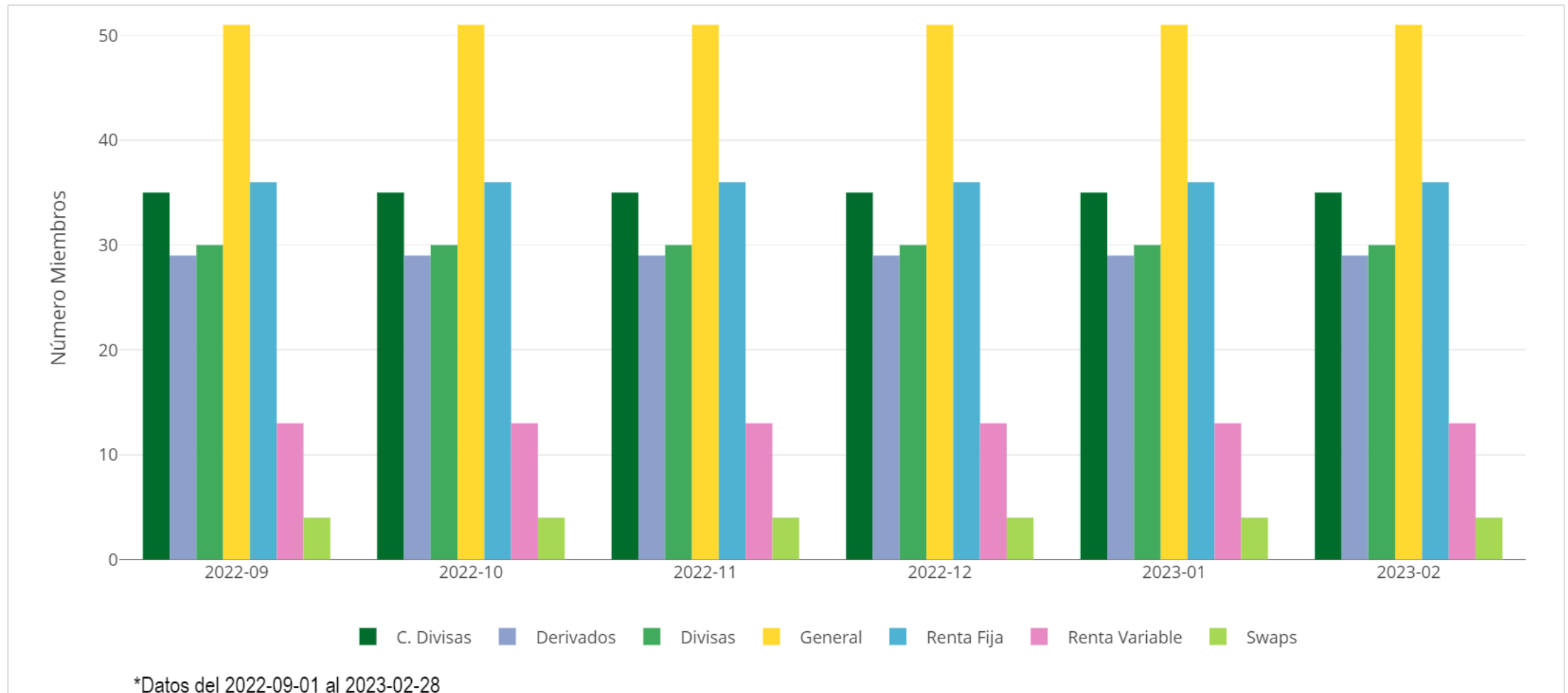


Evolución de Mercado

Febrero 2023



Segmento	Grupo Producto	Clase 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%	\$20,740,602	\$22,149,972	\$442,999,449	\$17,325,381	\$2,131,021,903
Renta Fija	TES	Simultaneas	38.00%	\$7,880,924	\$7,379,976	\$147,599,524	\$6,450,798	\$793,448,182
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	33.45%	\$6,937,196	\$7,562,829	\$151,256,575	\$5,792,975	\$712,535,926
Derivados	TRM	NDF FX FWD	17.69%	\$3,669,564	\$3,803,419	\$76,068,386	\$2,672,418	\$328,707,456
Renta Fija	TES	TTV DP	2.85%	\$590,649	\$556,346	\$11,126,910	\$516,105	\$63,480,948
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.50%	\$519,133	\$1,025,620	\$20,512,391	\$834,285	\$102,617,069
Derivados	TRM	F. TRM	2.16%	\$448,539	\$1,242,639	\$24,852,789	\$685,186	\$84,277,834
Derivados	F. TES	F. TES	1.21%	\$250,013	\$254,302	\$5,086,034	\$111,043	\$13,658,250
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	1.06%	\$219,959	\$69,142	\$1,382,846	\$76,381	\$9,394,825

Registros del 1 al 9 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiente

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

Segmento	Grupo Producto	Clase 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	0.57%	\$117,789	\$97,374	\$1,947,488	\$54,694	\$6,727,417
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.49%	\$101,137	\$101,100	\$2,022,002	\$100,944	\$12,416,122
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$4,655	\$9,258	\$185,155	\$11,931	\$1,467,459
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$955	\$413	\$8,265	\$655	\$80,622
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$89	\$28	\$552	\$56	\$6,827
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$528	\$10,561	\$189	\$23,243
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$19,660	\$393,203	\$5,134	\$631,540
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$441	\$8,827	\$191	\$23,506
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$897	\$17,943	\$749	\$92,178

Registros del 10 al 18 de un total de 19

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

Segmento	Grupo Producto	Clase 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	0.00%	\$0	\$26,000	\$520,000	\$11,646	\$1,432,500

Registros del 19 al 19 de un total de 19

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

Anterior 1 2 **3** Siguiente



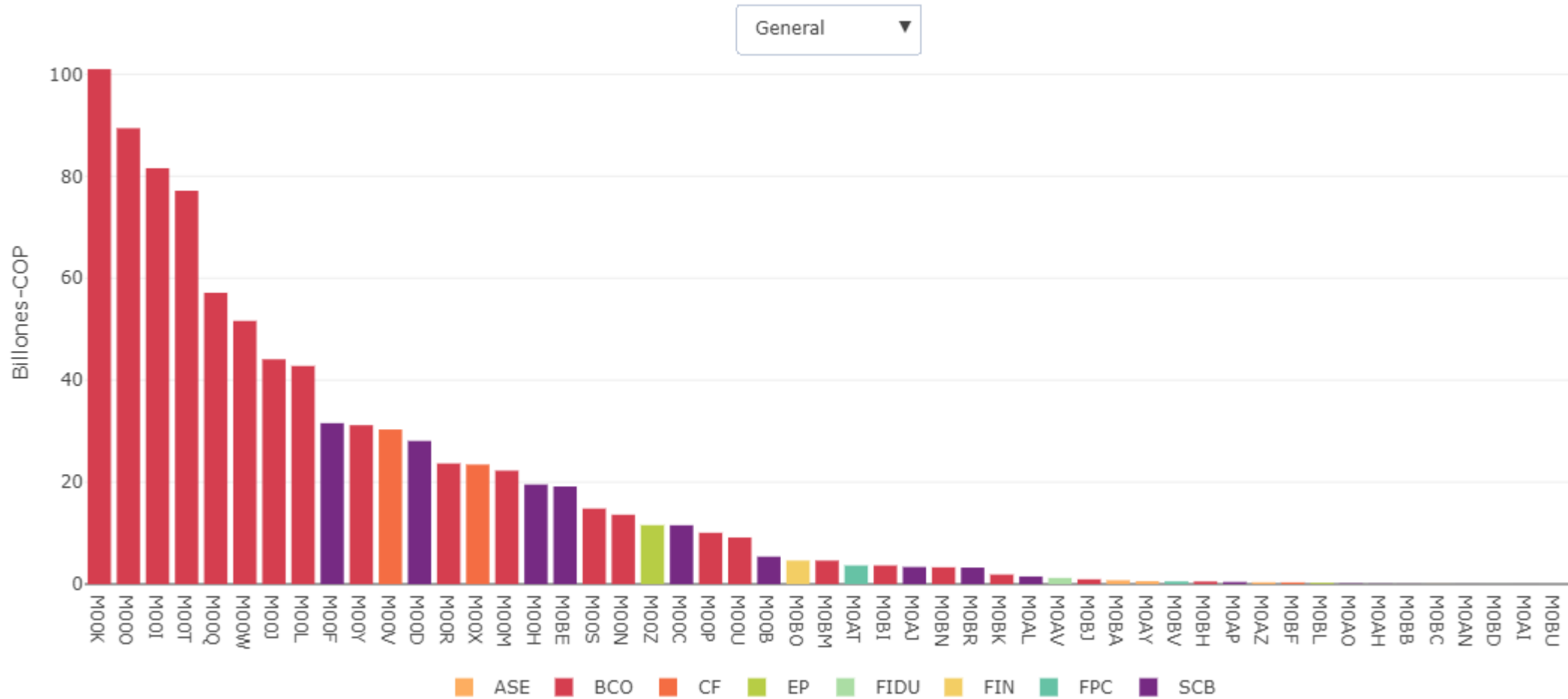
*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28



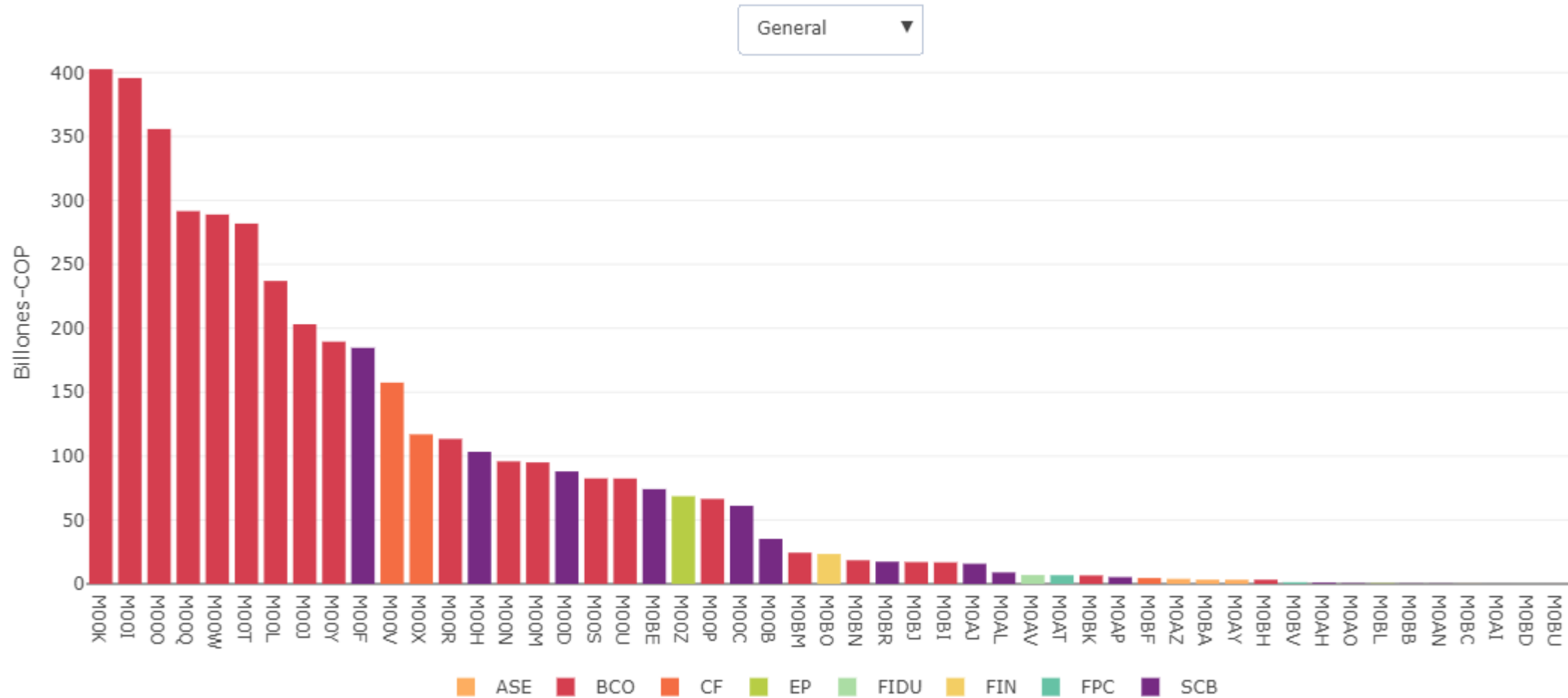
*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28



*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28



*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28



*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

Segmento	Grupo Producto	Clase 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	\$129,967,304	\$129,967,304	\$118,403,900	\$118,403,900	\$103,766,160	\$103,766,154
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$64,961,555	\$64,961,555	\$58,810,709	\$58,810,709	\$52,939,446	\$52,939,446
Derivados	TRM	F. TRM	\$18,303,929	\$18,303,929	\$14,815,820	\$14,815,820	\$11,462,628	\$11,462,628
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$14,748,483	\$14,748,483	\$13,379,603	\$13,379,603	\$10,047,632	\$10,047,632
Derivados	OIS	OIS IBR	\$11,608,263	\$11,608,263	\$11,417,332	\$11,417,332	\$10,786,406	\$10,786,406
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$9,143,000	\$9,143,000	\$8,996,000	\$8,996,000	\$8,640,443	\$8,640,443
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$5,978,421	\$5,978,421	\$6,064,858	\$6,064,858	\$5,644,291	\$5,644,291
Derivados	F. TES	F. TES	\$2,919,514	\$2,919,514	\$2,438,693	\$2,438,693	\$2,093,340	\$2,093,340
Derivados	OIS	F. OIS	\$727,425	\$727,425	\$629,126	\$629,126	\$416,790	\$416,790

Registros del 1 al 9 de un total de 18

Anterior 1 2 Siguiente

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

Segmento	Grupo Producto	Clase 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 Fija	TES	TTV DP	\$590,649	\$590,649	\$556,346	\$556,346	\$519,519	\$519,519
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$471,821	\$471,821	\$869,220	\$869,220	\$682,421	\$682,421
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$245,494	\$245,494	\$282,581	\$282,581	\$378,063	\$378,063
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$228,136	\$228,136	\$105,053	\$105,053	\$126,766	\$126,761
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$21,988	\$21,988	\$20,179	\$20,179	\$9,558	\$9,558
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$14,336	\$14,336	\$13,123	\$13,123	\$13,418	\$13,418
Derivados	TRM	Op. TRM	\$3,030	\$3,030	\$2,601	\$2,601	\$2,938	\$2,938
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$1,025	\$1,025	\$1,106	\$1,106	\$1,021	\$1,021
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$235	\$235	\$1,549	\$1,549	\$1,480	\$1,480

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior 1 **2** Siguiente

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28

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	\$2,051,500	\$2,048,200	\$1,846,642
1Y-2Y	\$2,622,000	\$2,629,900	\$2,663,813
2Y-5Y	\$3,276,000	\$3,134,025	\$3,006,350
5Y-10Y	\$1,193,500	\$1,183,875	\$1,123,638
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0

*Datos del 2022-09-01 al 2023-02-28



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte