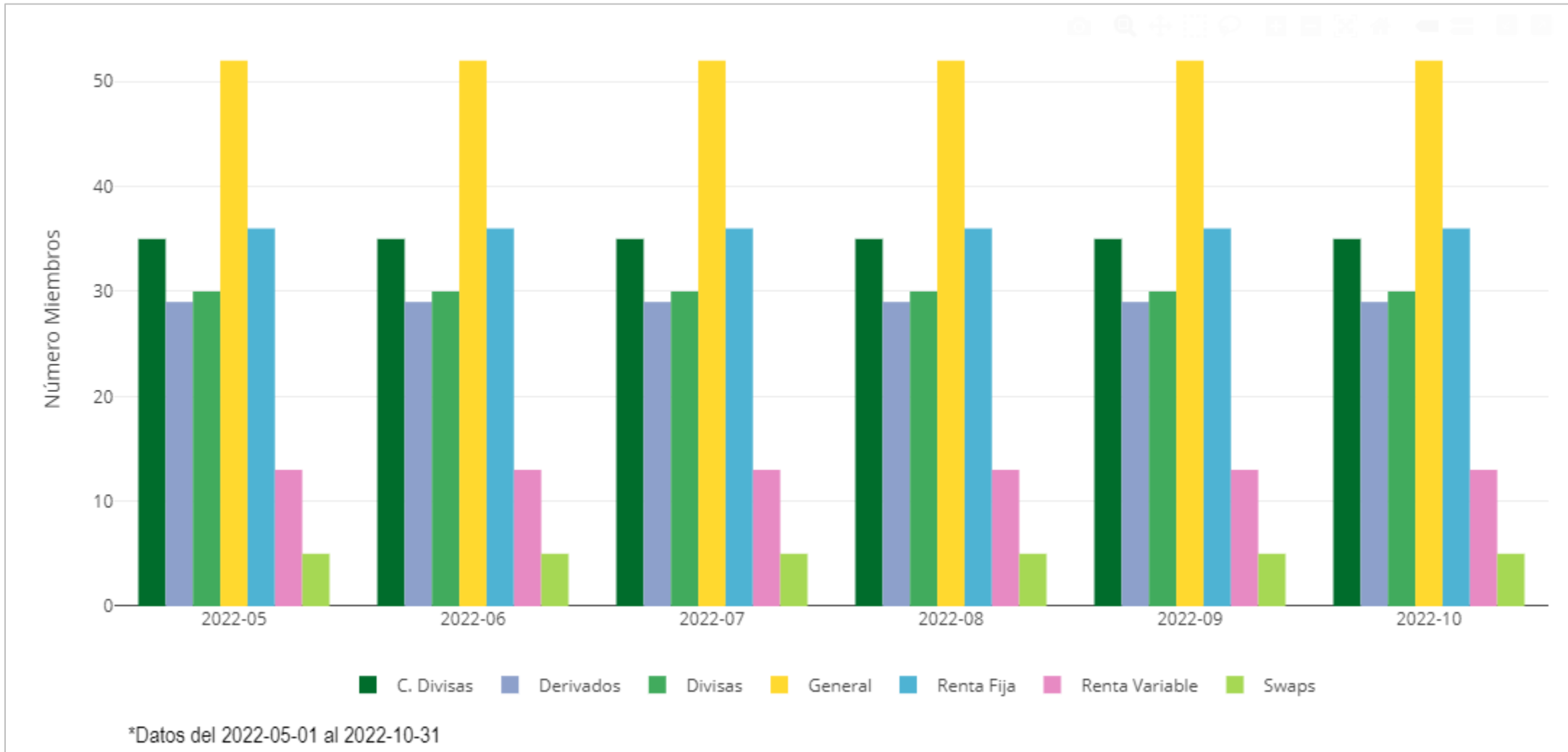


Evolución de Mercado

Octubre 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%	\$18,835,244	\$15,641,220	\$312,824,404	\$15,828,090	\$1,962,683,148
Renta Fija	TES	Simultaneas	45.19%	\$8,512,212	\$5,389,601	\$107,792,014	\$5,719,429	\$709,209,212
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	30.56%	\$5,755,659	\$6,209,982	\$124,199,644	\$5,945,834	\$737,283,451
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.61%	\$2,374,517	\$2,096,834	\$41,936,679	\$2,284,350	\$283,259,351
Renta Fija	TES	TTV DP	4.12%	\$776,149	\$375,153	\$7,503,069	\$153,483	\$19,031,872
Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.03%	\$758,941	\$829,738	\$16,594,753	\$773,138	\$95,869,087
Derivados	TRM	F. TRM	1.57%	\$295,073	\$403,574	\$8,071,477	\$518,220	\$64,259,279
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.78%	\$146,994	\$70,965	\$1,419,305	\$118,360	\$14,676,654
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.54%	\$100,874	\$100,849	\$2,016,980	\$98,869	\$12,259,731

Registros del 1 al 9 de un total de 22

Anterior 1 2 3 Siguiente

*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

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
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.36%	\$68,321	\$54,785	\$1,095,709	\$91,298	\$11,320,957
Derivados	OIS	F. OIS	0.13%	\$25,215	\$3,812	\$76,249	\$1,863	\$231,055
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.08%	\$14,455	\$13,663	\$273,264	\$14,702	\$1,822,988
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.04%	\$6,833	\$32,868	\$657,367	\$20,766	\$2,574,928
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$141	\$2,830	\$399	\$49,482
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$0	\$93	\$1,850	\$730	\$90,568
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$188	\$3,768	\$59	\$7,320
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$38	\$754	\$181	\$22,401
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$34,911	\$698,227	\$64,776	\$8,032,174

Registros del 10 al 18 de un total de 22

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

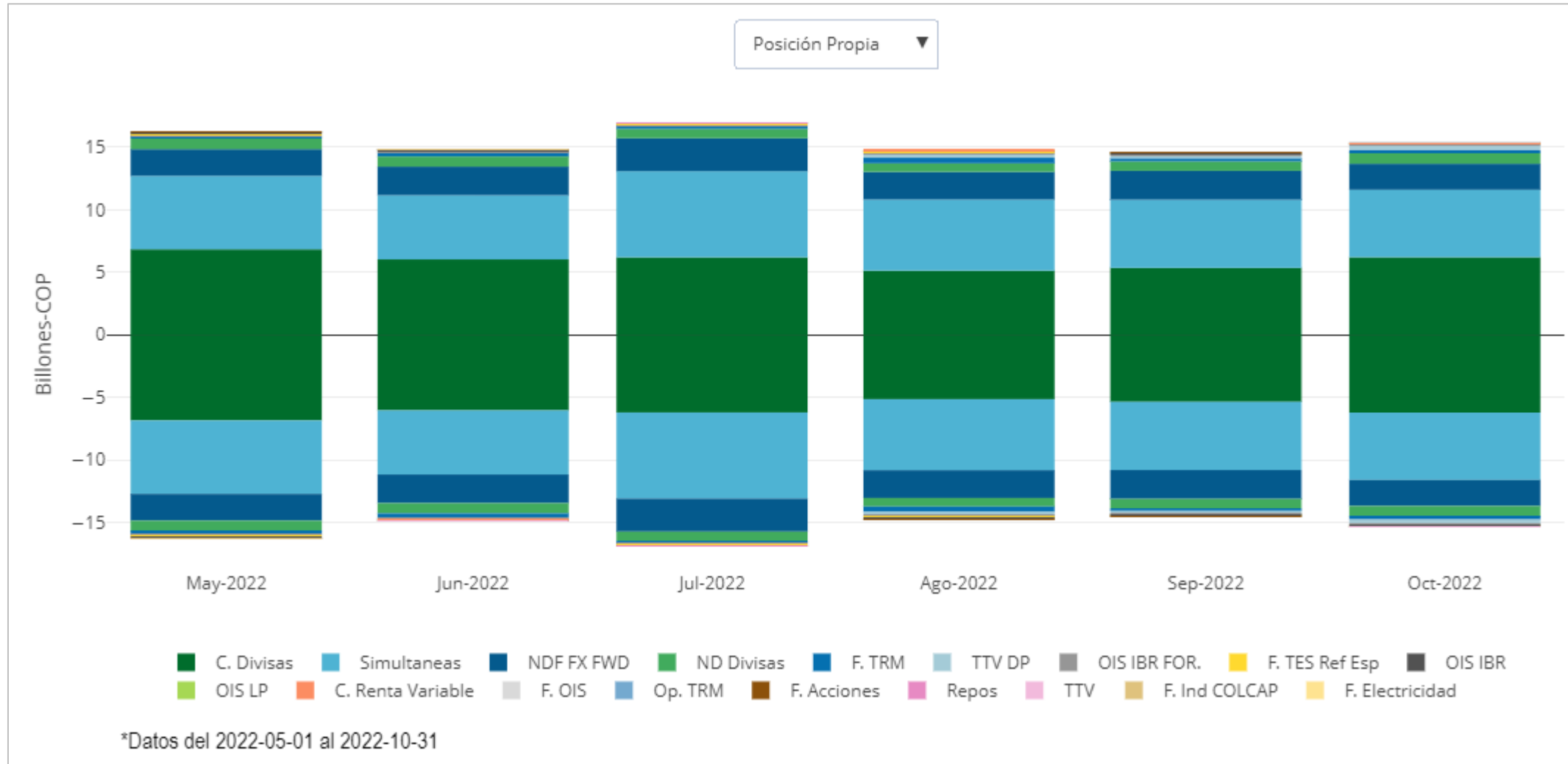
*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

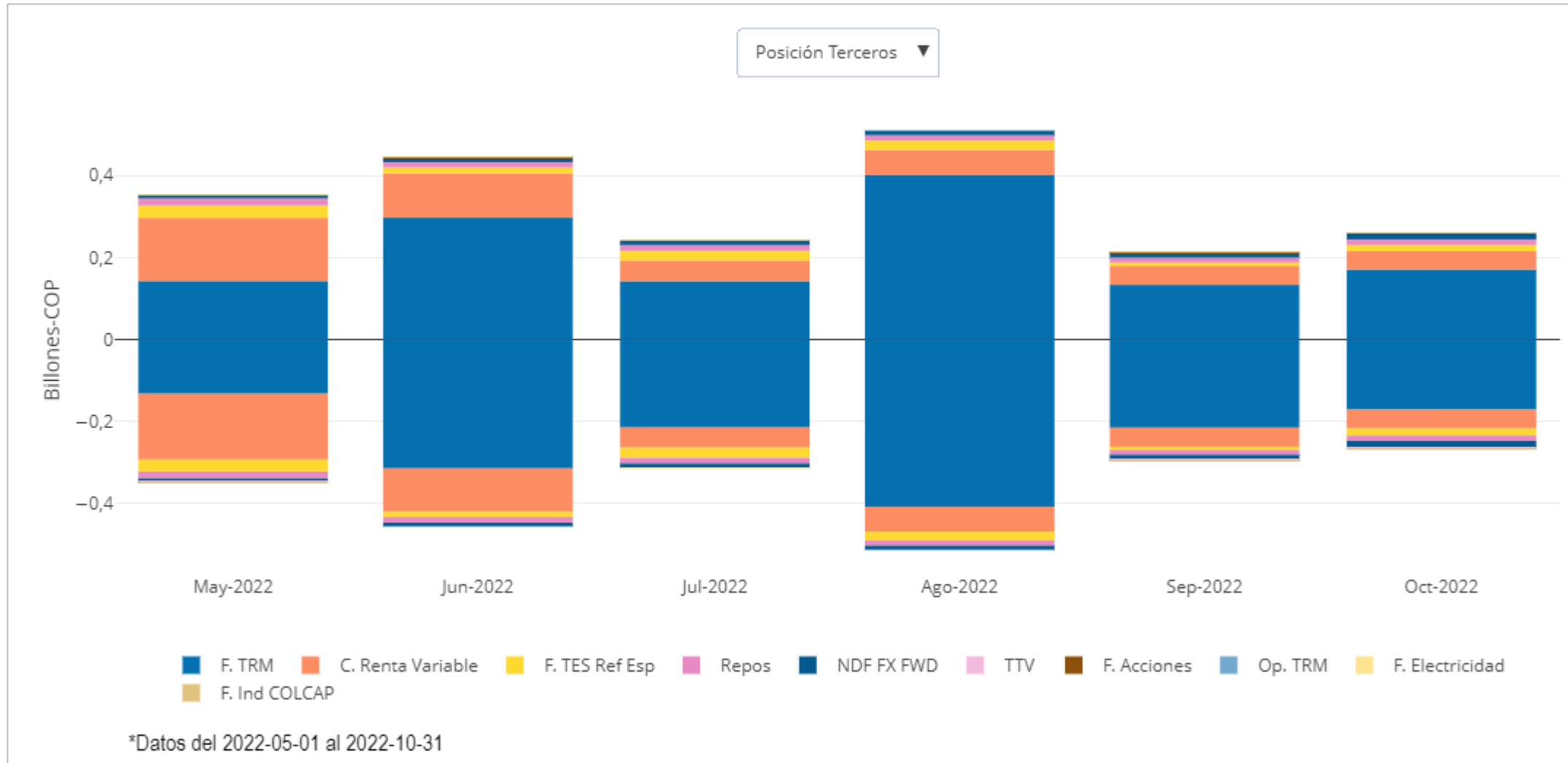
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$198	\$3,964	\$1,327	\$164,520
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$2	\$268
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$450	\$9,001	\$781	\$96,850
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$23,375	\$467,500	\$19,524	\$2,421,000

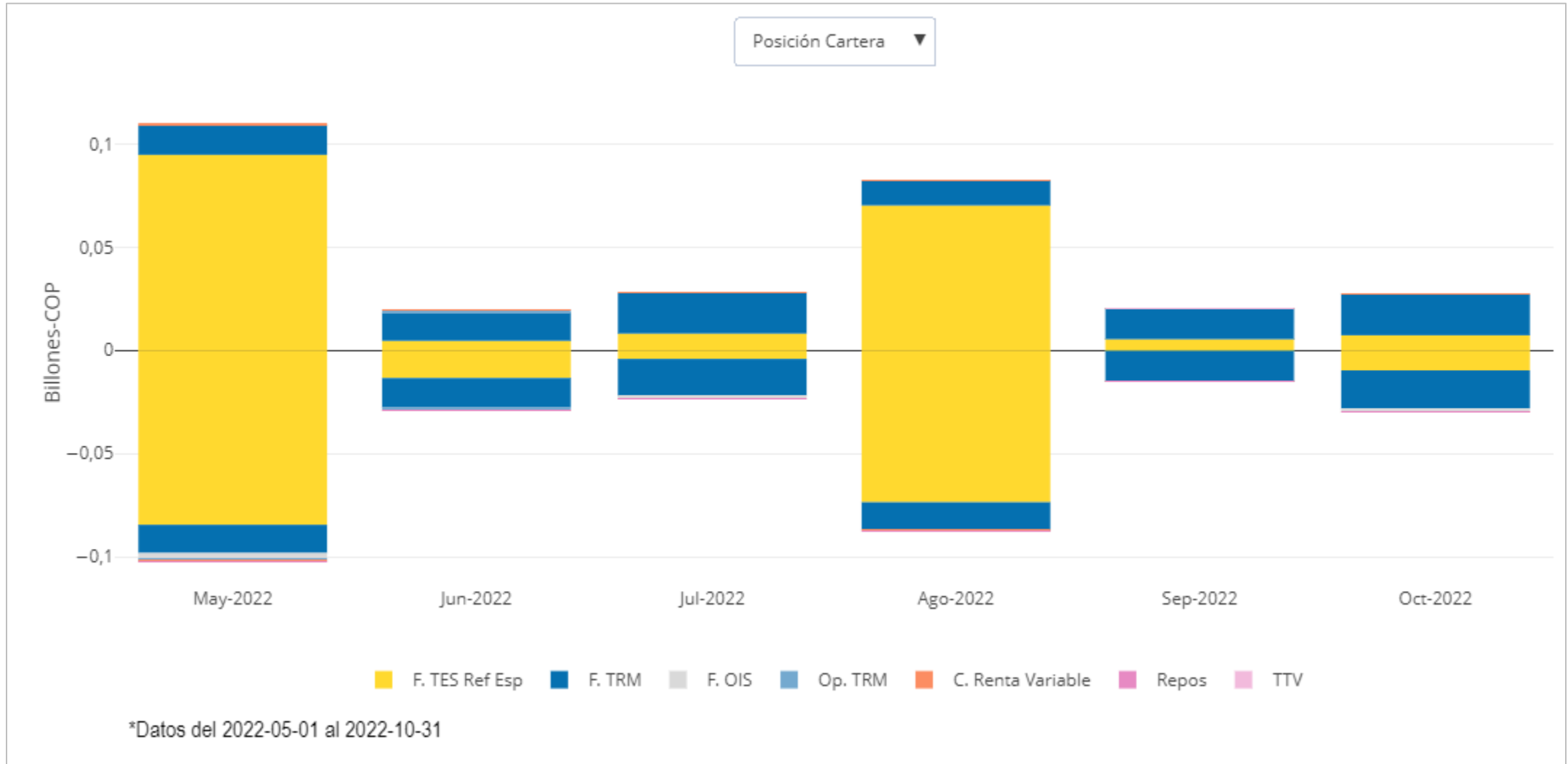
Registros del 19 al 22 de un total de 22

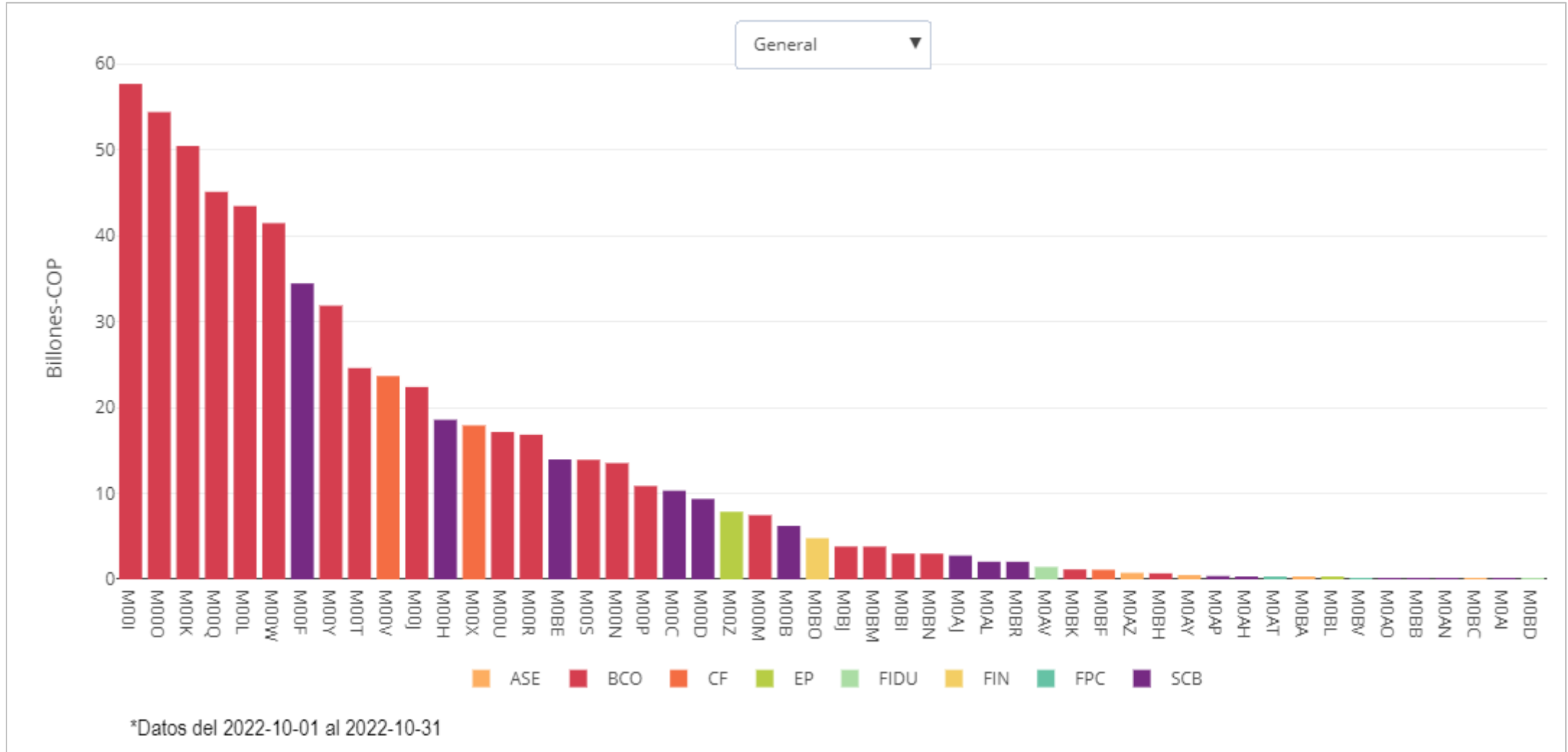
*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

Anterior 1 2 **3** Siguiente









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%	\$97,803,844	\$96,004,451	\$93,466,827
Derivados	TRM	NDF FX FWD	53.25%	\$52,078,971	\$51,114,252	\$48,832,018
Derivados	OIS	OIS IBR	10.65%	\$10,417,016	\$10,841,557	\$12,581,407
Derivados	TRM	F. TRM	9.39%	\$9,183,924	\$8,875,829	\$6,562,689
Swaps	OIS LP	OIS LP	8.86%	\$8,663,000	\$8,481,925	\$7,558,940
Renta Fija	TES	Simultaneas	7.68%	\$7,512,960	\$7,467,303	\$8,908,554
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	5.72%	\$5,589,933	\$5,512,303	\$5,026,362
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	1.97%	\$1,923,700	\$1,785,911	\$2,023,663
Renta Fija	TES	TTV DP	0.79%	\$776,149	\$375,153	\$153,483

Registros del 1 al 9 de un total de 21

*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

Anterior 1 2 3 Siguiete

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 T1	0.70%	\$688,115	\$667,091	\$662,184
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.42%	\$410,763	\$397,353	\$433,388
Derivados	OIS	F. OIS	0.39%	\$378,599	\$342,080	\$511,897
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.15%	\$145,165	\$89,628	\$154,578
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.01%	\$9,283	\$6,902	\$3,933
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.01%	\$8,670	\$7,904	\$8,939
Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.01%	\$6,833	\$28,028	\$18,549
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.01%	\$5,591	\$3,702	\$11,870
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$4,132	\$5,043	\$11,023

Registros del 10 al 18 de un total de 21

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

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
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$884	\$928	\$1,577
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$156	\$1,559	\$1,768
Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$2

Registros del 19 al 21 de un total de 21

*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31

Anterior 1 2 **3** Siguiente

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	\$1,688,000	\$1,691,600	\$1,062,762
1Y-2Y	\$2,874,000	\$2,688,200	\$2,472,383
2Y-5Y	\$2,992,000	\$3,009,925	\$2,981,149
5Y-10Y	\$1,109,000	\$1,092,200	\$1,042,645
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0

*Datos del 2022-05-01 al 2022-10-31



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte