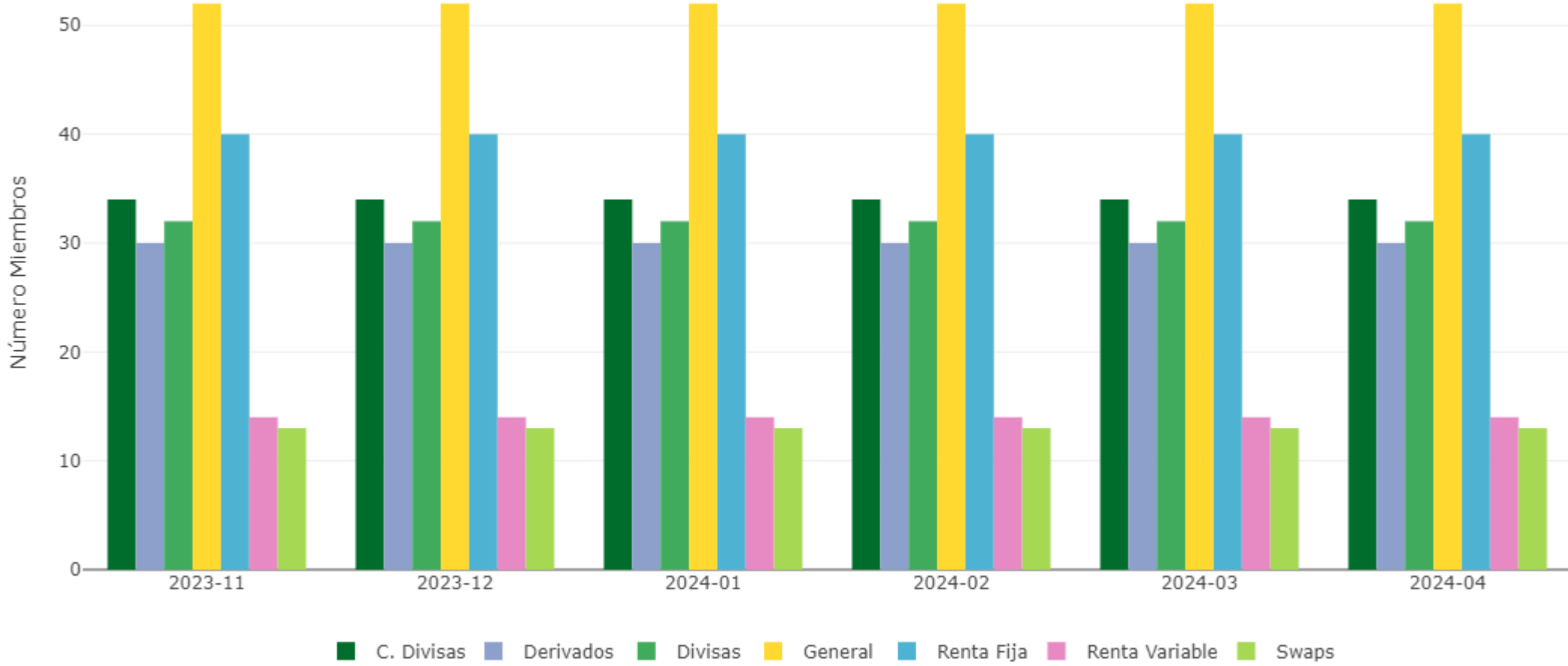


Evolución de Mercado

Abril 2024



*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30

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%	\$23,341,931	\$24,878,466	\$547,326,242	\$22,792,718	\$2,735,126,201
Renta Fija	TES	Simultaneas	57.00%	\$13,304,543	\$11,429,450	\$251,447,897	\$11,354,941	\$1,362,592,917
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	26.93%	\$6,286,888	\$6,856,818	\$150,849,988	\$5,611,688	\$673,402,515
Derivados	TRM	NDF FX FWD	10.24%	\$2,389,756	\$3,627,100	\$79,796,197	\$3,008,314	\$360,997,677
Derivados	F. TES	F. TES	1.97%	\$460,553	\$196,747	\$4,328,443	\$166,336	\$19,960,347
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	1.84%	\$430,605	\$892,838	\$19,642,444	\$869,967	\$104,396,057
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	0.99%	\$230,000	\$510,114	\$11,222,500	\$161,975	\$19,437,000
Derivados	TRM	F. TRM	0.68%	\$157,828	\$1,220,438	\$26,849,630	\$817,613	\$98,113,521
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.32%	\$74,753	\$127,969	\$2,815,314	\$83,067	\$9,968,048

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 20

*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30

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 Variable	Repos y TTV	Repos	0.03%	\$5,850	\$7,561	\$166,347	\$7,250	\$870,020
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$1,048	\$461	\$10,138	\$391	\$46,868
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$108	\$1,196	\$26,303	\$1,294	\$155,238
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$51	\$6,125
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$380	\$8,357	\$1,368	\$164,143
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$7,061	\$155,332	\$5,788	\$694,573
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$51,356	\$6,162,678
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$70,637	\$8,476,382
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$251	\$5,519	\$194	\$23,224

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

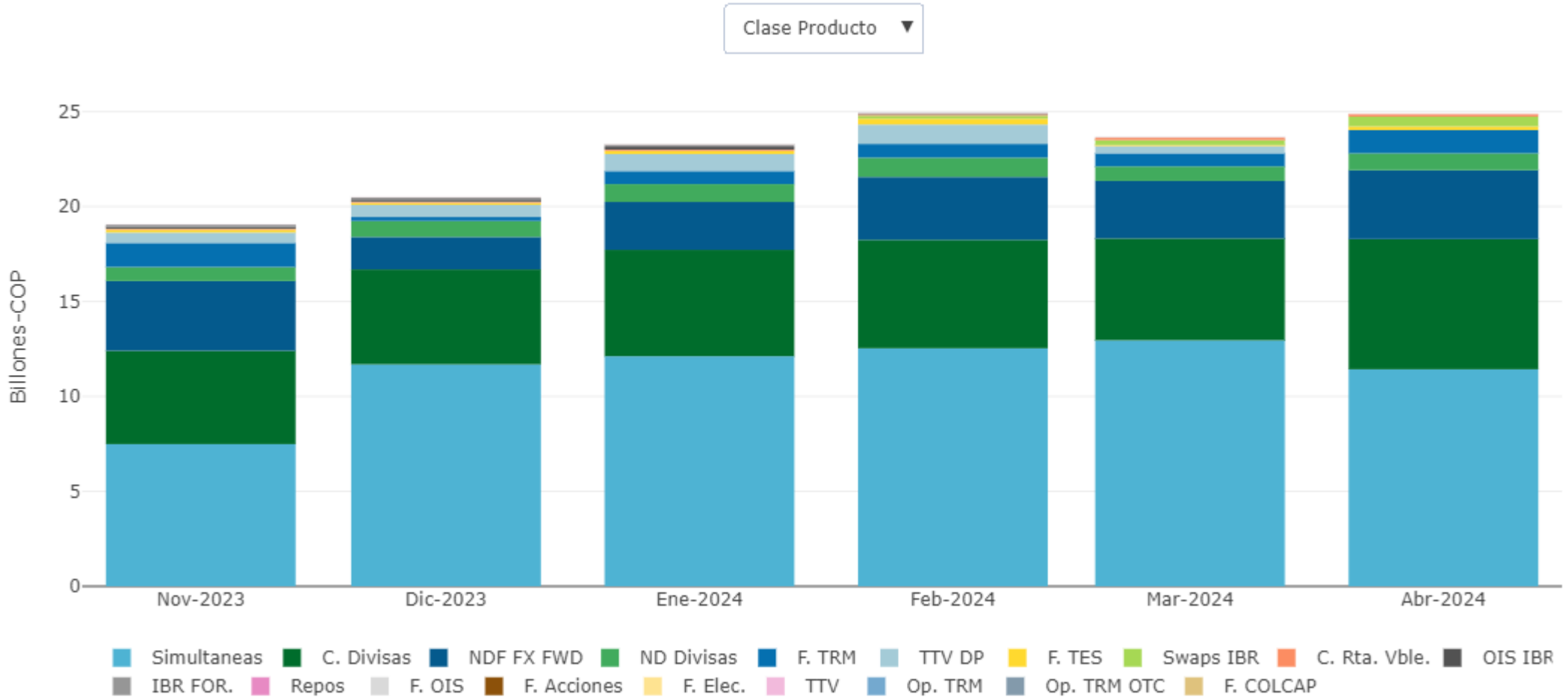
Registros del 10 al 18 de un total de 20
 *Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30



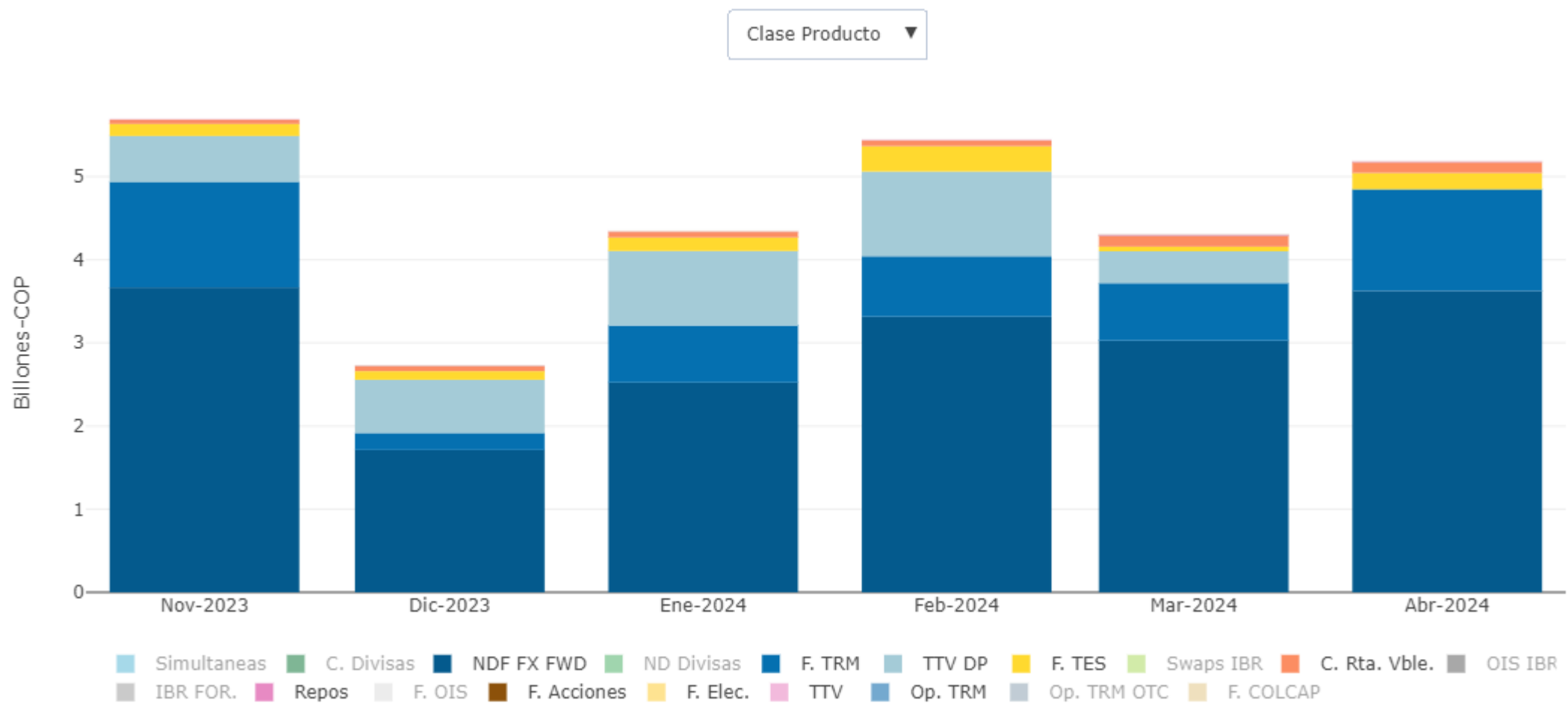
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$83	\$1,832	\$76	\$9,146
Renta Fija	TES	TTV DP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$580,414	\$69,649,720

Anterior 1 2 3 Siguiete

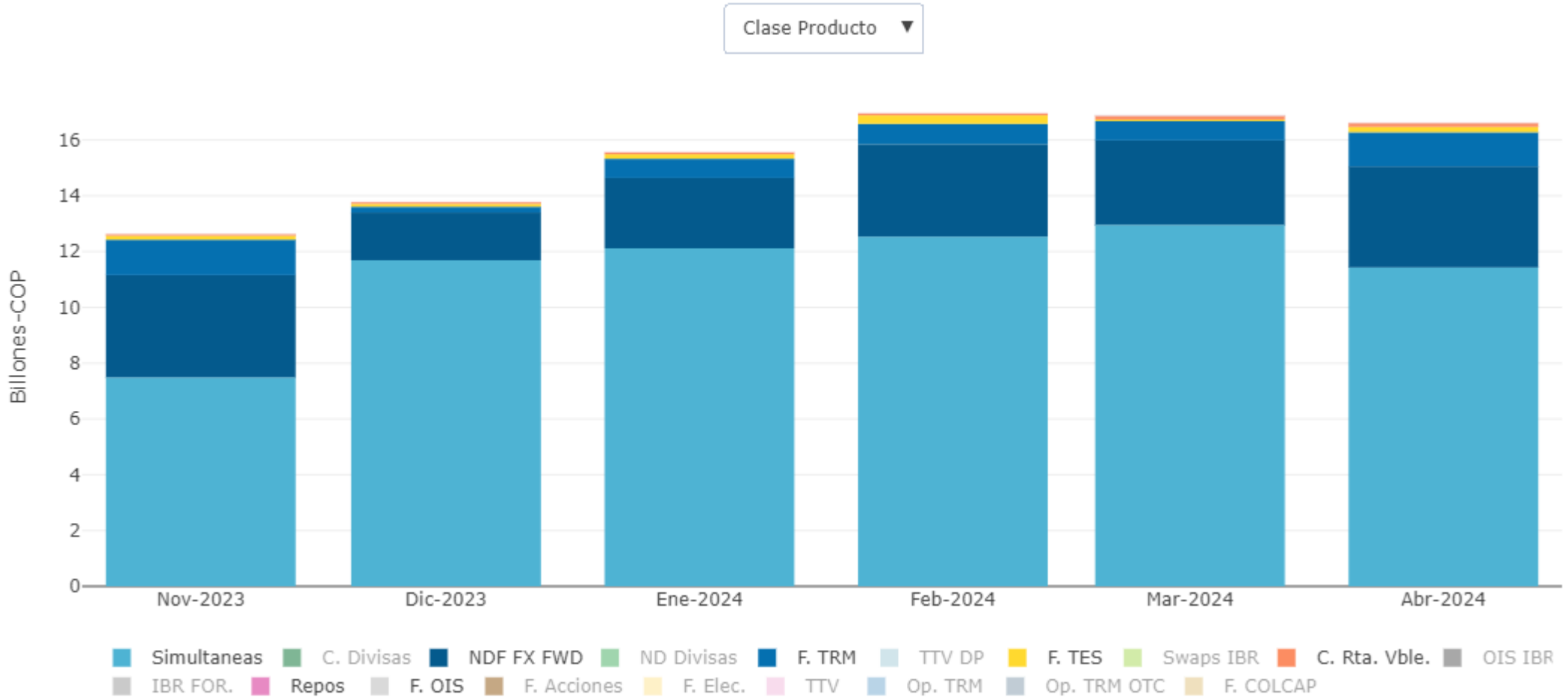
Registros del 19 al 20 de un total de 20
*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30



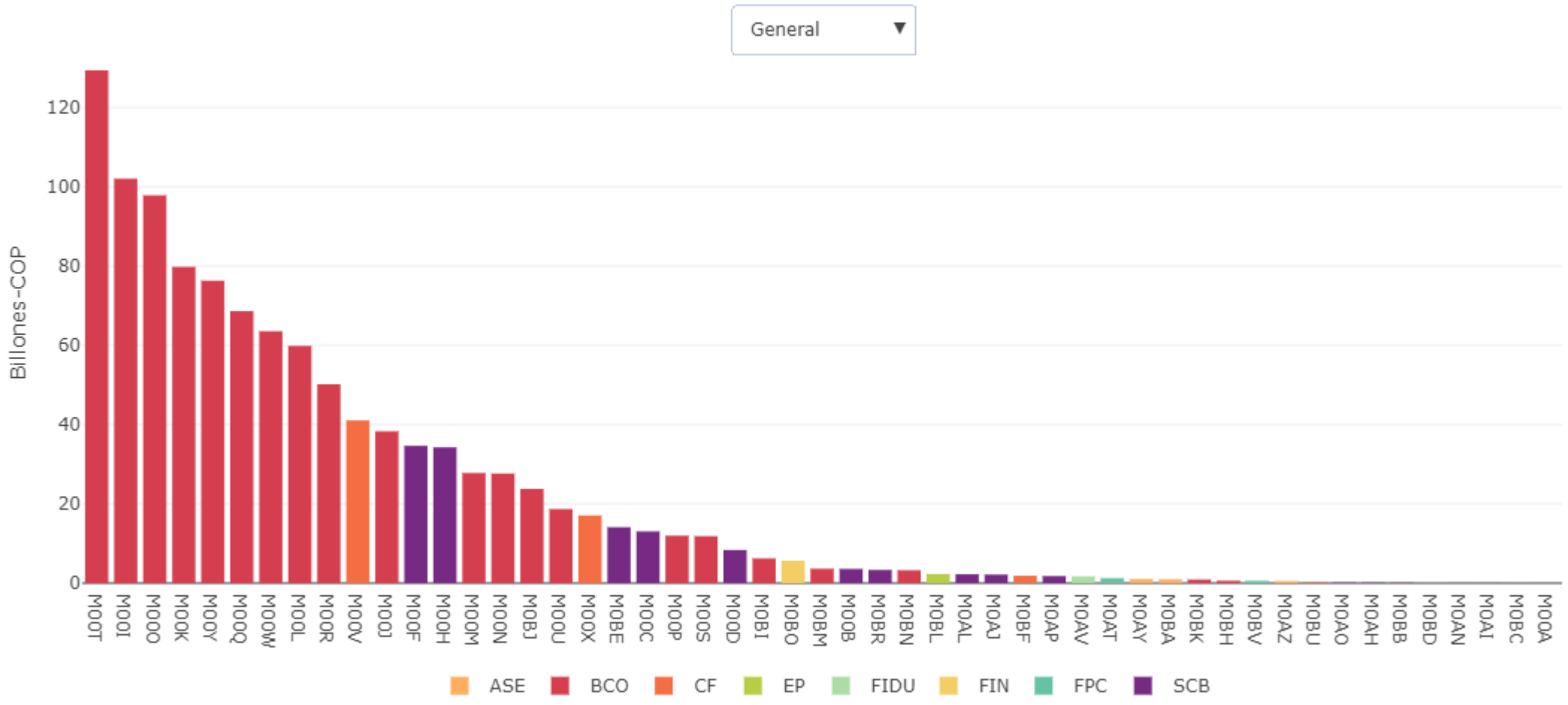
*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30

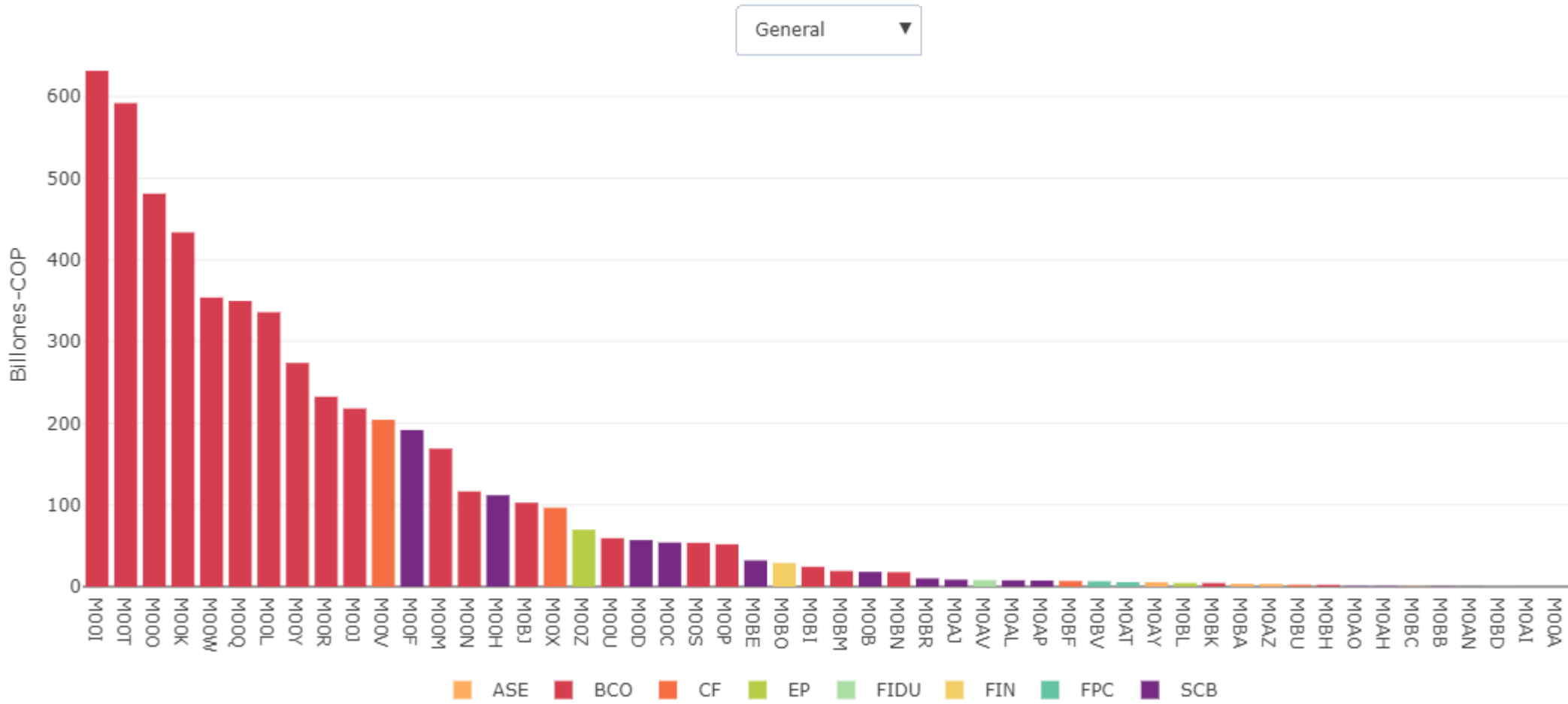


*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30



*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30





*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	\$140,532,792	\$140,532,792	\$133,110,640	\$133,110,674	\$127,097,028	\$127,097,034
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$59,271,373	\$59,271,373	\$58,746,507	\$58,746,507	\$54,620,672	\$54,620,672
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$26,365,500	\$26,365,500	\$21,999,455	\$21,999,455	\$13,475,542	\$13,475,542
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$18,515,909	\$18,515,909	\$15,829,552	\$15,829,552	\$16,104,459	\$16,104,459
Derivados	TRM	F. TRM	\$18,032,512	\$18,032,512	\$14,616,202	\$14,616,202	\$13,474,339	\$13,474,339
Derivados	OIS	OIS IBR	\$9,915,939	\$9,915,939	\$13,060,111	\$13,060,111	\$18,118,712	\$18,118,712
Derivados	F. TES	F. TES	\$4,156,249	\$4,156,249	\$3,237,564	\$3,237,564	\$2,980,609	\$2,980,609
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$1,983,031	\$1,983,031	\$2,706,701	\$2,706,701	\$5,207,394	\$5,207,394
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,388,410	\$1,388,410	\$1,444,489	\$1,444,489	\$1,306,752	\$1,306,752

Anterior 2 3 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 19

*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30

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
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$375,126	\$375,126	\$804,909	\$804,909	\$756,592	\$756,592
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$232,155	\$232,155	\$268,468	\$268,468	\$209,100	\$209,100
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$126,548	\$126,548	\$128,610	\$128,610	\$78,333	\$78,333
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$124,288	\$124,288	\$221,266	\$221,300	\$145,905	\$145,912
Derivados	TRM	Op. TRM	\$21,357	\$21,357	\$19,076	\$19,076	\$13,447	\$13,447
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$17,695	\$17,695	\$21,014	\$21,014	\$20,919	\$20,919
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$4,190	\$4,190	\$4,315	\$4,315	\$1,563	\$1,563
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$1,505	\$1,505	\$1,384	\$1,384	\$1,092	\$1,092
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$1,004	\$1,004	\$1,018	\$1,018	\$1,123	\$1,123

*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	\$0	\$0	\$580,474	\$580,474

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 19 al 19 de un total de 19
*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30

Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$3,289,000	\$1,774,409	\$512,700
1M-3M	\$980,000	\$1,101,000	\$424,875
3M-6M	\$1,222,500	\$1,056,841	\$483,025
6M-9M	\$296,500	\$339,114	\$409,088
9M-1Y	\$961,500	\$777,864	\$430,908
1Y-18M	\$479,500	\$290,455	\$411,438
18M-2Y	\$144,000	\$157,750	\$184,042
2Y-5Y	\$410,500	\$363,477	\$353,221
5Y-7Y	\$129,500	\$138,273	\$138,350
7Y-10Y	\$67,500	\$76,273	\$80,963

Anterior

1

Siguiente

Registros del 1 al 10 de un total de 10

*Datos del 2023-11-01 al 2024-04-30



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte