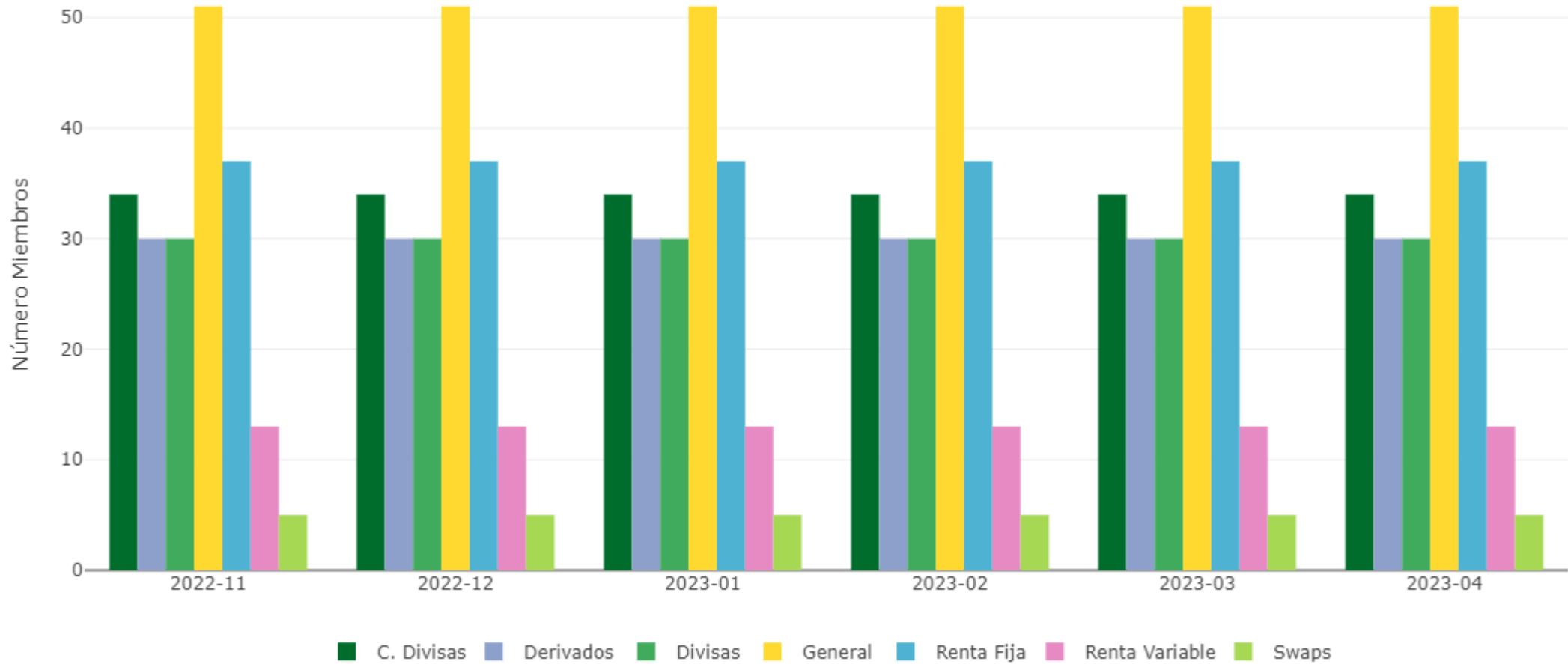


Evolución de Mercado

Abril 2023



*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$20,715,308	\$19,944,668	\$359,004,022	\$19,591,243	\$2,370,540,422
Renta Fija	TES	Simultaneas	36.33%	\$7,526,791	\$7,482,013	\$134,676,242	\$7,598,563	\$919,426,081
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	34.26%	\$7,096,807	\$7,152,947	\$128,753,043	\$6,233,638	\$754,270,241
Derivados	TRM	NDF FX FWD	18.19%	\$3,768,155	\$3,001,121	\$54,020,177	\$3,179,809	\$384,756,884
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.78%	\$783,132	\$903,663	\$16,265,936	\$836,449	\$101,210,313
Renta Fija	TES	TTV DP	3.57%	\$739,296	\$622,036	\$11,196,646	\$615,093	\$74,426,273
Derivados	OIS	OIS IBR	1.30%	\$268,987	\$90,626	\$1,631,260	\$79,281	\$9,593,023
Derivados	TRM	F. TRM	1.13%	\$233,162	\$364,672	\$6,564,104	\$689,765	\$83,461,613
Derivados	F. TES	F. TES	0.57%	\$118,996	\$124,303	\$2,237,455	\$136,691	\$16,539,553

Registros del 1 al 9 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiete

*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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	IBR FOR.	IBR FOR.	0.49%	\$101,203	\$101,166	\$1,820,991	\$101,085	\$12,231,226
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.31%	\$65,101	\$73,882	\$1,329,881	\$83,800	\$10,139,804
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.06%	\$13,157	\$6,779	\$122,030	\$10,293	\$1,245,420
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$238	\$71	\$1,274	\$295	\$35,729
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$188	\$486	\$8,742	\$695	\$84,086
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$90	\$73	\$1,316	\$52	\$6,269
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$6	\$1,040	\$18,718	\$775	\$93,821
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$6,307	\$113,532	\$6,525	\$789,490
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$2,371	\$42,676	\$476	\$57,597

Registros del 10 al 18 de un total de 19

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

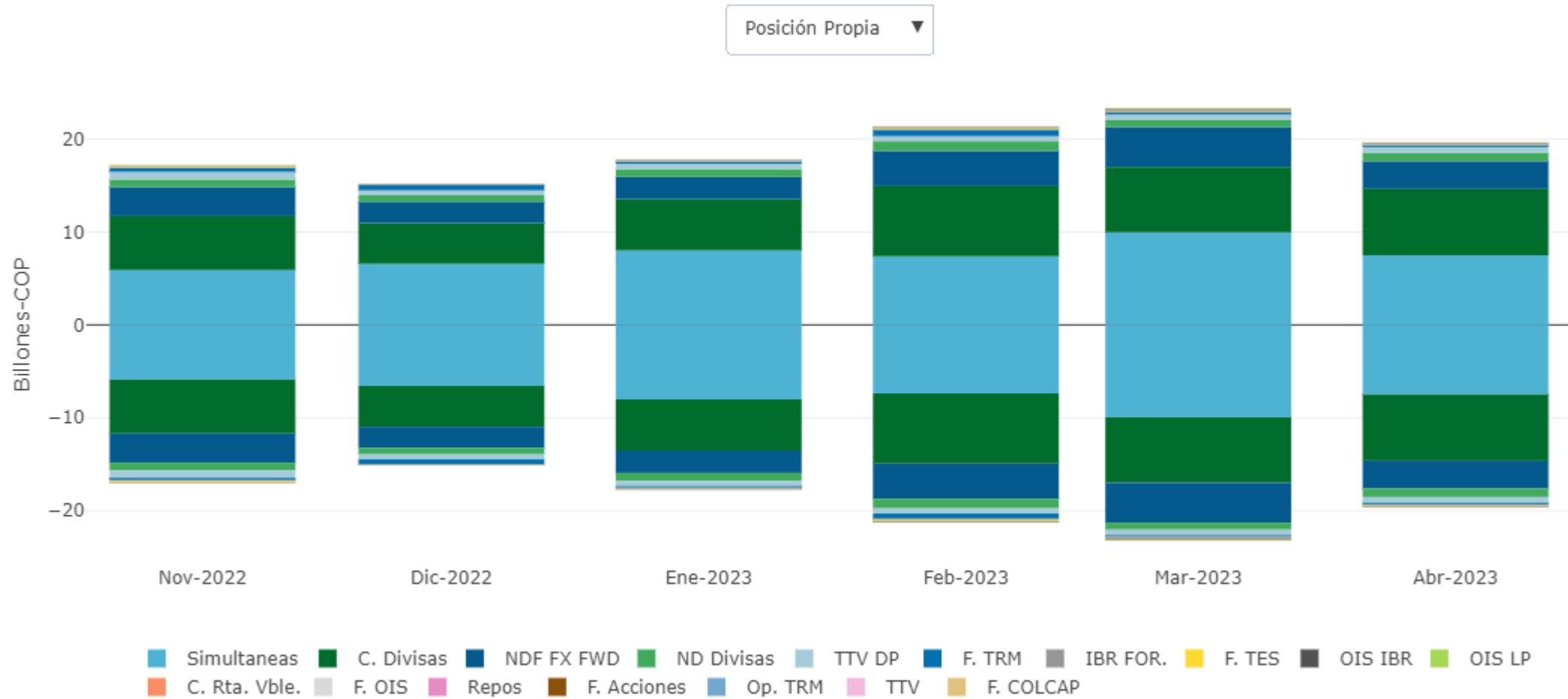
*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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	\$11,111	\$200,000	\$17,959	\$2,173,000

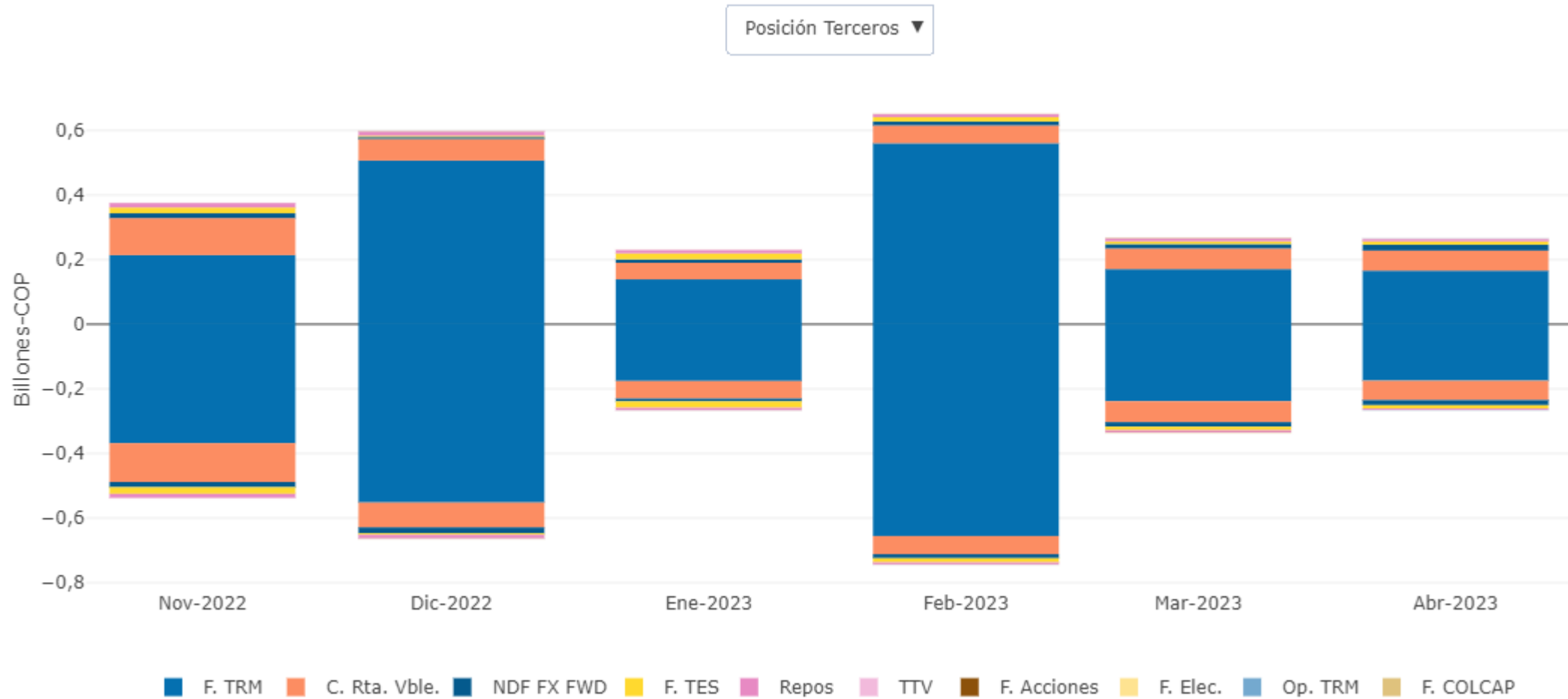
Registros del 19 al 19 de un total de 19

*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

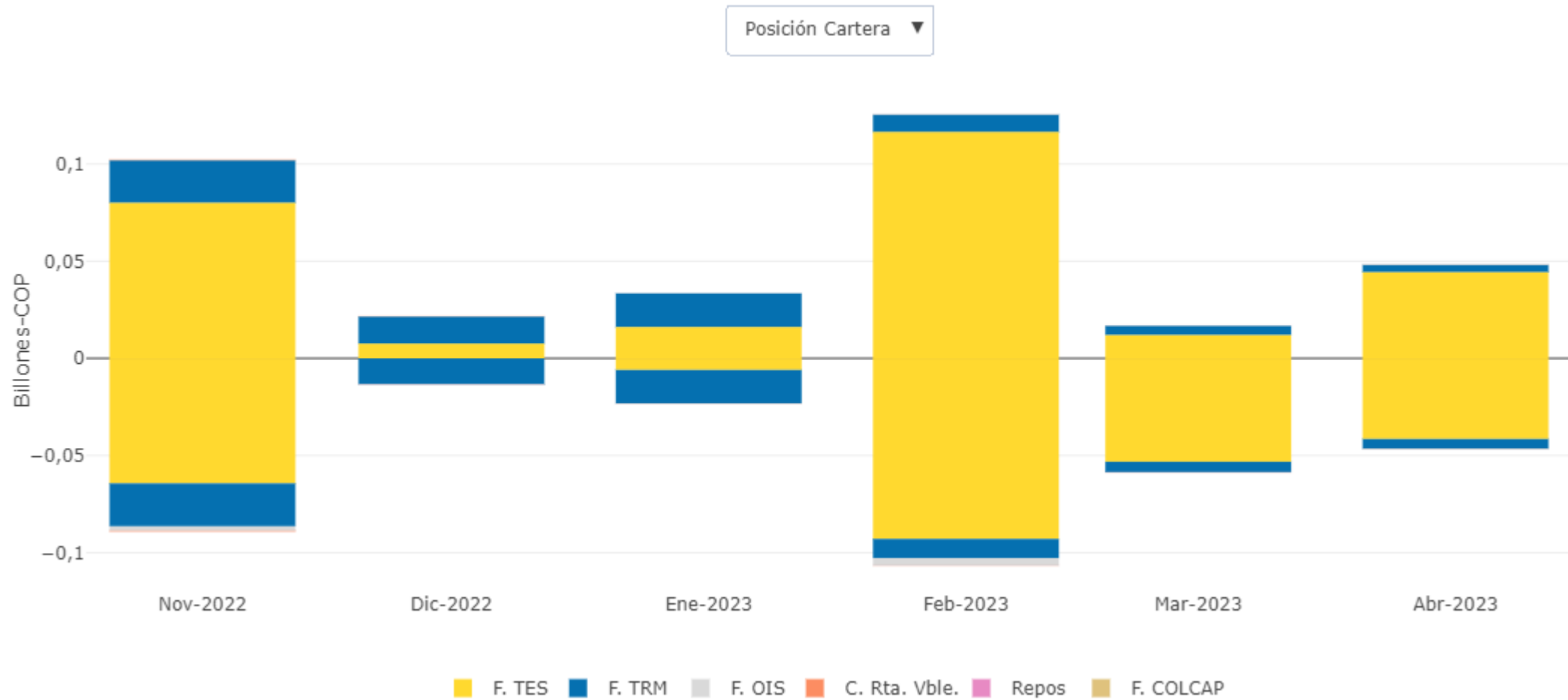
Anterior 1 2 **3** Siguiente



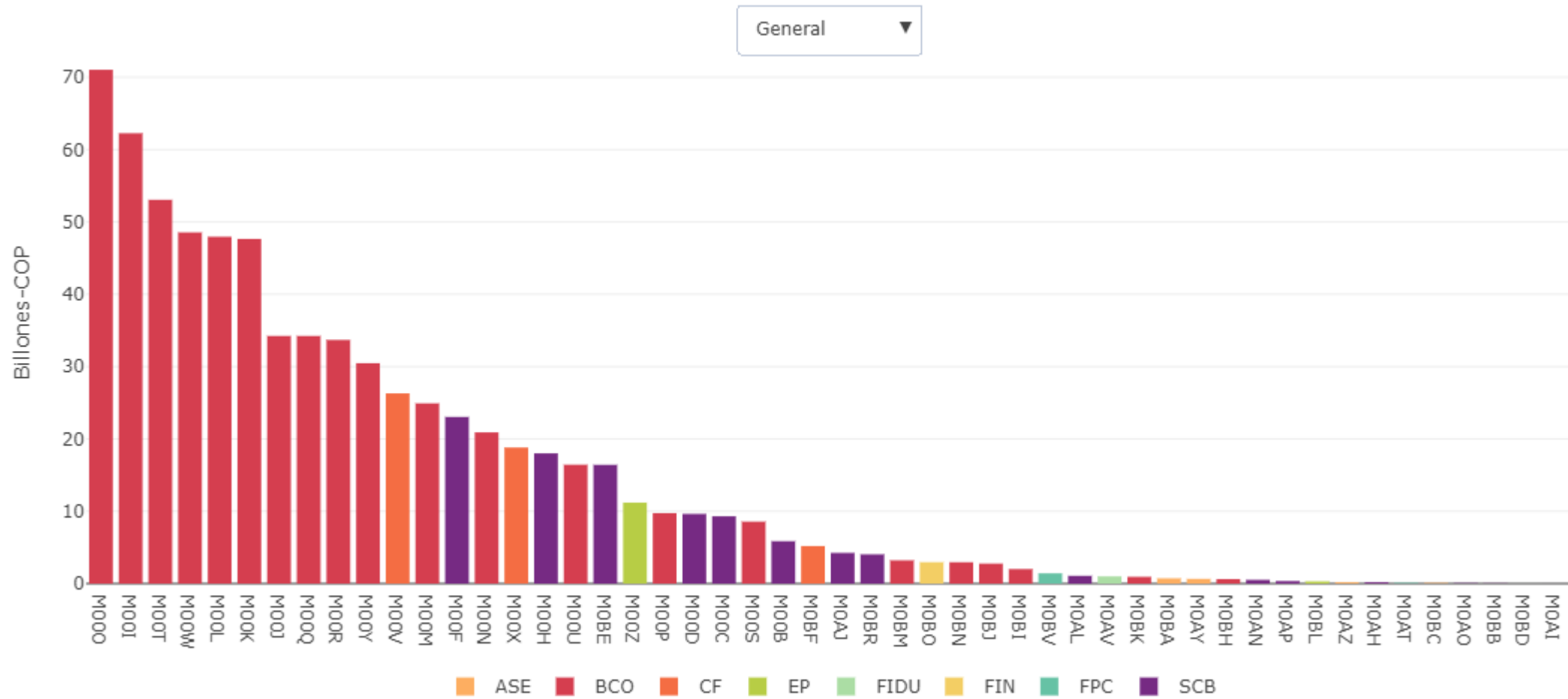
*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28



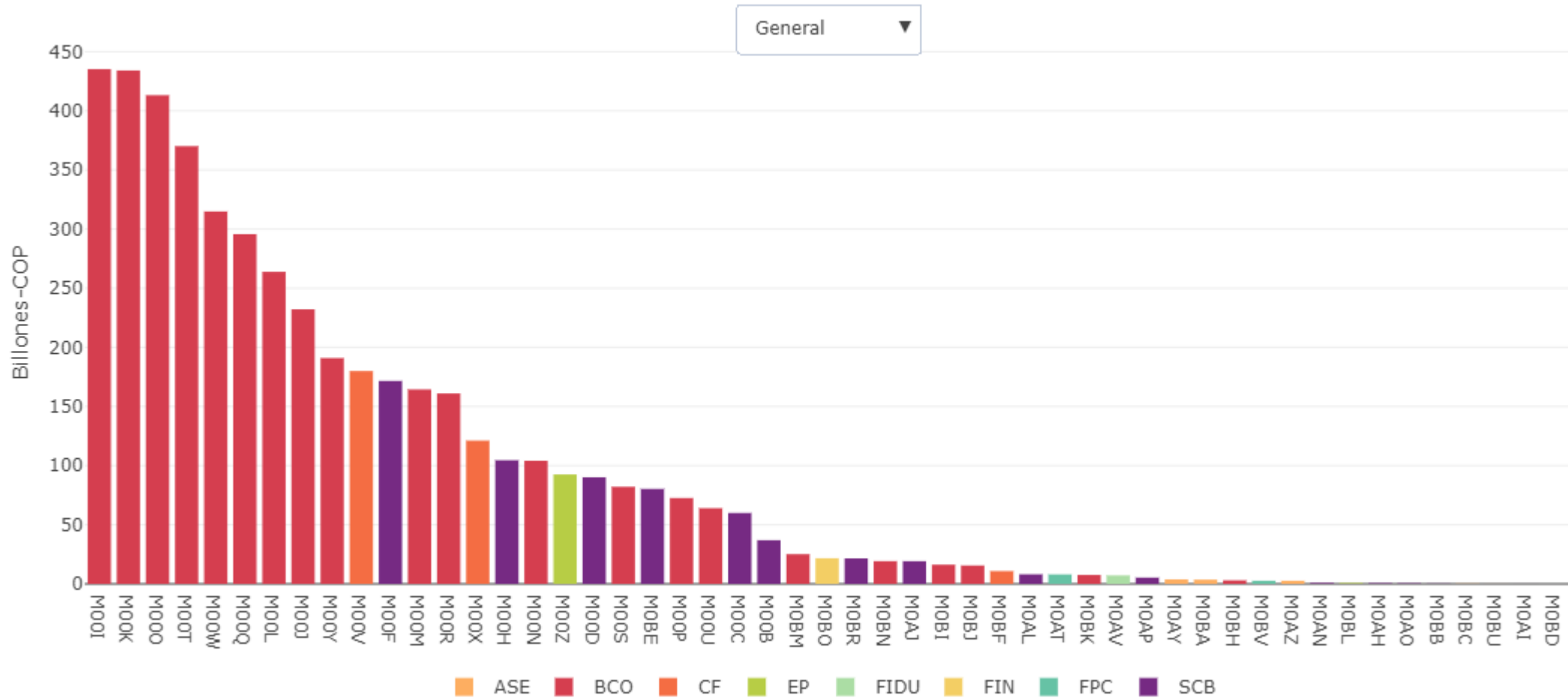
*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28



*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28



*Datos del 2023-04-01 al 2023-04-28



*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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	\$126,285,511	\$126,285,511	\$122,540,111	\$122,540,111	\$113,479,093	\$113,479,087
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$62,439,958	\$62,439,958	\$60,726,408	\$60,726,408	\$56,914,825	\$56,914,825
Derivados	TRM	F. TRM	\$15,461,327	\$15,461,327	\$15,051,482	\$15,051,482	\$13,856,688	\$13,856,688
Derivados	OIS	OIS IBR	\$14,415,312	\$14,415,312	\$13,677,038	\$13,677,038	\$11,392,210	\$11,392,210
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$11,741,405	\$11,741,405	\$10,906,413	\$10,906,413	\$11,462,132	\$11,462,132
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$10,389,500	\$10,389,500	\$10,356,833	\$10,356,833	\$9,197,000	\$9,197,000
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$6,093,610	\$6,093,610	\$6,176,094	\$6,176,094	\$5,888,691	\$5,888,691
Derivados	F. TES	F. TES	\$2,983,558	\$2,983,558	\$2,874,776	\$2,874,776	\$2,367,783	\$2,367,783
Derivados	OIS	F. OIS	\$985,433	\$985,433	\$930,155	\$930,155	\$585,953	\$585,953

Registros del 1 al 9 de un total de 18

Anterior 1 2 Siguiete

*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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	\$739,296	\$739,296	\$622,036	\$622,036	\$618,564	\$618,564
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$677,228	\$677,228	\$818,682	\$818,682	\$704,591	\$704,591
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$188,744	\$188,744	\$224,033	\$224,033	\$316,763	\$316,763
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$114,251	\$114,251	\$124,670	\$124,670	\$139,812	\$139,806
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$28,647	\$28,647	\$29,865	\$29,865	\$16,491	\$16,491
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$17,458	\$17,458	\$14,786	\$14,786	\$13,020	\$13,020
Derivados	TRM	Op. TRM	\$7,491	\$7,491	\$3,966	\$3,966	\$2,237	\$2,237
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$1,698	\$1,698	\$1,270	\$1,270	\$1,042	\$1,042
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$594	\$594	\$1,605	\$1,605	\$1,293	\$1,293

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior 1 **2** Siguiente

*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28

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	\$2,141,000	\$2,147,111	\$2,028,091
1Y-2Y	\$3,149,500	\$3,124,556	\$2,772,417
2Y-5Y	\$3,747,500	\$3,743,556	\$3,202,190
5Y-10Y	\$1,351,500	\$1,341,611	\$1,194,302
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0

*Datos del 2022-11-01 al 2023-04-28



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte