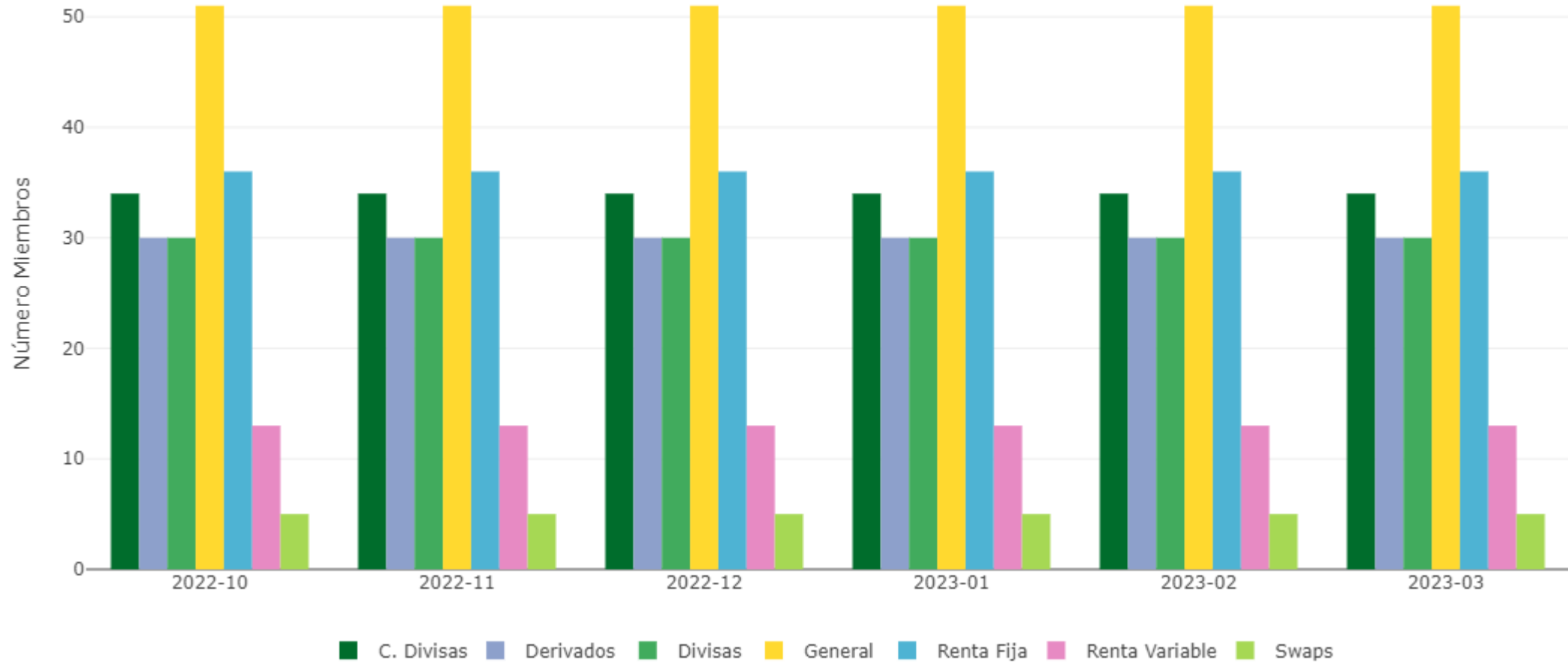


Evolución de Mercado

Marzo 2023



*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31

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%	\$22,428,235	\$23,617,800	\$519,591,603	\$18,897,242	\$2,324,360,804
Renta Fija	TES	Simultaneas	56.52%	\$12,677,217	\$9,955,469	\$219,020,310	\$7,256,438	\$892,541,853
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	22.24%	\$4,988,895	\$7,043,338	\$154,953,437	\$6,095,259	\$749,716,843
Derivados	TRM	NDF FX FWD	11.50%	\$2,578,546	\$4,318,636	\$95,009,987	\$3,029,865	\$372,673,386
Renta Fija	TES	TTV DP	3.24%	\$727,482	\$591,862	\$13,020,965	\$575,063	\$70,732,696
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.85%	\$640,049	\$745,892	\$16,409,620	\$830,866	\$102,196,498
Derivados	TRM	F. TRM	1.05%	\$235,462	\$425,359	\$9,357,888	\$690,805	\$84,968,986
Derivados	F. TES	F. TES	0.97%	\$217,159	\$125,486	\$2,760,691	\$127,816	\$15,721,402
Derivados	OIS	OIS IBR	0.51%	\$113,358	\$161,324	\$3,549,128	\$70,406	\$8,659,990

Registros del 1 al 9 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiente

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31

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	IBR FOR.	IBR FOR.	0.45%	\$101,086	\$101,199	\$2,226,373	\$101,034	\$12,427,215
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.40%	\$90,000	\$53,955	\$1,187,000	\$19,841	\$2,440,500
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.18%	\$40,489	\$76,945	\$1,692,787	\$80,534	\$9,905,631
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.07%	\$16,649	\$8,955	\$197,006	\$11,355	\$1,396,655
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$1,716	\$321	\$7,061	\$684	\$84,103
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$126	\$762	\$16,753	\$311	\$38,222
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$0	\$1,365	\$30,020	\$651	\$80,025
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$76	\$1,679	\$46	\$5,707
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$6,859	\$150,899	\$6,116	\$752,207

Registros del 10 al 18 de un total de 19

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31

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	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$154	\$18,885

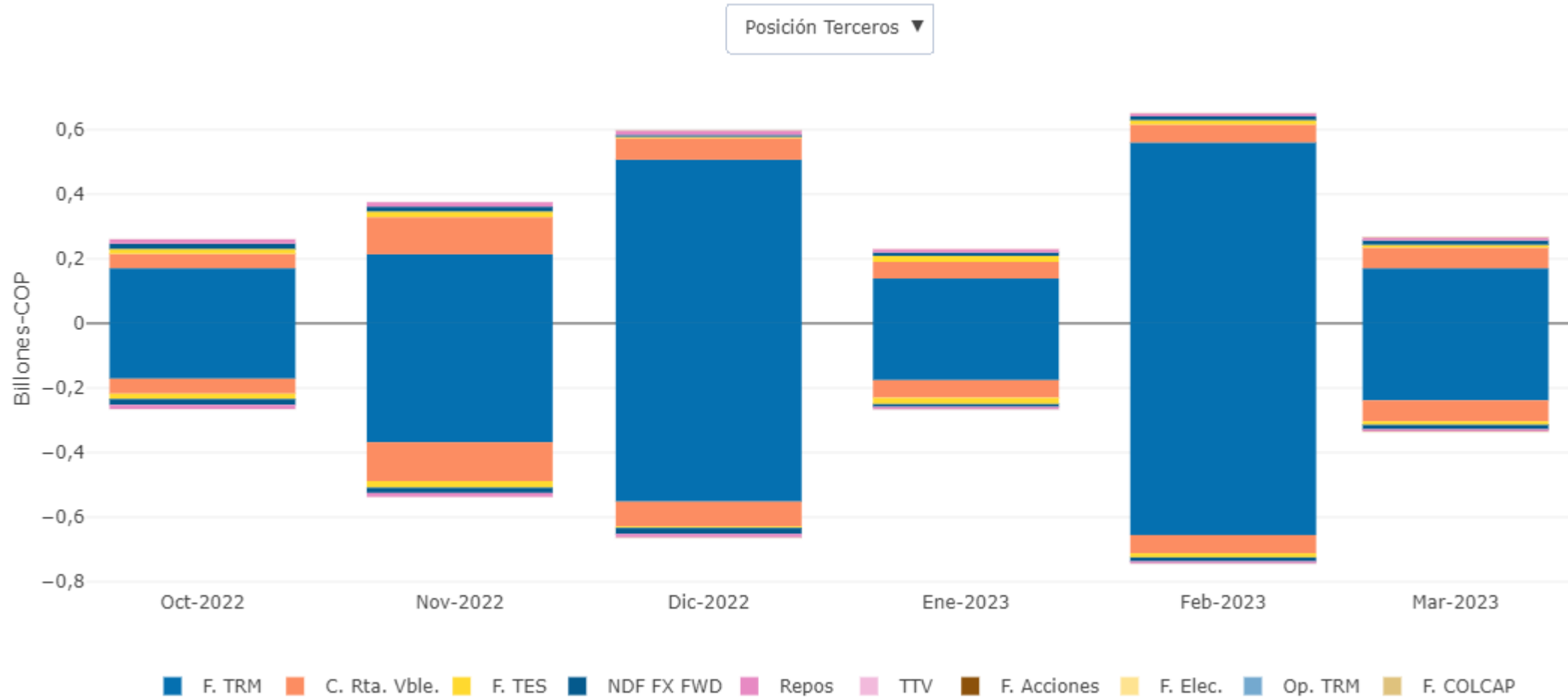
Registros del 19 al 19 de un total de 19

Anterior 1 2 **3** Siguiente

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31



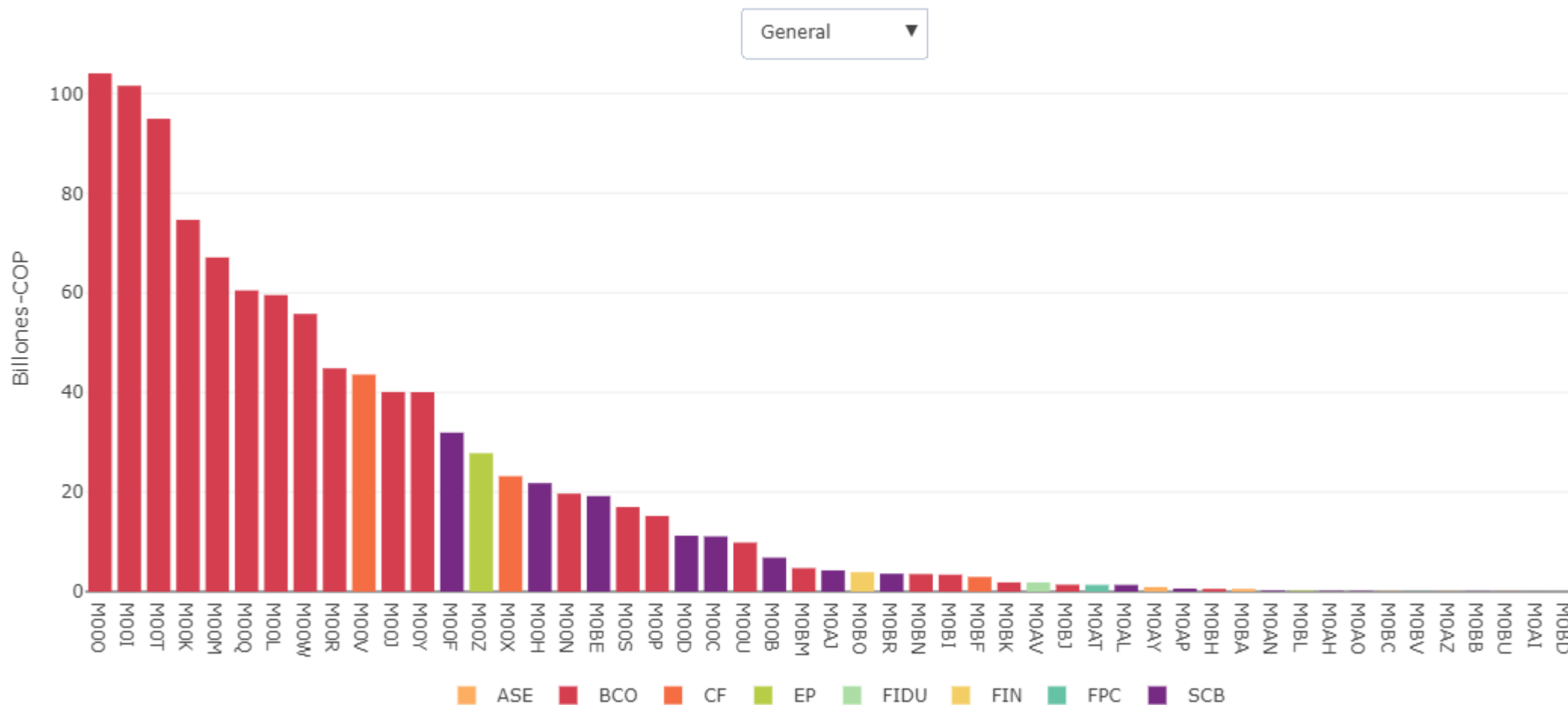
*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31



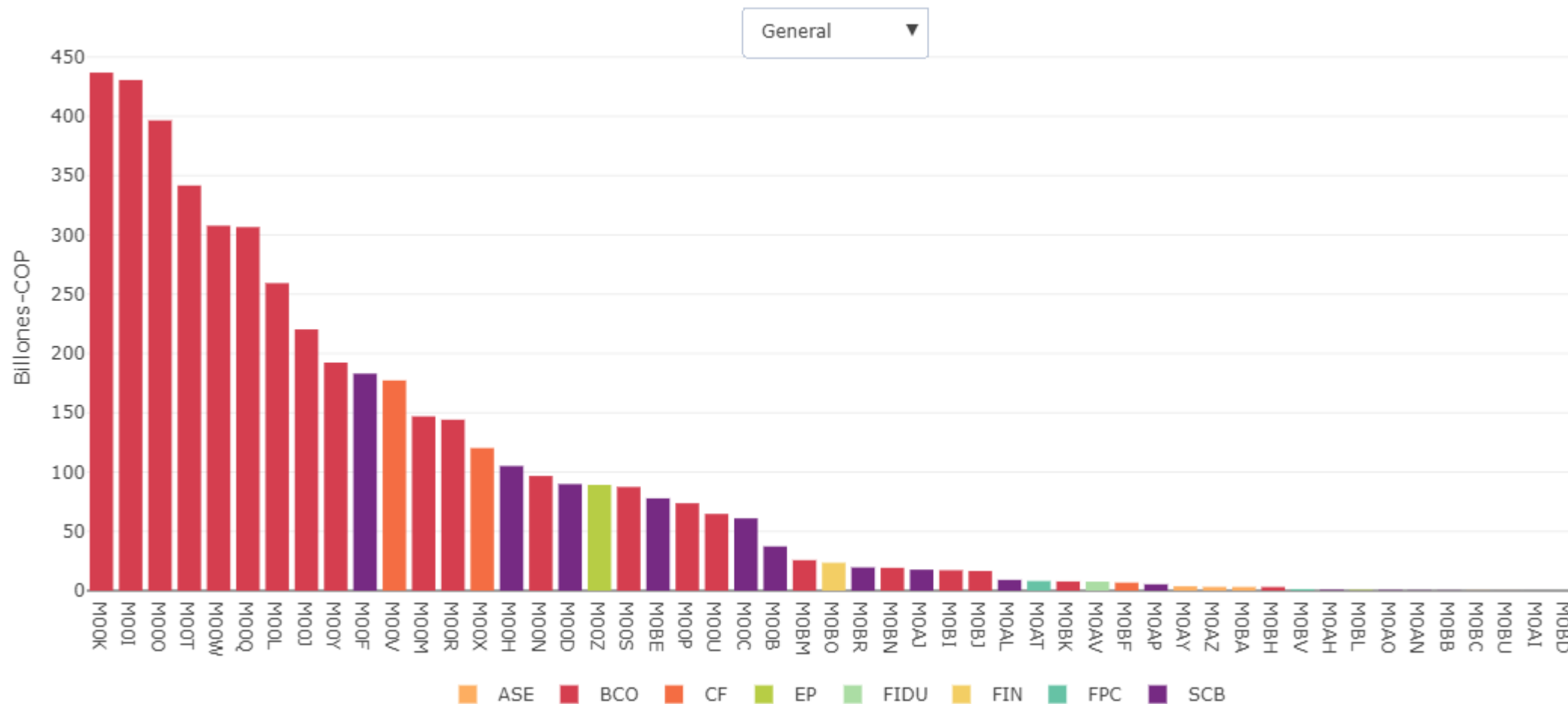
*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31



*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31



*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31



*Datos del 2022-09-01 al 2023-03-31

Segmento	Grupo Producto	Clase 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%	\$125,609,169	\$125,756,892	\$109,311,738
Derivados	TRM	NDF FX FWD	49.08%	\$61,650,479	\$63,911,875	\$55,413,850
Derivados	TRM	F. TRM	12.16%	\$15,270,183	\$16,207,949	\$12,871,944
Renta Fija	TES	Simultaneas	11.07%	\$13,908,675	\$12,810,720	\$10,893,891
Derivados	OIS	OIS IBR	10.54%	\$13,233,575	\$12,190,092	\$10,968,308
Swaps	OIS LP	OIS LP	8.15%	\$10,237,500	\$9,653,682	\$8,910,996
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	4.91%	\$6,168,955	\$6,077,800	\$5,785,430
Derivados	F. TES	F. TES	2.06%	\$2,587,043	\$2,478,353	\$2,198,976
Derivados	OIS	F. OIS	0.69%	\$872,279	\$754,477	\$495,928

Registros del 1 al 9 de un total de 18

Anterior 2 Siguiete

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31

Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Renta Fija	TES	TTV DP	0.58%	\$727,482	\$591,862	\$578,477
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	0.47%	\$590,559	\$673,879	\$686,355
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.17%	\$217,638	\$227,339	\$343,437
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.07%	\$89,706	\$137,961	\$133,920
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.03%	\$35,691	\$23,922	\$12,974
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.01%	\$14,023	\$13,507	\$12,749
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$3,544	\$619	\$1,291
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$951	\$1,929	\$2,222
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$885	\$926	\$990

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior 1 **2** Siguiente

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31

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	\$2,122,000	\$2,095,455	\$1,955,959
1Y-2Y	\$3,044,500	\$2,808,795	\$2,707,191
2Y-5Y	\$3,723,500	\$3,493,977	\$3,091,703
5Y-10Y	\$1,347,500	\$1,255,455	\$1,156,142
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0

*Datos del 2022-10-01 al 2023-03-31



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte