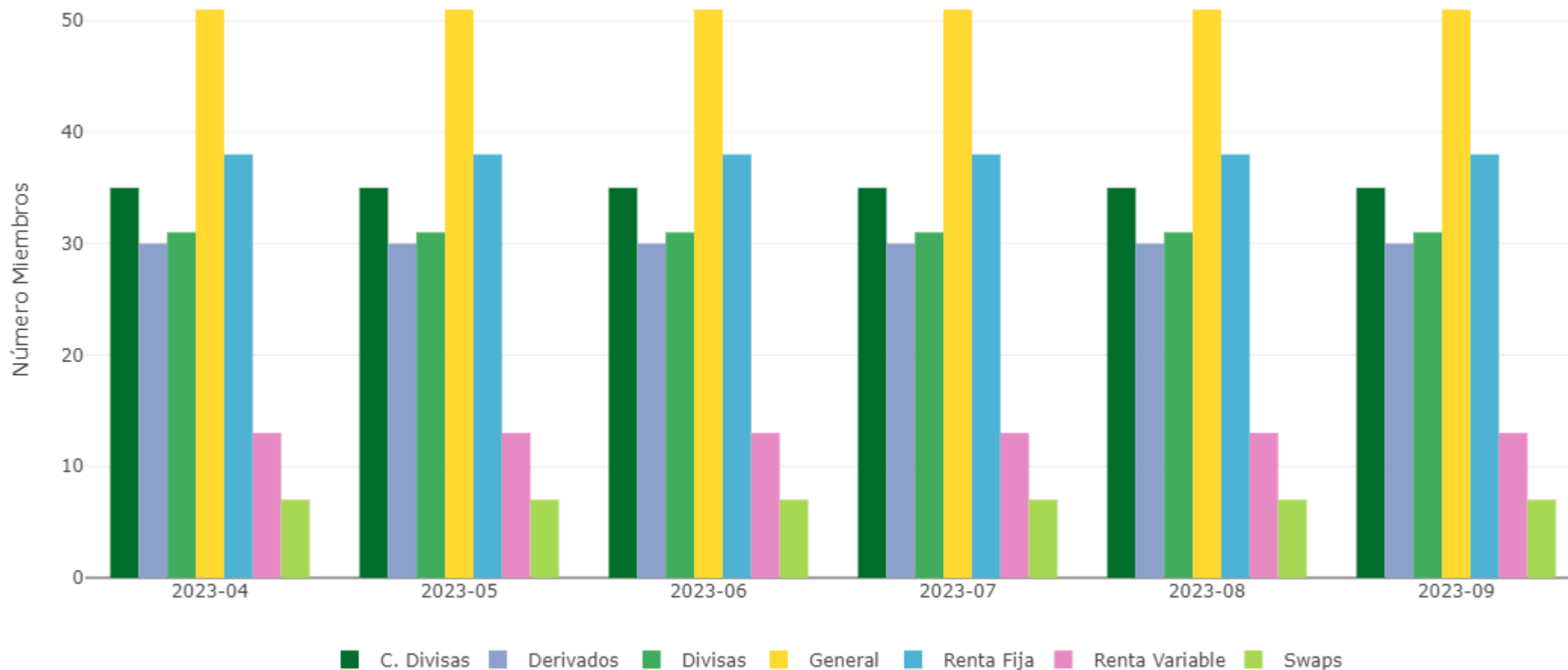


Evolución de Mercado

Septiembre 2023



*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

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%	\$21,076,186	\$19,061,260	\$400,286,460	\$19,727,486	\$2,367,298,286
Renta Fija	TES	Simultaneas	43.68%	\$9,206,062	\$9,014,041	\$189,294,854	\$8,252,023	\$990,242,729
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	24.62%	\$5,188,219	\$5,046,772	\$105,982,212	\$5,764,736	\$691,768,260
Derivados	TRM	NDF FX FWD	20.92%	\$4,409,509	\$2,916,415	\$61,244,724	\$2,939,074	\$352,688,880
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.43%	\$722,571	\$840,398	\$17,648,365	\$802,265	\$96,271,859
Derivados	F. TES	F. TES	2.01%	\$423,062	\$64,737	\$1,359,487	\$137,325	\$16,479,029
Renta Fija	TES	TTV DP	1.90%	\$400,603	\$598,772	\$12,574,219	\$1,005,300	\$120,635,971
Derivados	OIS	OIS IBR	1.65%	\$347,490	\$137,845	\$2,894,736	\$151,230	\$18,147,652
Derivados	TRM	F. TRM	0.88%	\$185,195	\$242,190	\$5,085,986	\$489,016	\$58,681,930

Registros del 1 al 9 de un total de 19

Anterior 2 3 Siguiete

*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

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.	0.48%	\$101,107	\$101,106	\$2,123,218	\$101,166	\$12,139,873
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.42%	\$87,782	\$80,135	\$1,682,844	\$57,903	\$6,948,349
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$3,308	\$9,032	\$189,679	\$7,890	\$946,853
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$533	\$1,420	\$29,814	\$683	\$81,920
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$393	\$145	\$3,040	\$81	\$9,684
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$351	\$742	\$15,588	\$589	\$70,673
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$104	\$2,189	\$457	\$54,883
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$2,500	\$52,505	\$4,728	\$567,349
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$428	\$51,391

Registros del 10 al 18 de un total de 19

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

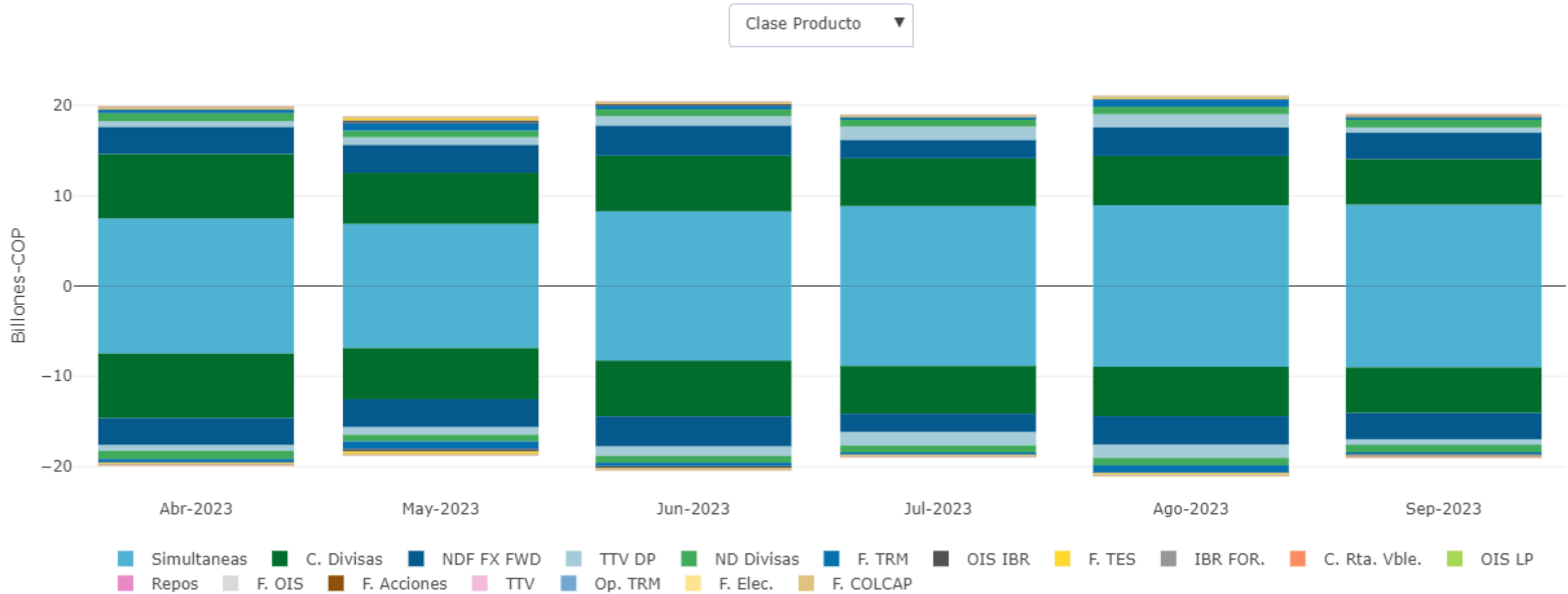
*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

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	\$4,905	\$103,000	\$12,592	\$1,511,000

Registros del 19 al 19 de un total de 19

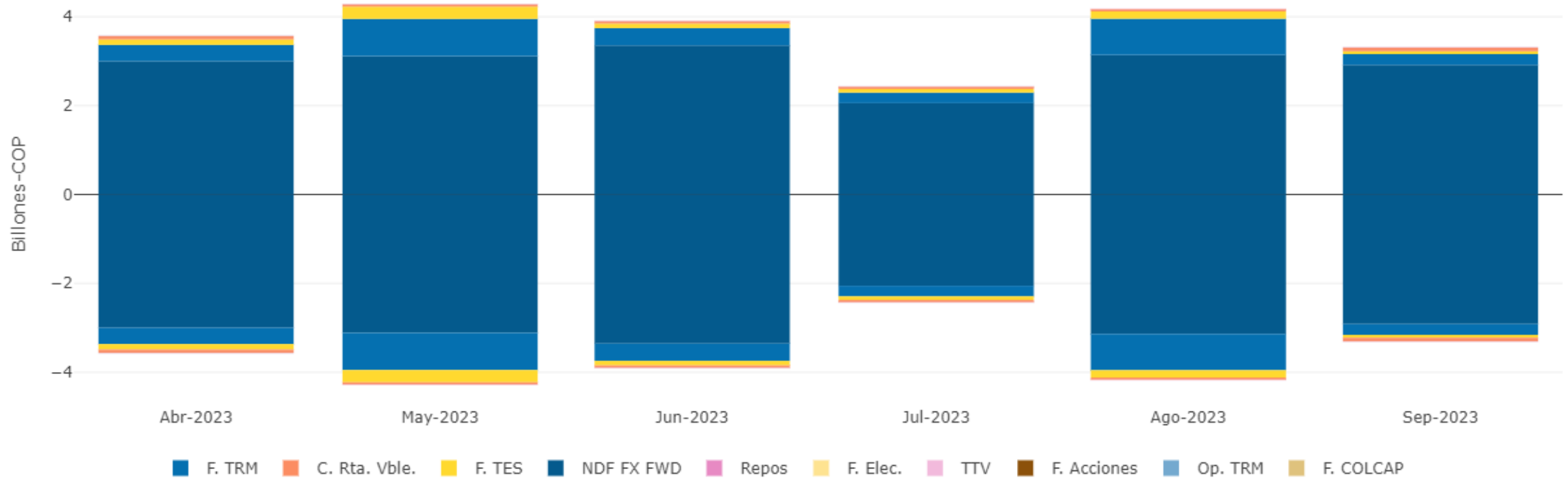
*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

Anterior 1 2 **3** Siguiente

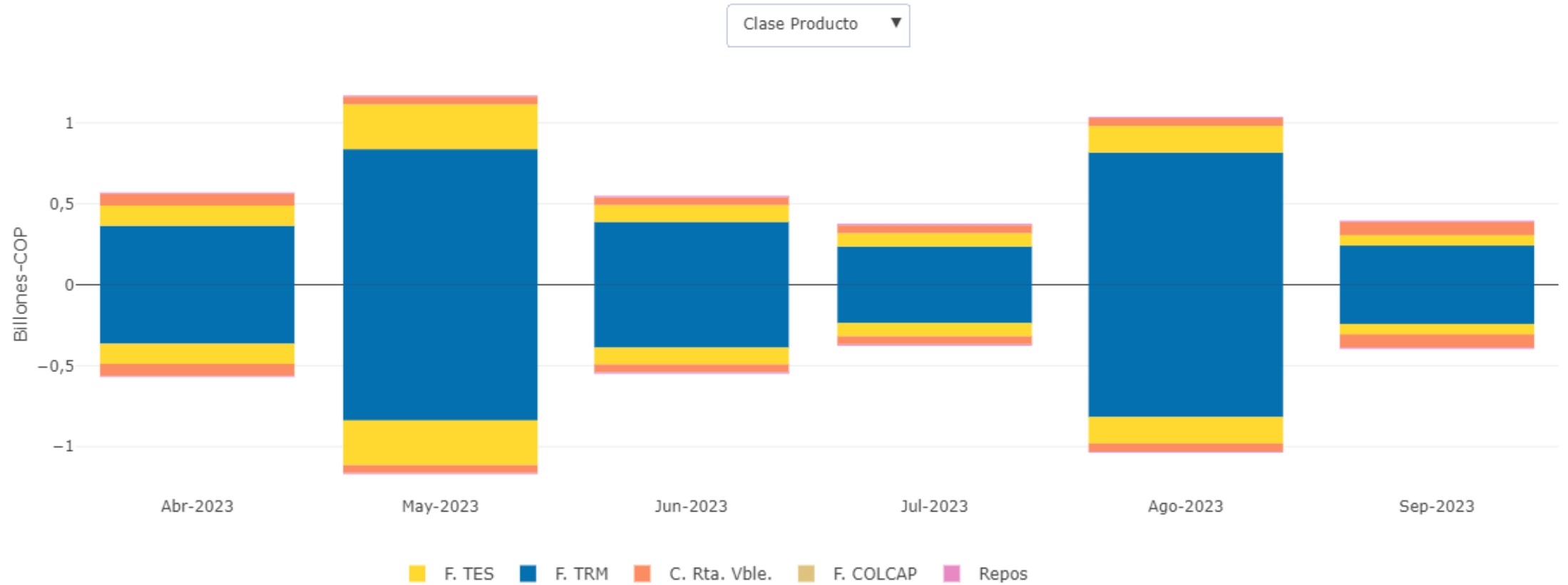


*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

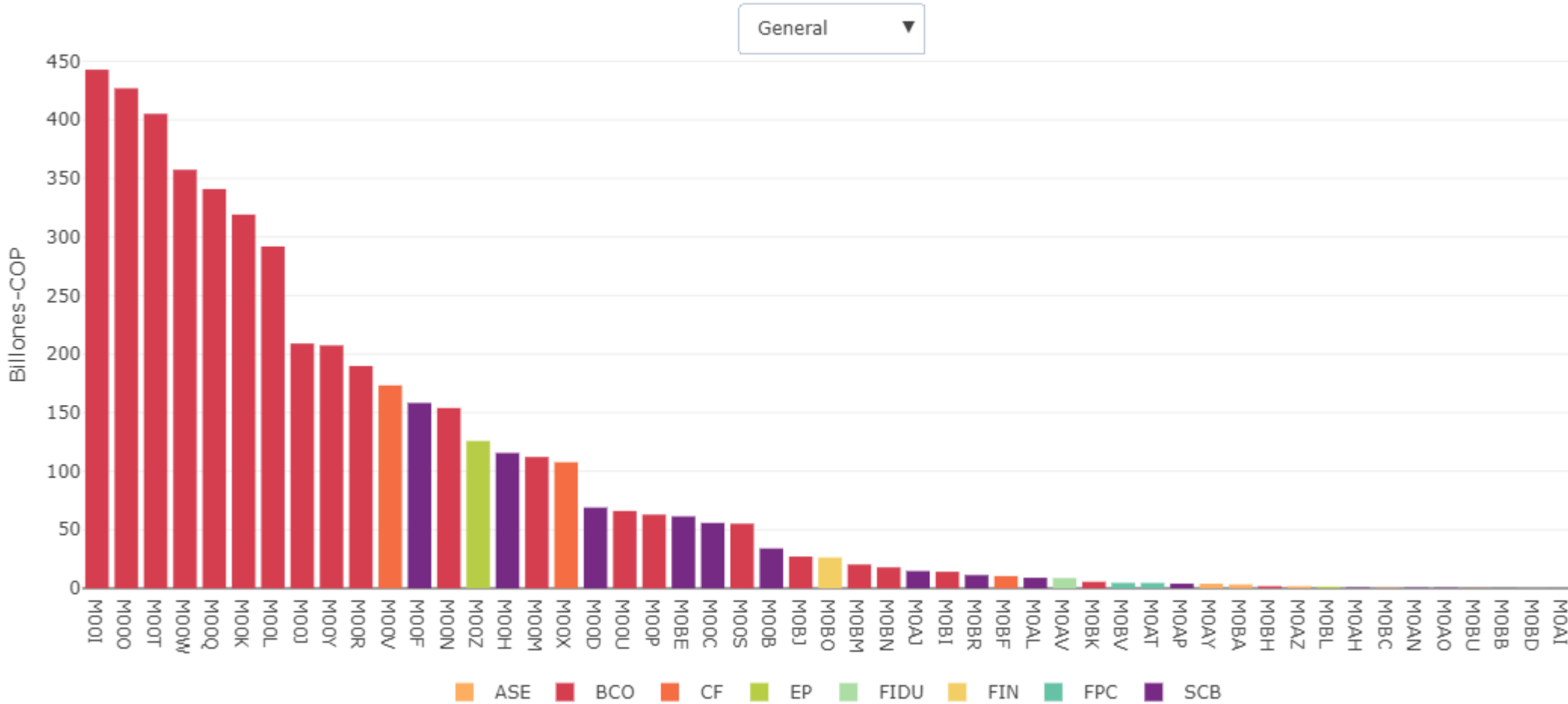
Clase Producto ▼



*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29



*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29



*Datos del 2023-04 -01 al 2023-09-29

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	\$123,547,464	\$123,547,464	\$118,358,196	\$118,358,196	\$121,787,605	\$121,787,612
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$56,257,644	\$56,257,644	\$53,507,579	\$53,507,579	\$55,844,948	\$55,844,948
Derivados	OIS	OIS IBR	\$18,828,539	\$18,828,539	\$18,494,560	\$18,494,560	\$17,866,464	\$17,866,464
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$14,950,935	\$14,950,935	\$12,201,825	\$12,201,825	\$10,824,881	\$10,824,881
Derivados	TRM	F. TRM	\$12,575,829	\$12,575,829	\$12,433,711	\$12,433,711	\$14,615,735	\$14,615,735
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$10,449,000	\$10,449,000	\$10,610,095	\$10,610,095	\$10,646,471	\$10,646,471
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$6,499,914	\$6,499,914	\$6,485,442	\$6,485,442	\$6,348,796	\$6,348,796
Derivados	F. TES	F. TES	\$1,288,257	\$1,288,257	\$1,602,224	\$1,602,224	\$2,436,605	\$2,436,605
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,213,903	\$1,213,903	\$1,196,171	\$1,196,171	\$1,065,124	\$1,065,124

Registros del 1 al 9 de un total de 18

Anterior 1 2 Siguiete

*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

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
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$664,498	\$664,498	\$746,462	\$746,462	\$717,137	\$717,137
Renta Fija	TES	TTV DP	\$400,603	\$400,603	\$598,772	\$598,772	\$1,005,300	\$1,005,300
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$205,038	\$205,038	\$277,622	\$277,622	\$256,143	\$256,143
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$155,800	\$155,800	\$151,489	\$151,489	\$99,008	\$99,015
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$25,911	\$25,911	\$23,644	\$23,644	\$26,143	\$26,143
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$13,990	\$13,990	\$13,306	\$13,306	\$15,529	\$15,529
Derivados	TRM	Op. TRM	\$12,131	\$12,131	\$12,352	\$12,352	\$17,107	\$17,107
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$4,439	\$4,439	\$1,758	\$1,758	\$1,020	\$1,020
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$1,034	\$1,034	\$1,183	\$1,183	\$1,193	\$1,193

Registros del 10 al 18 de un total de 18

Anterior 1 **2** Siguiente

*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29

Rango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$80,000	\$186,667	\$130,013
1M-3M	\$106,000	\$127,619	\$216,679
3M-6M	\$268,500	\$209,595	\$268,233
6M-9M	\$139,000	\$108,429	\$182,079
9M-1Y	\$360,000	\$375,667	\$239,383
1Y-2Y	\$234,500	\$125,262	\$342,379
2Y-5Y	\$283,000	\$324,667	\$355,863
5Y-10Y	\$107,500	\$109,214	\$126,800

Registros del 1 al 8 de un total de 8

Anterior

1

Siguiente

*Datos del 2023-04-01 al 2023-09-29



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte