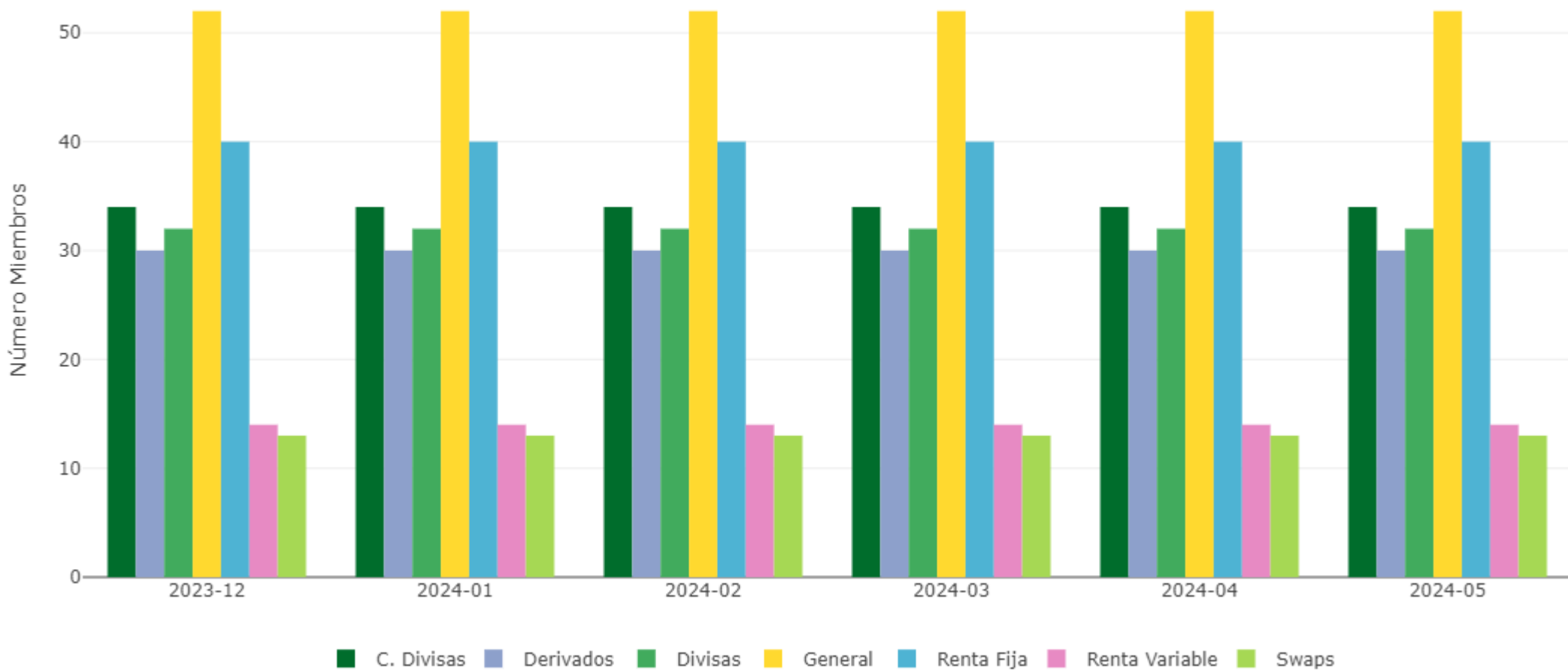


Evolución de Mercado

Mayo 2024



*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31

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%	\$20,760,967	\$21,096,413	\$443,024,671	\$23,115,698	\$2,796,999,441
Renta Fija	TES	Simultaneas	49.42%	\$10,259,534	\$10,348,275	\$217,313,765	\$11,819,294	\$1,430,134,536
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	26.99%	\$5,603,117	\$5,832,814	\$122,489,091	\$5,764,252	\$697,474,432
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.18%	\$2,528,585	\$2,989,178	\$62,772,729	\$2,896,033	\$350,419,998
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	4.32%	\$896,503	\$788,691	\$16,562,507	\$877,588	\$106,188,187
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	2.78%	\$576,953	\$107,788	\$2,263,542	\$92,830	\$11,232,461
Derivados	F. TES	F. TES	2.57%	\$532,598	\$561,707	\$11,795,841	\$238,425	\$28,849,412
Derivados	TRM	F. TRM	1.23%	\$254,589	\$214,357	\$4,501,505	\$638,131	\$77,213,874
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	0.47%	\$98,000	\$239,929	\$5,038,500	\$201,773	\$24,414,500

Anterior 2 3

Registros del 1 al 9 de un total de 20

*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31

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
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.04%	\$7,807	\$10,517	\$220,862	\$8,039	\$972,662
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$3,069	\$1,869	\$39,259	\$683	\$82,639
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$214	\$199	\$4,187	\$1,296	\$156,784
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$5	\$107	\$44	\$5,296
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$750	\$15,756	\$1,391	\$168,252
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$5,155	\$623,734
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$34,219	\$4,140,531
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$51,733	\$6,259,715
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$334	\$7,021	\$243	\$29,400

Anterior 1 **2** 3 Siguiente

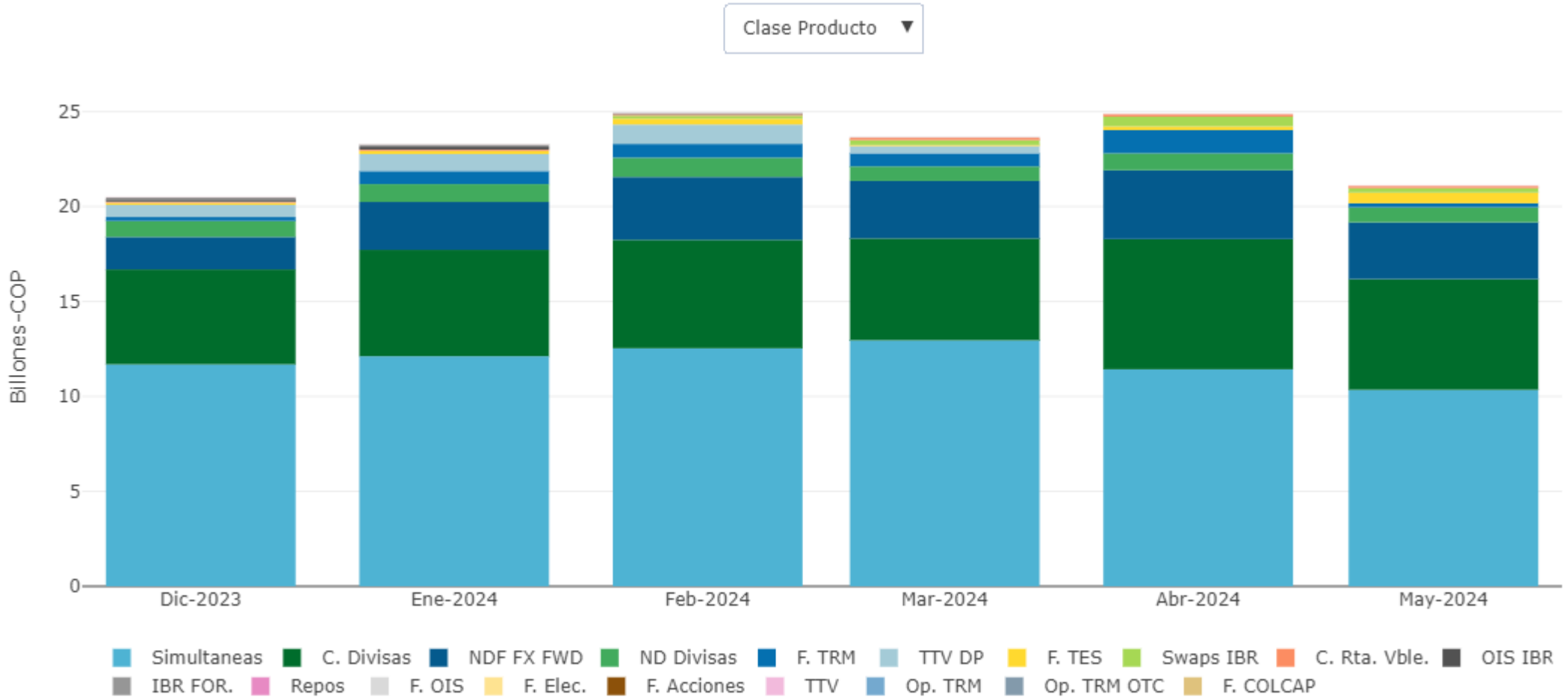
Registros del 10 al 18 de un total de 20
*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31



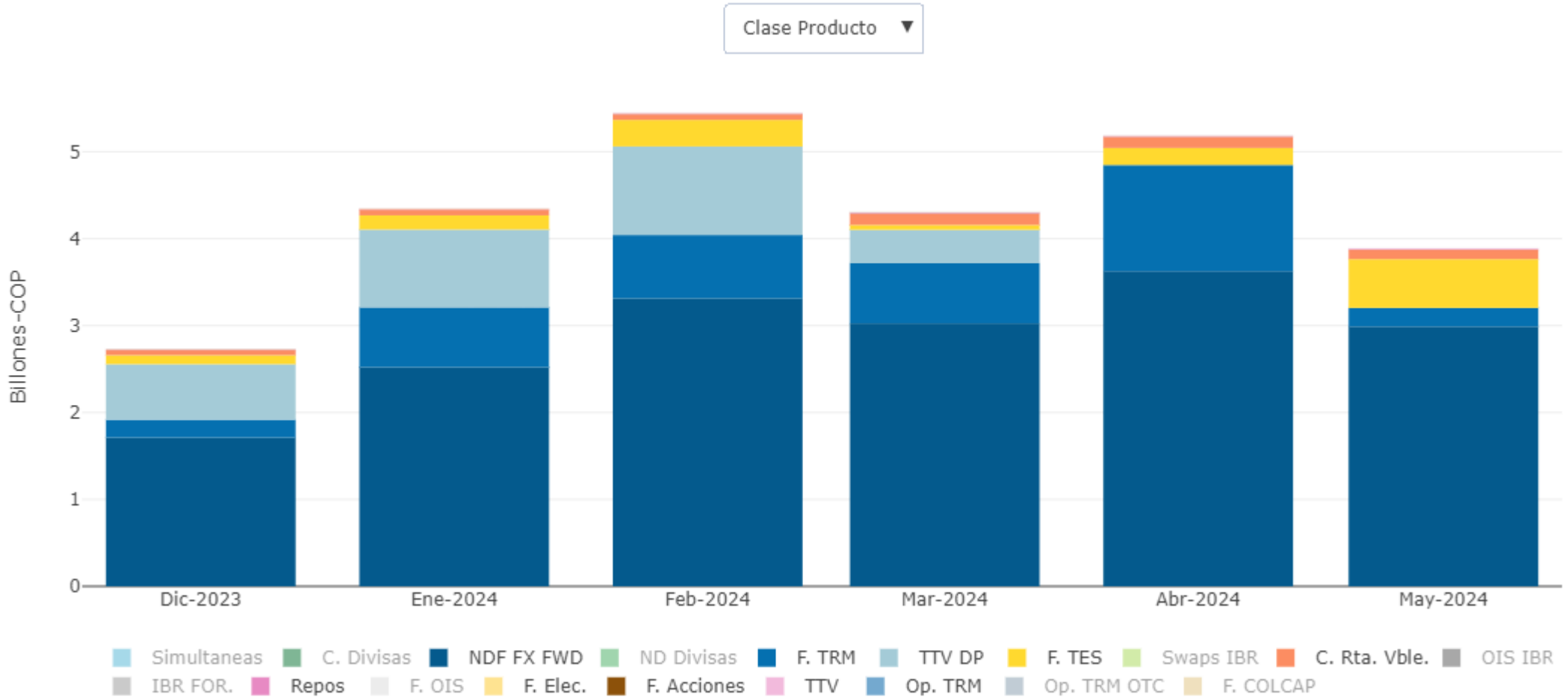
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$71	\$8,565
Renta Fija	TES	TTV DP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$484,500	\$58,624,465

Anterior 1 2 3 Siguiete

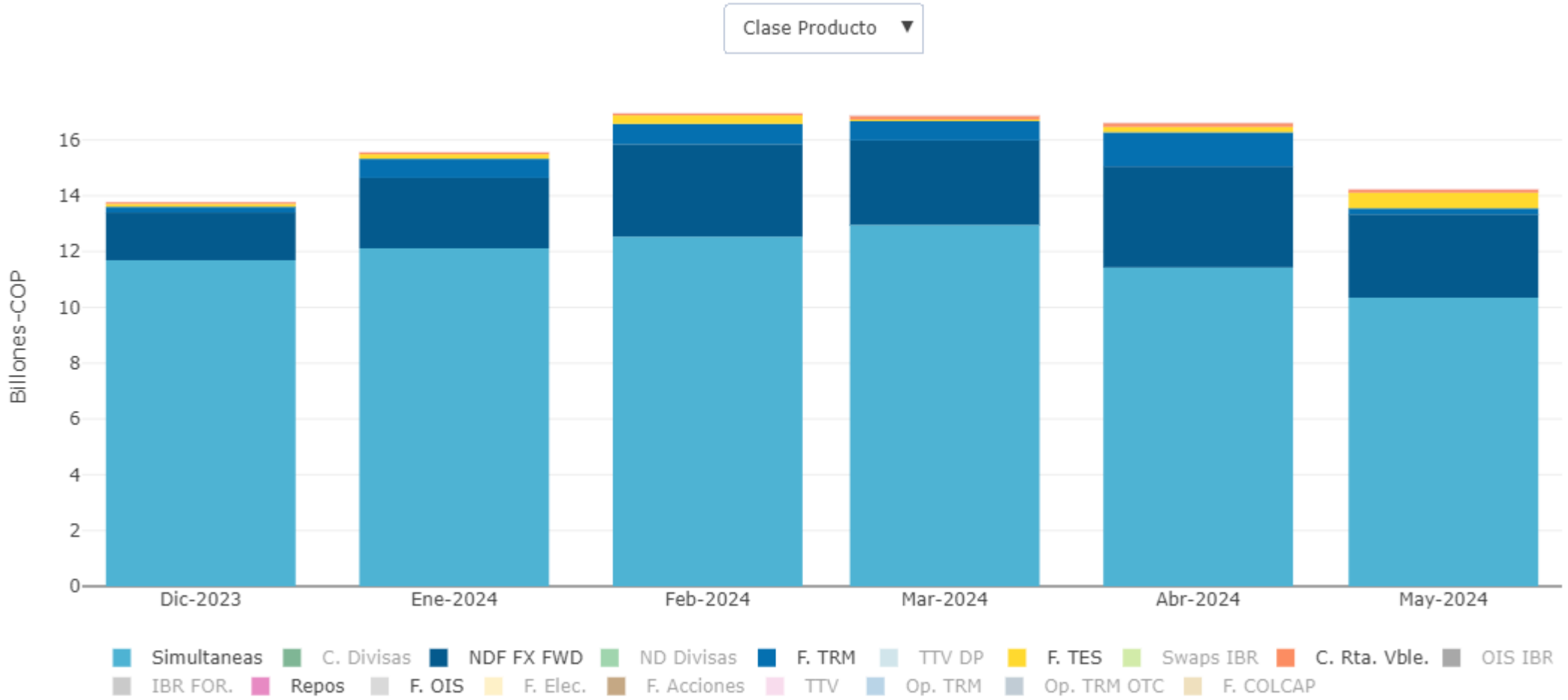
Registros del 19 al 20 de un total de 20
*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31



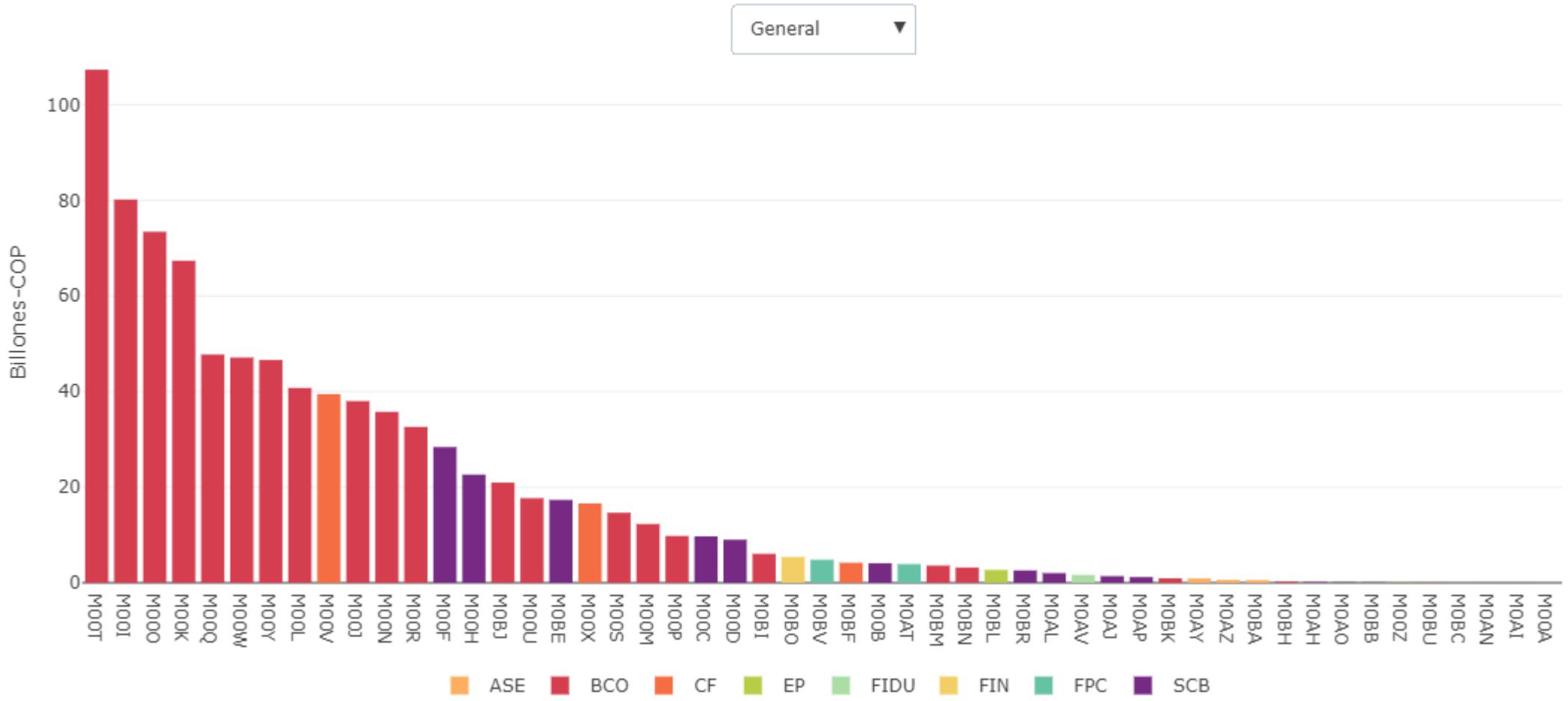
*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31

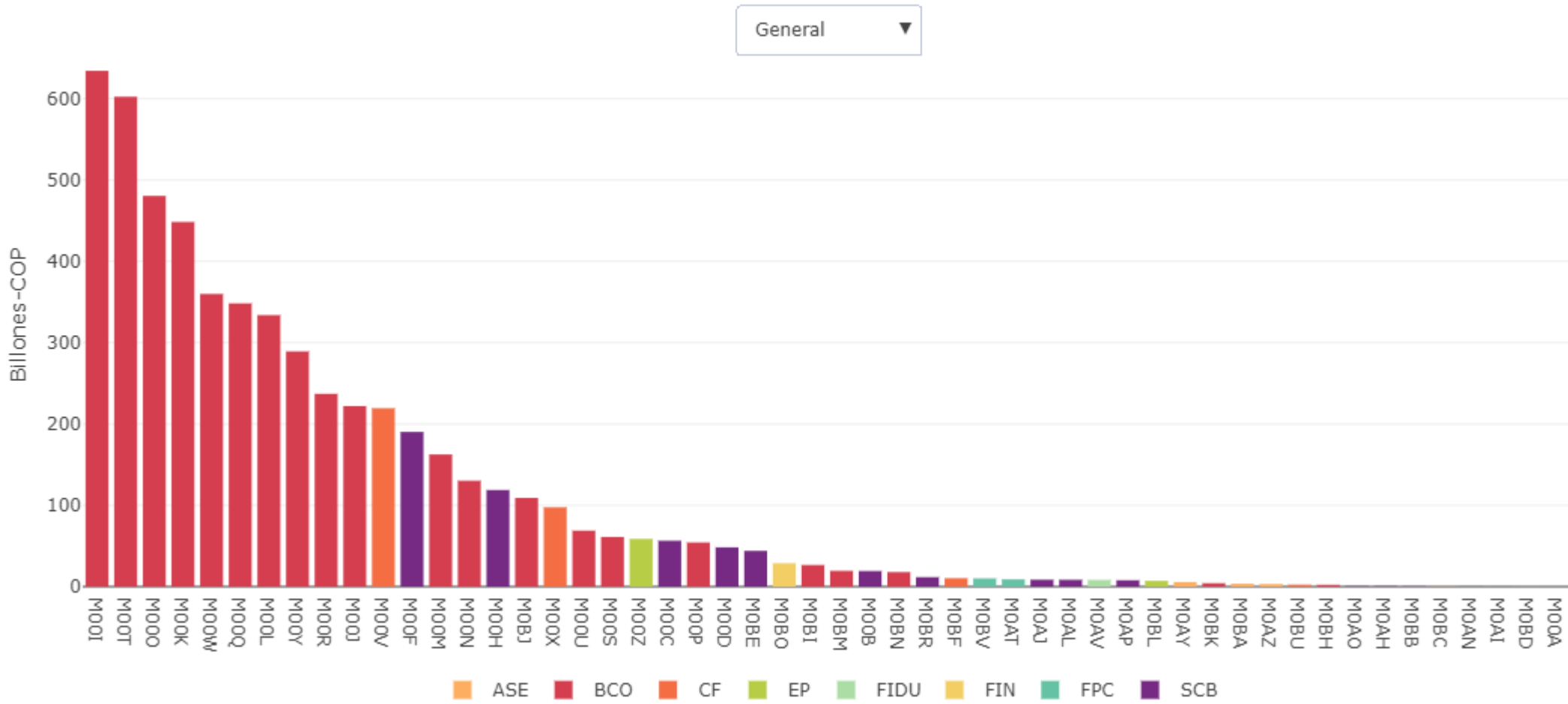


*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31



*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31





*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	\$134,483,638	\$134,483,638	\$134,993,873	\$134,993,873	\$128,895,413	\$128,895,419
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$59,540,806	\$59,540,806	\$59,488,584	\$59,488,584	\$55,345,559	\$55,345,559
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$26,338,000	\$26,338,000	\$27,060,143	\$27,060,143	\$16,332,446	\$16,332,446
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$15,487,937	\$15,487,937	\$15,149,163	\$15,149,163	\$16,646,188	\$16,646,188
Derivados	TRM	F. TRM	\$14,275,670	\$14,275,670	\$14,886,332	\$14,886,332	\$13,734,805	\$13,734,805
Derivados	OIS	OIS IBR	\$7,441,381	\$7,441,381	\$8,669,982	\$8,669,982	\$15,963,073	\$15,963,073
Derivados	F. TES	F. TES	\$6,511,346	\$6,511,346	\$5,280,425	\$5,280,425	\$3,412,526	\$3,412,526
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$1,579,108	\$1,579,108	\$1,779,638	\$1,779,638	\$4,394,224	\$4,394,224
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,376,548	\$1,376,548	\$1,376,969	\$1,376,969	\$1,299,278	\$1,299,278

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 19

*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31

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
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$781,567	\$781,567	\$703,119	\$703,119	\$762,560	\$762,560
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$626,488	\$626,488	\$166,369	\$166,369	\$159,765	\$159,771
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$342,729	\$342,729	\$255,661	\$255,661	\$222,848	\$222,848
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$126,849	\$126,849	\$124,363	\$124,363	\$95,621	\$95,621
Derivados	TRM	Op. TRM	\$27,315	\$27,315	\$24,778	\$24,778	\$15,830	\$15,830
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$19,363	\$19,363	\$18,935	\$18,935	\$21,065	\$21,065
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$4,442	\$4,442	\$4,884	\$4,884	\$1,871	\$1,871
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$3,167	\$3,167	\$3,544	\$3,544	\$2,083	\$2,083
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$925	\$925	\$984	\$984	\$1,110	\$1,110

*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31



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
Renta Fija	TES	TTV DP	\$0	\$0	\$0	\$0	\$484,559	\$484,559

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 19 al 19 de un total de 19
*Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31

Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,434,000	\$2,550,238	\$935,050
1M-3M	\$1,112,000	\$943,714	\$564,405
3M-6M	\$1,417,500	\$1,283,000	\$668,438
6M-9M	\$534,500	\$438,143	\$419,368
9M-1Y	\$1,081,500	\$1,122,452	\$548,021
1Y-18M	\$577,000	\$571,405	\$457,988
18M-2Y	\$247,500	\$177,619	\$192,165
2Y-5Y	\$509,500	\$460,667	\$380,533
5Y-7Y	\$70,500	\$85,548	\$124,921
7Y-10Y	\$80,500	\$74,976	\$76,537

Anterior 1 Siguiente

Registros del 1 al 10 de un total de 10
 *Datos del 2023-12-01 al 2024-05-31



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte