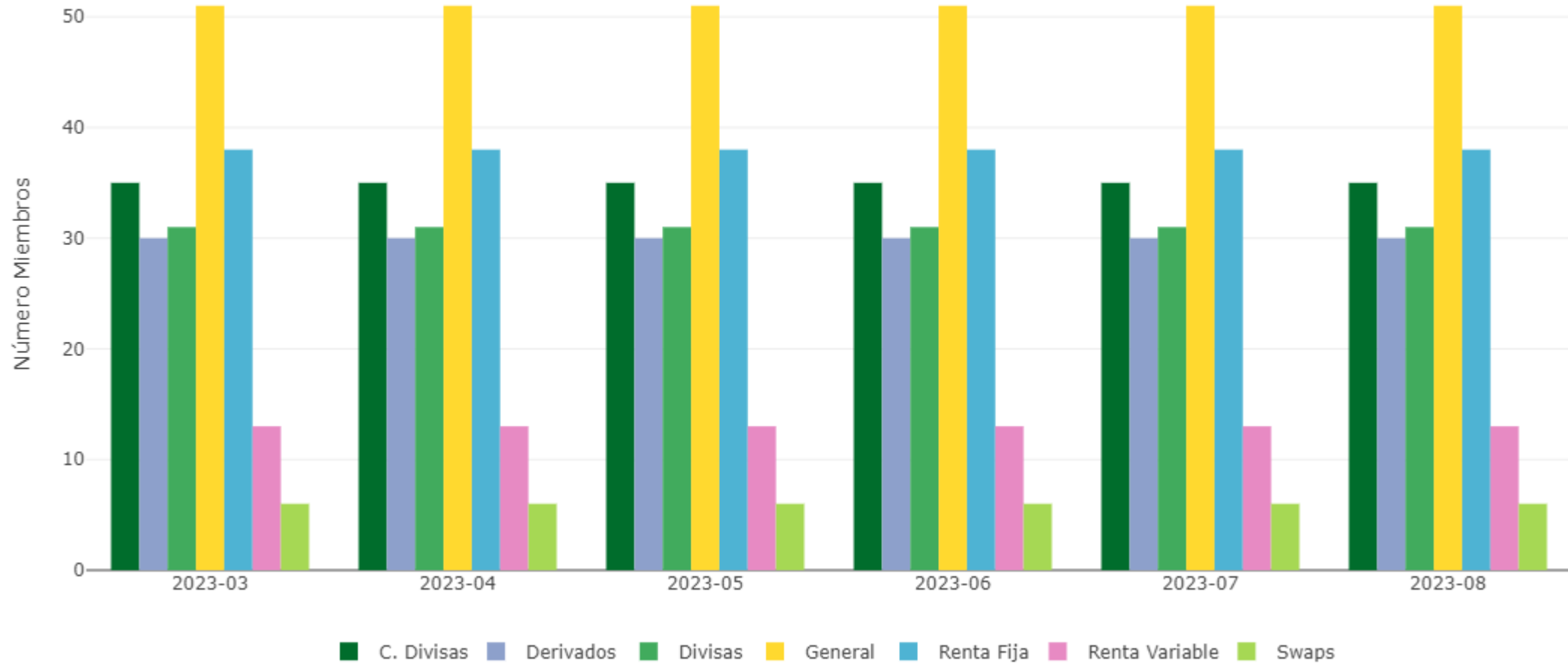


Evolución de Mercado

Agosto 2023



*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31

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%	\$32,352,568	\$21,091,488	\$442,921,240	\$20,550,442	\$2,486,603,429
Renta Fija	TES	Simultaneas	28.14%	\$9,104,138	\$8,951,853	\$187,988,919	\$8,429,489	\$1,019,968,186
Derivados	TRM	F. TRM	27.72%	\$8,966,835	\$817,538	\$17,168,295	\$520,280	\$62,953,833
Derivados	TRM	NDF FX FWD	21.39%	\$6,921,443	\$3,138,098	\$65,900,064	\$3,193,836	\$386,454,143
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	14.27%	\$4,617,202	\$5,462,597	\$114,714,543	\$6,121,814	\$740,739,485
Renta Fija	TES	TTV DP	4.49%	\$1,452,814	\$1,484,454	\$31,173,529	\$1,000,684	\$121,082,717
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.09%	\$675,934	\$824,338	\$17,311,099	\$785,398	\$95,033,114
Derivados	F. TES	F. TES	0.81%	\$262,861	\$163,429	\$3,432,003	\$147,771	\$17,880,233
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.75%	\$243,380	\$49,326	\$1,035,836	\$57,507	\$6,958,292

Registros del 1 al 9 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiete

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31

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.	0.31%	\$101,050	\$101,126	\$2,123,640	\$101,182	\$12,243,027
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$5,809	\$6,916	\$145,232	\$7,886	\$954,181
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$598	\$121	\$2,548	\$679	\$82,126
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$504	\$613	\$12,864	\$514	\$62,146
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$17	\$367	\$69	\$8,323
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$1,448	\$30,406	\$574	\$69,447
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$2,365	\$49,663	\$5,502	\$665,743
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$70,943	\$1,489,798	\$155,389	\$18,802,044
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$21	\$434	\$425	\$51,391

Registros del 10 al 18 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiente

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31

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
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$16,286	\$342,000	\$21,446	\$2,595,000

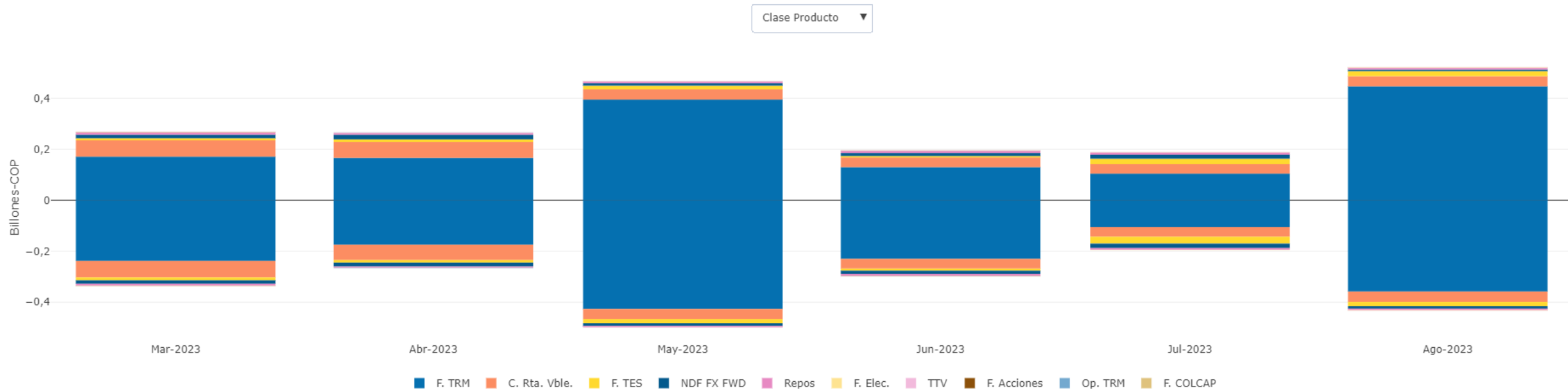
Registros del 19 al 19 de un total de 19

Anterior 1 2 **3** Siguiente

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31



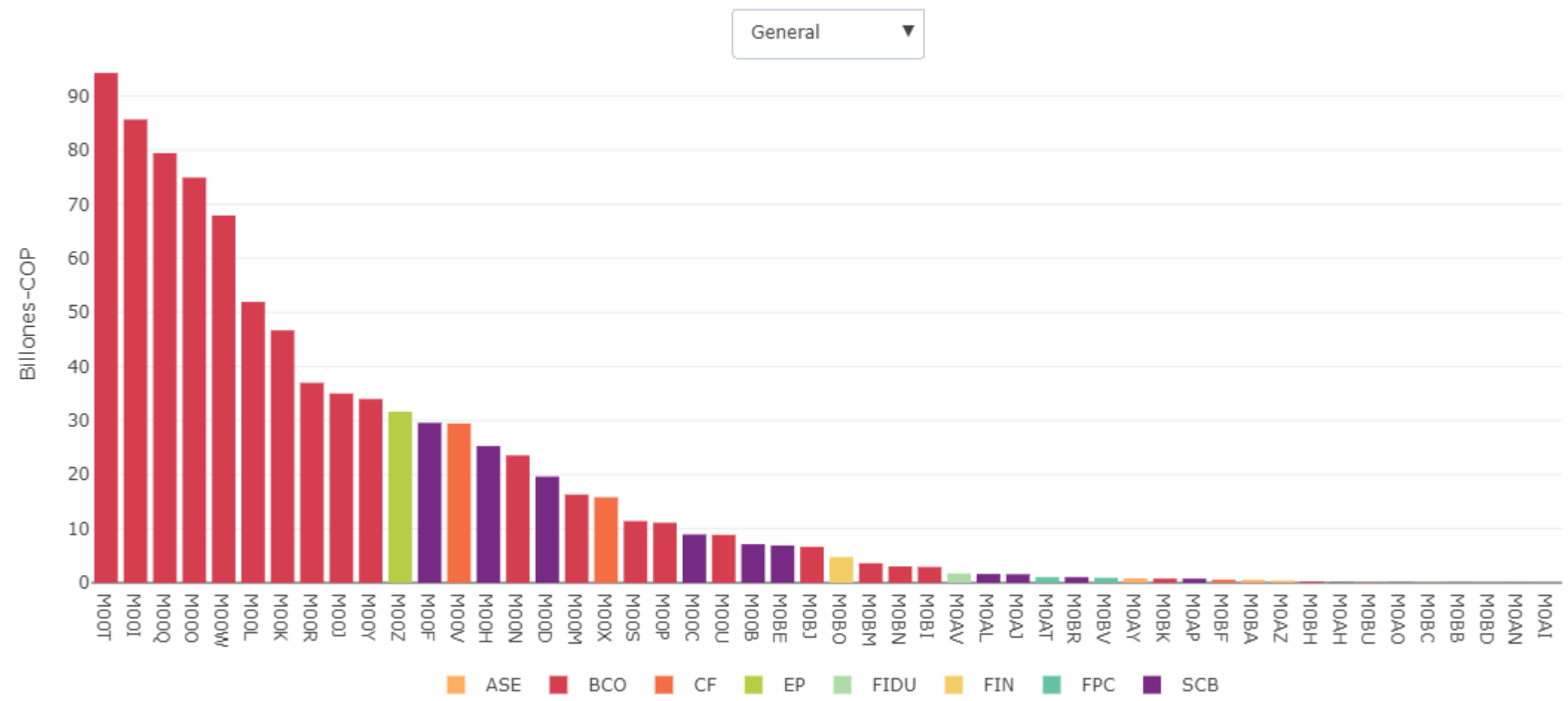
*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31



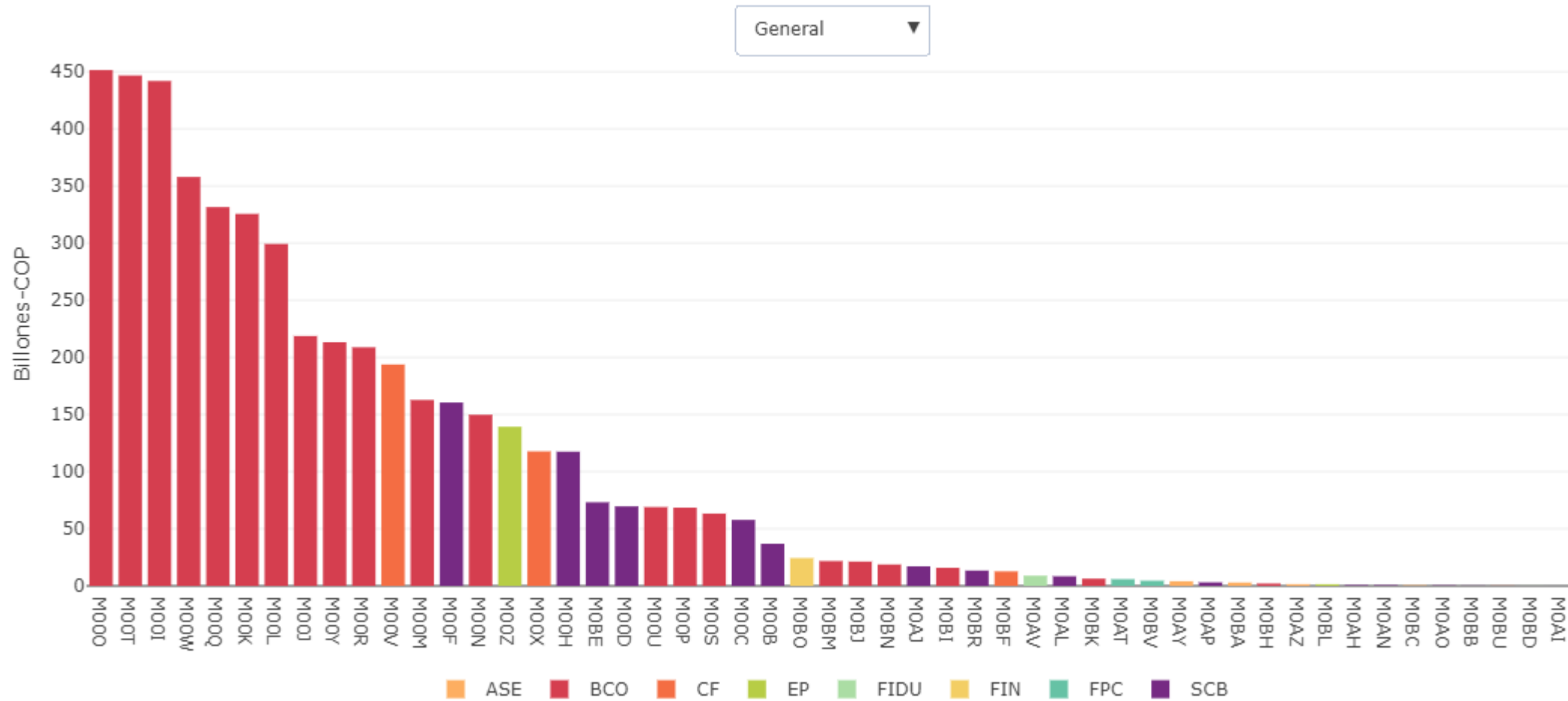
*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31



*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-30



*Datos del 2023-08-01 al 2023-08-31



*Datos del 2023-0 -01 al 2023-07-30

Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	Posición Abierta Compra Último Día M-COP	Posición Abierta Venta Último Día M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$121,670,455	\$121,671,134	\$119,341,847	\$119,341,880	\$123,107,544	\$123,107,551
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$52,808,658	\$52,808,658	\$52,480,770	\$52,480,770	\$57,717,321	\$57,717,321
Derivados	OIS	OIS IBR	\$18,567,824	\$18,567,824	\$18,182,667	\$18,182,667	\$16,725,388	\$16,725,388
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$13,794,872	\$13,794,872	\$10,421,306	\$10,421,306	\$10,946,969	\$10,946,969
Derivados	TRM	F. TRM	\$12,700,519	\$12,700,519	\$14,630,639	\$14,630,639	\$15,283,927	\$15,283,927
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$10,870,000	\$10,870,000	\$10,870,024	\$10,870,024	\$10,473,041	\$10,473,041
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$6,416,175	\$6,416,175	\$6,391,654	\$6,391,654	\$6,275,809	\$6,275,809
Derivados	F. TES	F. TES	\$2,748,559	\$2,748,559	\$2,580,454	\$2,580,454	\$2,589,006	\$2,589,006
Renta Fija	TES	TTV DP	\$1,452,814	\$1,452,814	\$1,484,454	\$1,484,454	\$1,000,684	\$1,000,684

Registros del 1 al 9 de un total de 18

Anterior 1 2 Siguiente

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31

Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	Posición Abierta Compra Último Día M-COP	Posición Abierta Venta Último Día M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compra Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Venta Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,186,635	\$1,186,635	\$1,168,165	\$1,168,165	\$985,899	\$985,899
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$561,300	\$561,300	\$726,916	\$726,916	\$704,183	\$704,183
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$252,499	\$252,499	\$264,866	\$264,866	\$247,178	\$247,178
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$239,111	\$239,789	\$75,499	\$75,532	\$96,981	\$96,988
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$41,925	\$41,925	\$33,526	\$33,526	\$26,173	\$26,173
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$14,899	\$14,899	\$16,015	\$16,015	\$15,547	\$15,547
Derivados	TRM	Op. TRM	\$13,184	\$13,184	\$13,080	\$13,080	\$17,474	\$17,474
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$980	\$980	\$1,085	\$1,085	\$1,147	\$1,147
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$504	\$504	\$728	\$728	\$819	\$819

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior 1 **2** Siguiente

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31

Rango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$122,000	\$147,357	\$107,244
1M-3M	\$228,000	\$229,571	\$210,971
3M-6M	\$63,500	\$179,405	\$294,054
6M-9M	\$185,000	\$202,667	\$213,640
9M-1Y	\$322,000	\$381,762	\$210,802
1Y-2Y	\$141,500	\$176,786	\$432,917
2Y-5Y	\$312,000	\$354,714	\$373,504
5Y-10Y	\$119,500	\$104,214	\$126,310

Registros del 1 al 8 de un total de 8

Anterior 1 Siguiente

*Datos del 2023-03-01 al 2023-08-31



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte