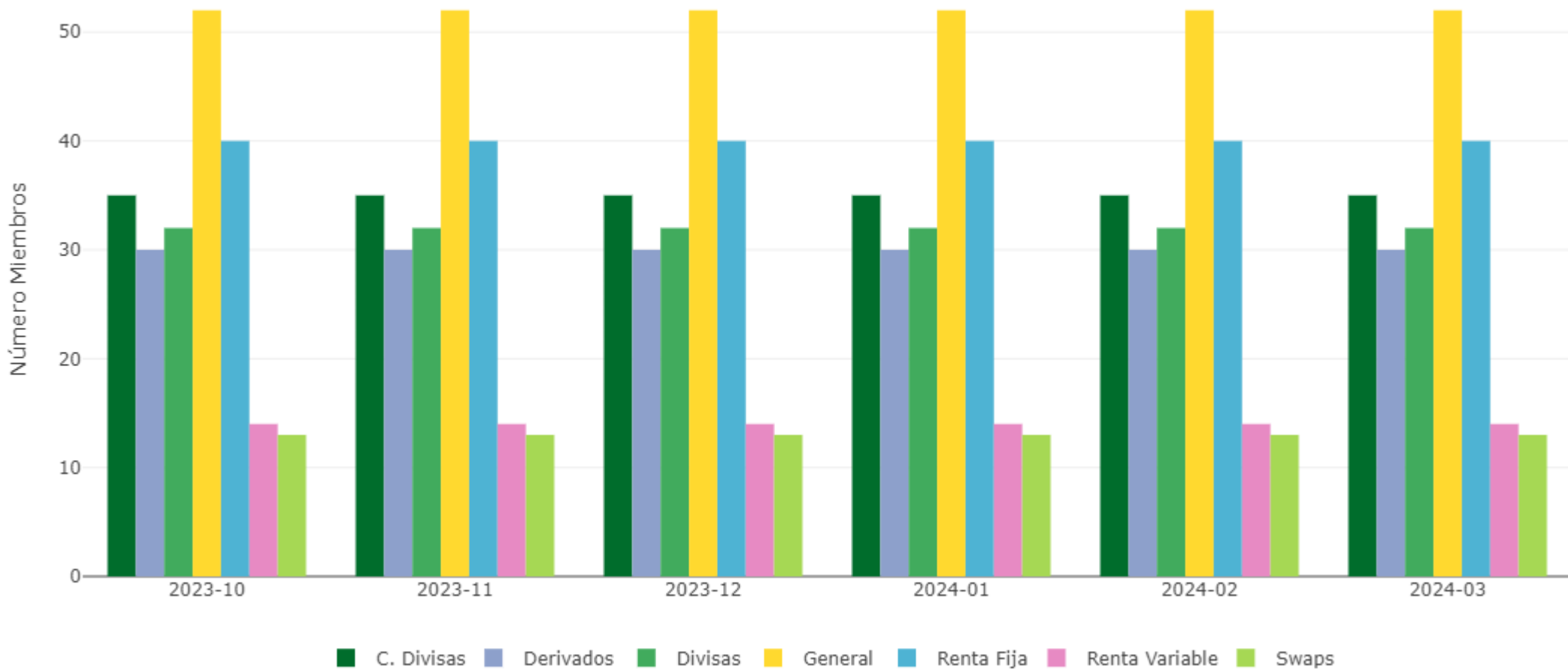


Evolución de Mercado

Marzo 2024



*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27

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%	\$17,970,749	\$23,660,564	\$425,890,152	\$21,995,322	\$2,617,443,278
Renta Fija	TES	Simultaneas	64.27%	\$11,550,380	\$12,956,872	\$233,223,694	\$10,939,856	\$1,301,842,905
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	25.65%	\$4,610,340	\$5,364,890	\$96,568,021	\$5,368,720	\$638,877,737
Derivados	TRM	NDF FX FWD	5.40%	\$969,878	\$3,026,801	\$54,482,422	\$2,880,944	\$342,832,374
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.39%	\$609,270	\$765,141	\$13,772,536	\$848,080	\$100,921,575
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	0.55%	\$98,000	\$253,056	\$4,555,000	\$70,189	\$8,352,500
Derivados	TRM	F. TRM	0.44%	\$78,350	\$691,614	\$12,449,050	\$730,682	\$86,951,122
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.22%	\$39,747	\$128,793	\$2,318,266	\$67,301	\$8,008,826
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.07%	\$12,004	\$9,654	\$173,777	\$6,755	\$803,827

Registros del 1 al 9 de un total de 20

*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27

Anterior 1 2 3 Siguiete

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	F. Elec.	F. Elec.	0.01%	\$1,404	\$687	\$12,373	\$1,309	\$155,786
Derivados	F. TES	F. TES	0.01%	\$1,180	\$56,515	\$1,017,271	\$163,372	\$19,441,258
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$195	\$3,325	\$59,844	\$1,129	\$134,346
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$106	\$1,911	\$52	\$6,152
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$18,349	\$330,278	\$7,574	\$901,330
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$69,642	\$8,287,348
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$102,757	\$12,228,095
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$354	\$6,373	\$149	\$17,705
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$308	\$5,551	\$62	\$7,402

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

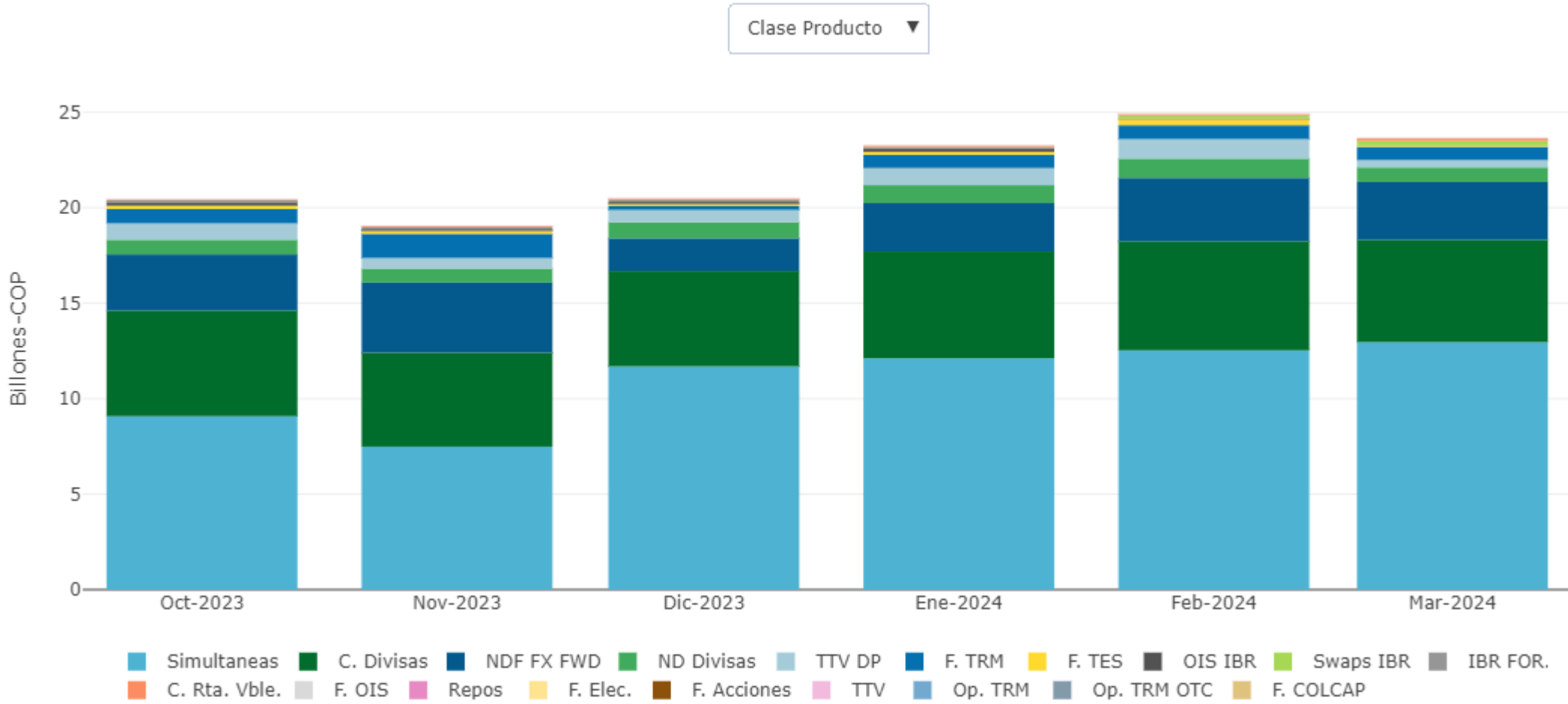
Registros del 10 al 18 de un total de 20
 *Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



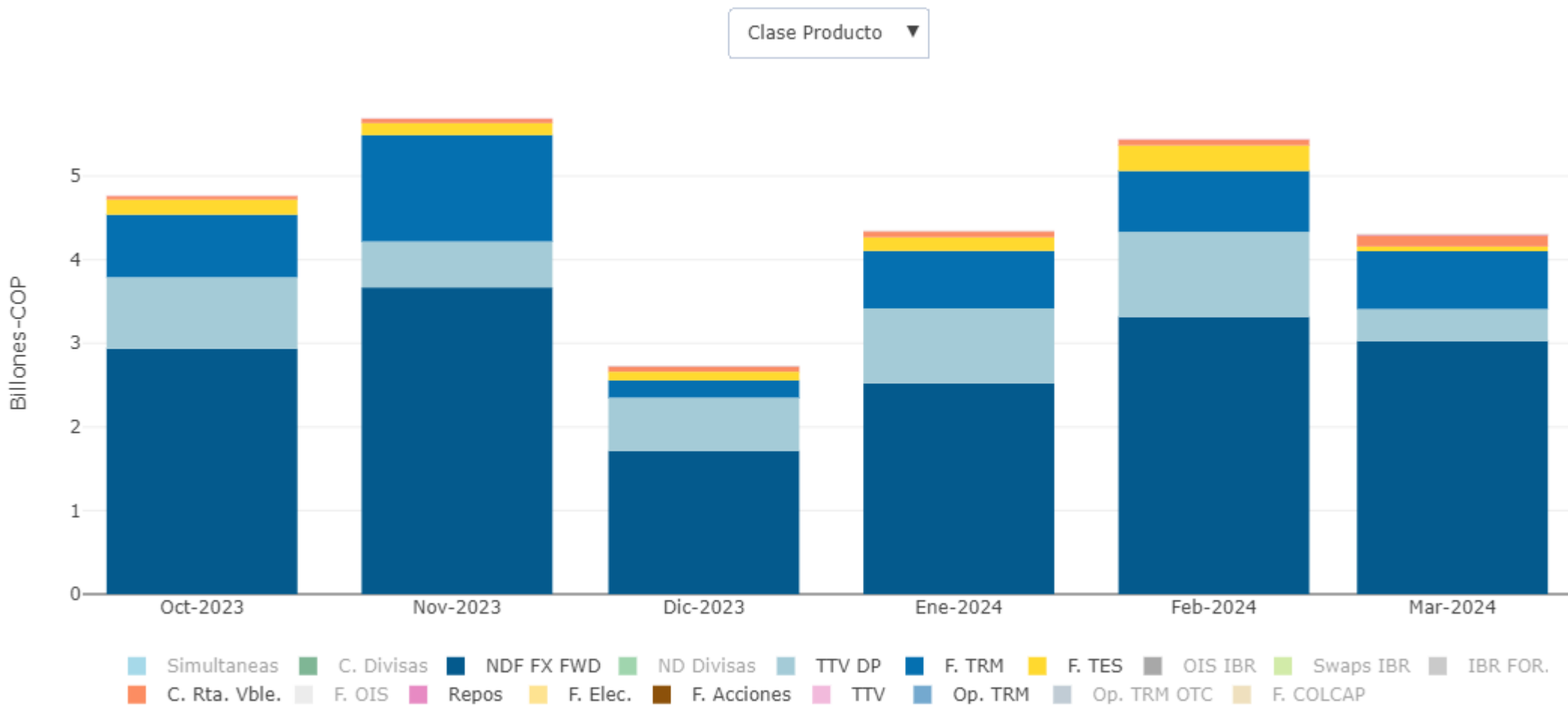
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Renta Fija	TES	TTV DP	0.00%	\$0	\$383,336	\$6,900,054	\$736,404	\$87,632,105
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$0	\$763	\$13,732	\$344	\$40,882

Anterior 1 2 3 Siguiete

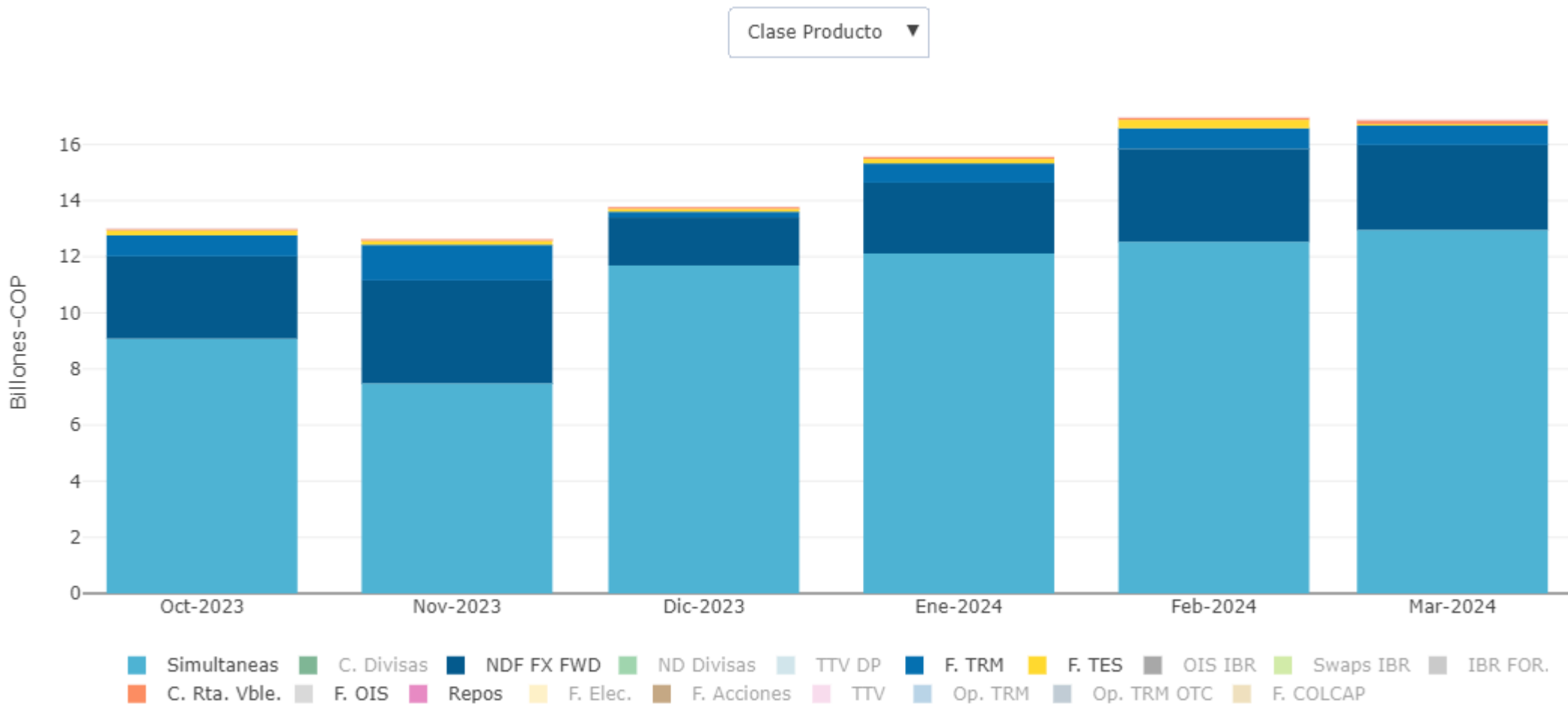
Registros del 19 al 20 de un total de 20
*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



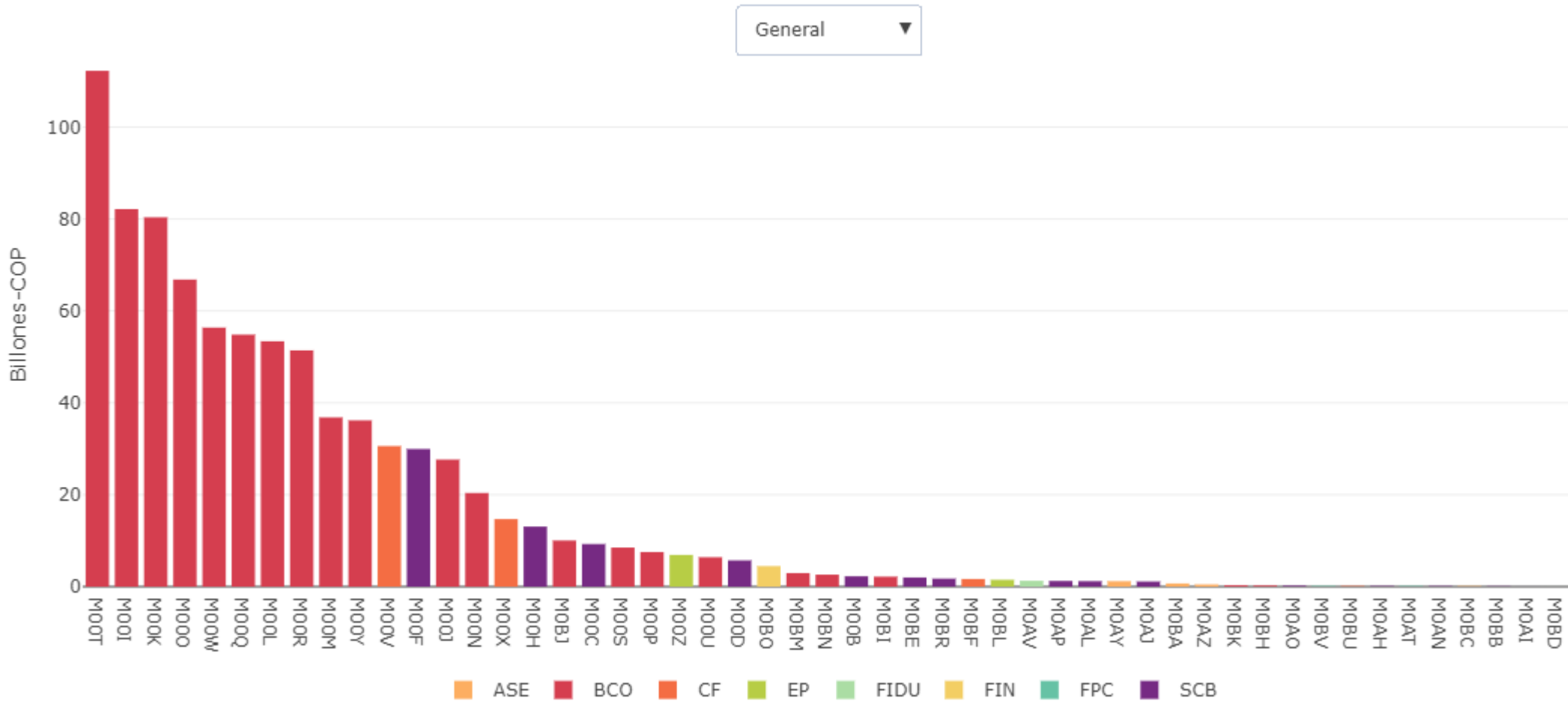
*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



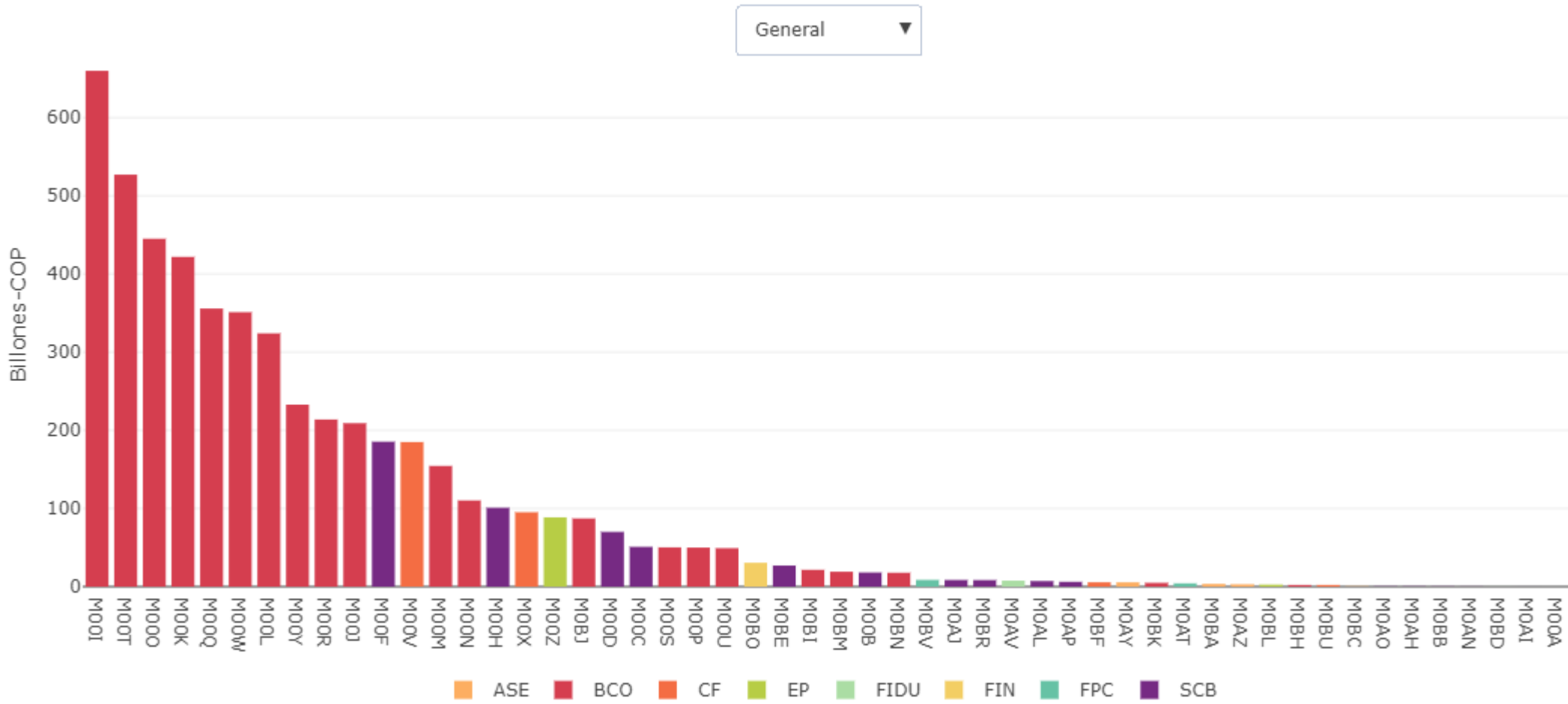
*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



*Datos del 2024-03-01 al 2024-03-27



*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27

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	\$126,185,740	\$126,185,740	\$127,537,419	\$127,537,418	\$125,178,918	\$125,178,918
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$53,909,754	\$53,909,754	\$56,413,753	\$56,413,753	\$54,002,513	\$54,002,513
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$19,672,092	\$19,672,092	\$17,700,576	\$17,700,576	\$15,476,936	\$15,476,936
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$17,030,000	\$17,030,000	\$15,256,167	\$15,256,167	\$11,366,958	\$11,366,958
Derivados	OIS	OIS IBR	\$14,415,438	\$14,415,438	\$15,586,761	\$15,586,761	\$19,315,061	\$19,315,061
Derivados	TRM	F. TRM	\$12,850,416	\$12,850,416	\$13,063,257	\$13,063,257	\$13,246,913	\$13,246,913
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$3,352,196	\$3,352,196	\$3,904,397	\$3,904,397	\$5,909,830	\$5,909,830
Derivados	F. TES	F. TES	\$2,582,936	\$2,582,936	\$2,733,739	\$2,733,739	\$2,709,769	\$2,709,769
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,347,282	\$1,347,282	\$1,182,781	\$1,182,781	\$1,281,613	\$1,281,613

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 19

*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27

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	\$456,875	\$456,875	\$659,718	\$659,718	\$727,237	\$727,237
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$310,807	\$310,807	\$240,060	\$240,060	\$192,713	\$192,713
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$124,870	\$124,870	\$118,928	\$118,928	\$58,946	\$58,946
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$86,843	\$86,843	\$242,552	\$242,552	\$119,069	\$119,069
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$23,042	\$23,042	\$25,475	\$25,475	\$19,916	\$19,916
Derivados	TRM	Op. TRM	\$16,607	\$16,607	\$17,670	\$17,670	\$12,061	\$12,061
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$5,439	\$5,439	\$3,886	\$3,886	\$789	\$789
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$994	\$994	\$1,102	\$1,102	\$1,128	\$1,128
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$151	\$151	\$2,860	\$2,859	\$1,001	\$1,001

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



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
Renta Fija	TES	TTV DP	\$0	\$0	\$383,735	\$383,735	\$736,465	\$736,465

Anterior 1 2 **3** Siguiete

Registros del 19 al 19 de un total de 19
 *Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27

Rango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$465,000	\$600,611	\$204,193
1M-3M	\$1,060,000	\$718,333	\$248,920
3M-6M	\$783,500	\$775,639	\$325,483
6M-9M	\$347,000	\$324,222	\$378,160
9M-1Y	\$649,000	\$494,139	\$393,811
1Y-18M	\$229,000	\$389,278	\$407,563
18M-2Y	\$138,500	\$205,556	\$186,651
2Y-5Y	\$341,000	\$345,500	\$340,647
5Y-7Y	\$143,000	\$130,167	\$142,983
7Y-10Y	\$81,000	\$73,250	\$86,466

Anterior 1 Siguiente

Registros del 1 al 10 de un total de 10

*Datos del 2023-10-01 al 2024-03-27



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte