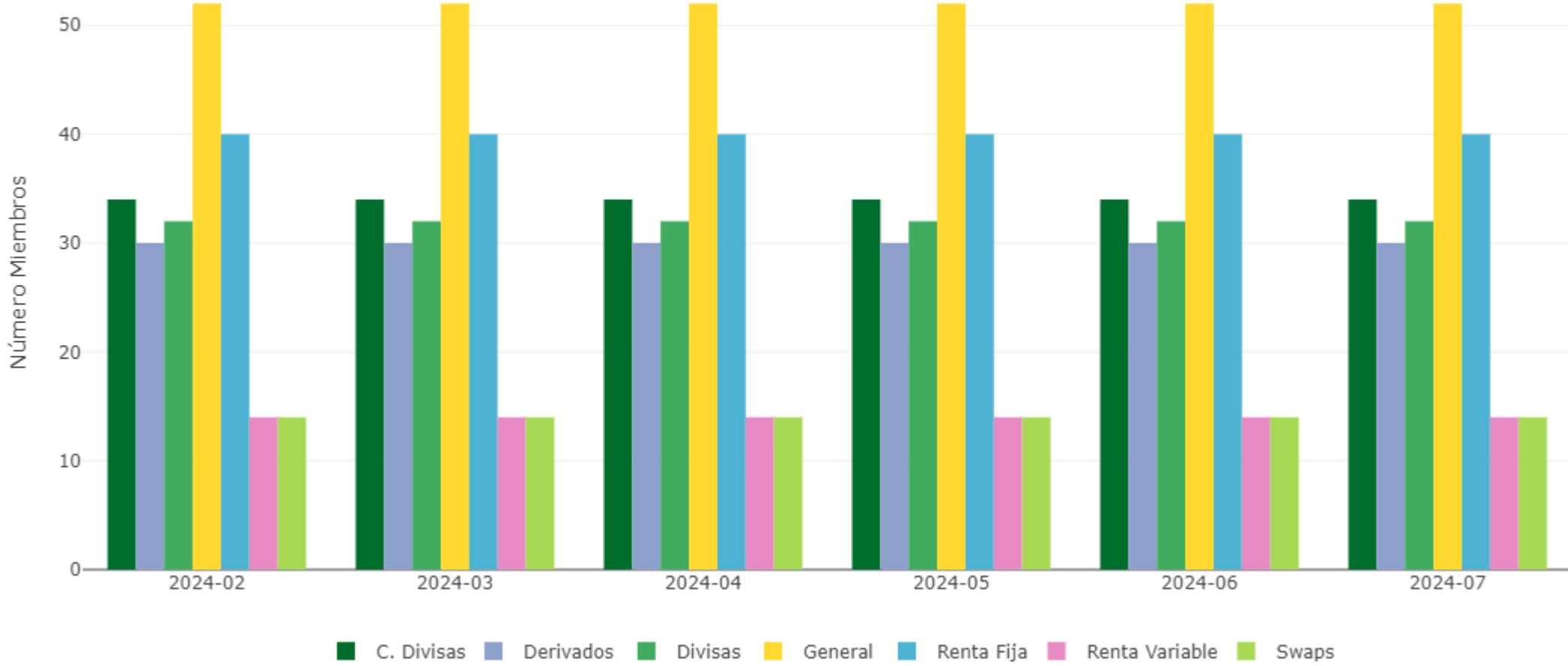


Evolución de Mercado

Junio 2024



*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

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%	\$19,813,925	\$21,037,167	\$462,817,671	\$23,304,638	\$2,843,165,837
Renta Fija	TES	Simultaneas	42.29%	\$8,380,079	\$9,533,325	\$209,733,140	\$11,419,670	\$1,393,199,800
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	31.62%	\$6,265,961	\$5,812,533	\$127,875,718	\$6,031,929	\$735,895,379
Derivados	TRM	NDF FX FWD	18.83%	\$3,730,953	\$3,429,810	\$75,455,813	\$3,317,224	\$404,701,361
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	4.16%	\$823,510	\$768,769	\$16,912,925	\$875,415	\$106,800,660
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	1.26%	\$249,000	\$195,864	\$4,309,000	\$261,709	\$31,928,500
Derivados	F. TES	F. TES	0.66%	\$130,068	\$315,995	\$6,951,899	\$268,827	\$32,796,855
Derivados	TRM	F. TRM	0.48%	\$95,663	\$901,776	\$19,839,064	\$775,533	\$94,615,008
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.33%	\$66,155	\$12,903	\$283,877	\$10,237	\$1,248,966

Anterior 2 3 Siguiente

Registros del 1 al 9 de un total de 20

*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

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
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.32%	\$64,106	\$60,870	\$1,339,141	\$94,746	\$11,558,956
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.03%	\$6,079	\$4,432	\$97,515	\$1,880	\$229,323
Derivados	TRM	Op. TRM	0.01%	\$2,051	\$270	\$5,943	\$300	\$36,611
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$298	\$499	\$10,979	\$1,267	\$154,569
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$26	\$3,225
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$83	\$1,836	\$656	\$79,997
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$4,495	\$548,402
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$1,654	\$201,785
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$6,934	\$845,979

Anterior 1 2 3 Siguiente

Registros del 10 al 18 de un total de 20

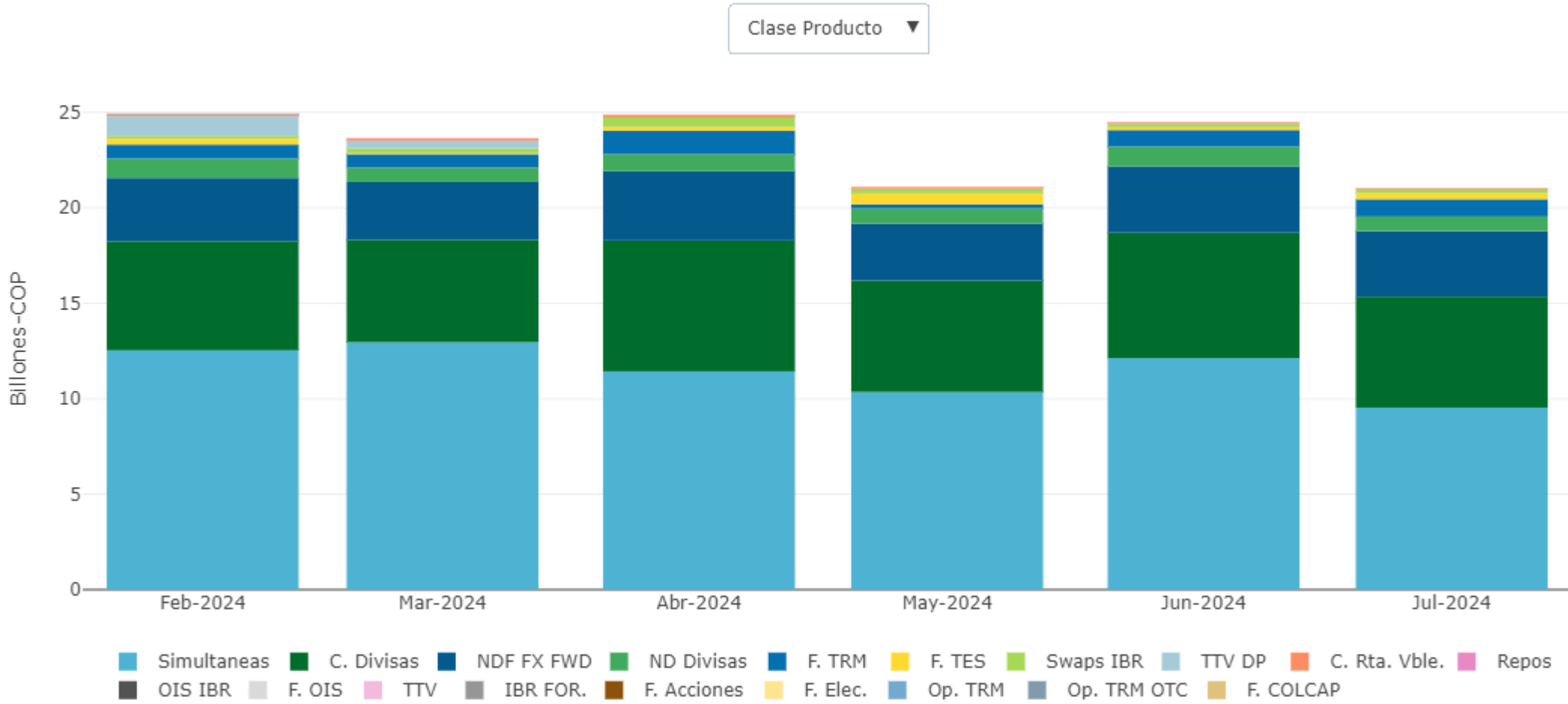
*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



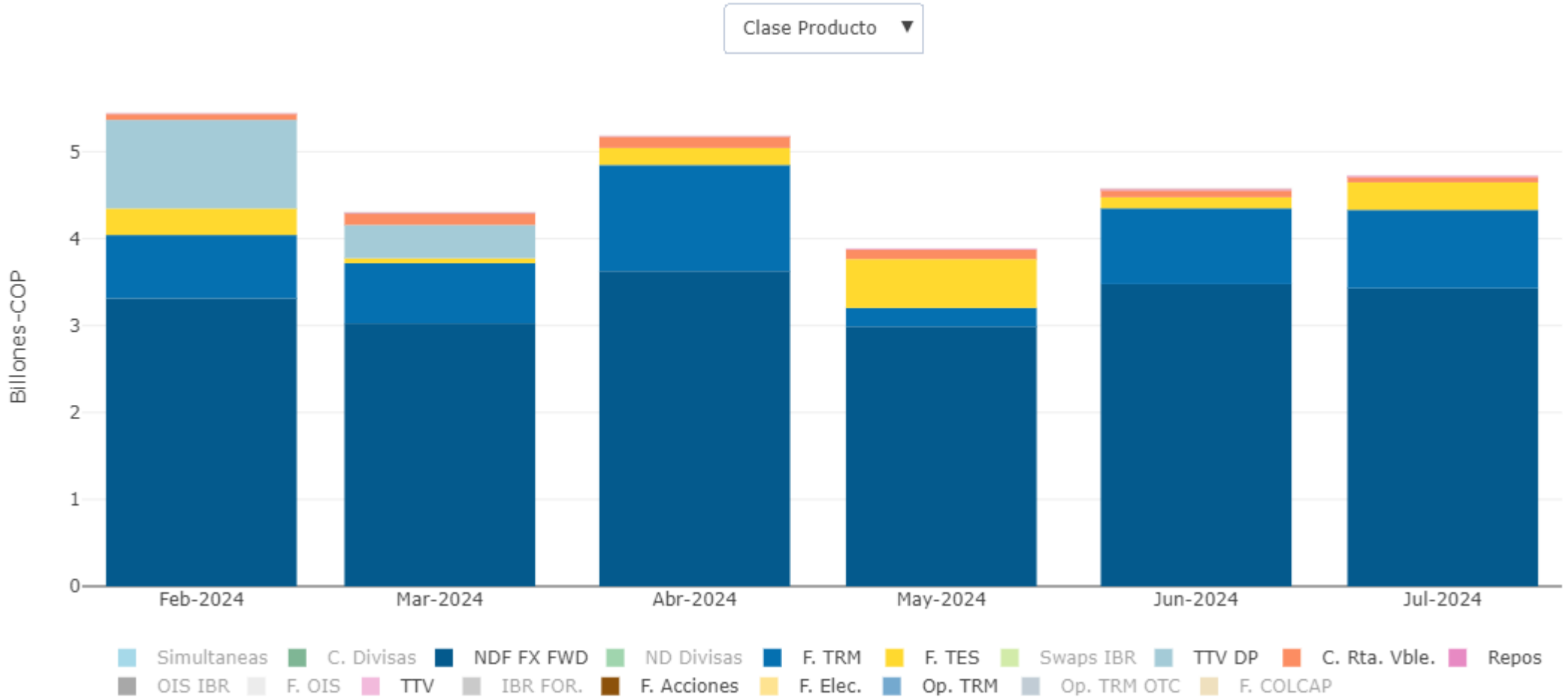
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$37	\$820	\$101	\$12,306
Renta Fija	TES	TTV DP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$232,034	\$28,308,156

Anterior 1 2 3 Siguiete

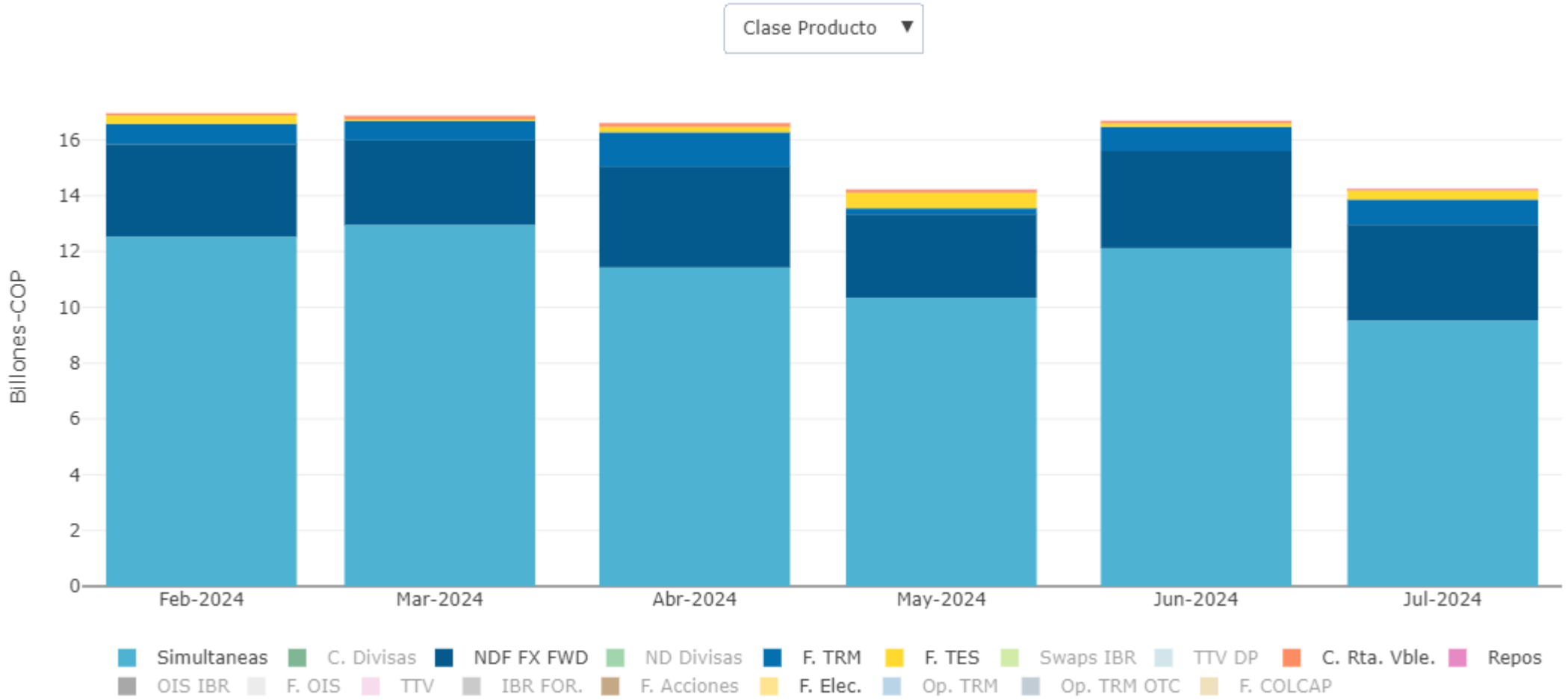
Registros del 19 al 20 de un total de 20
*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



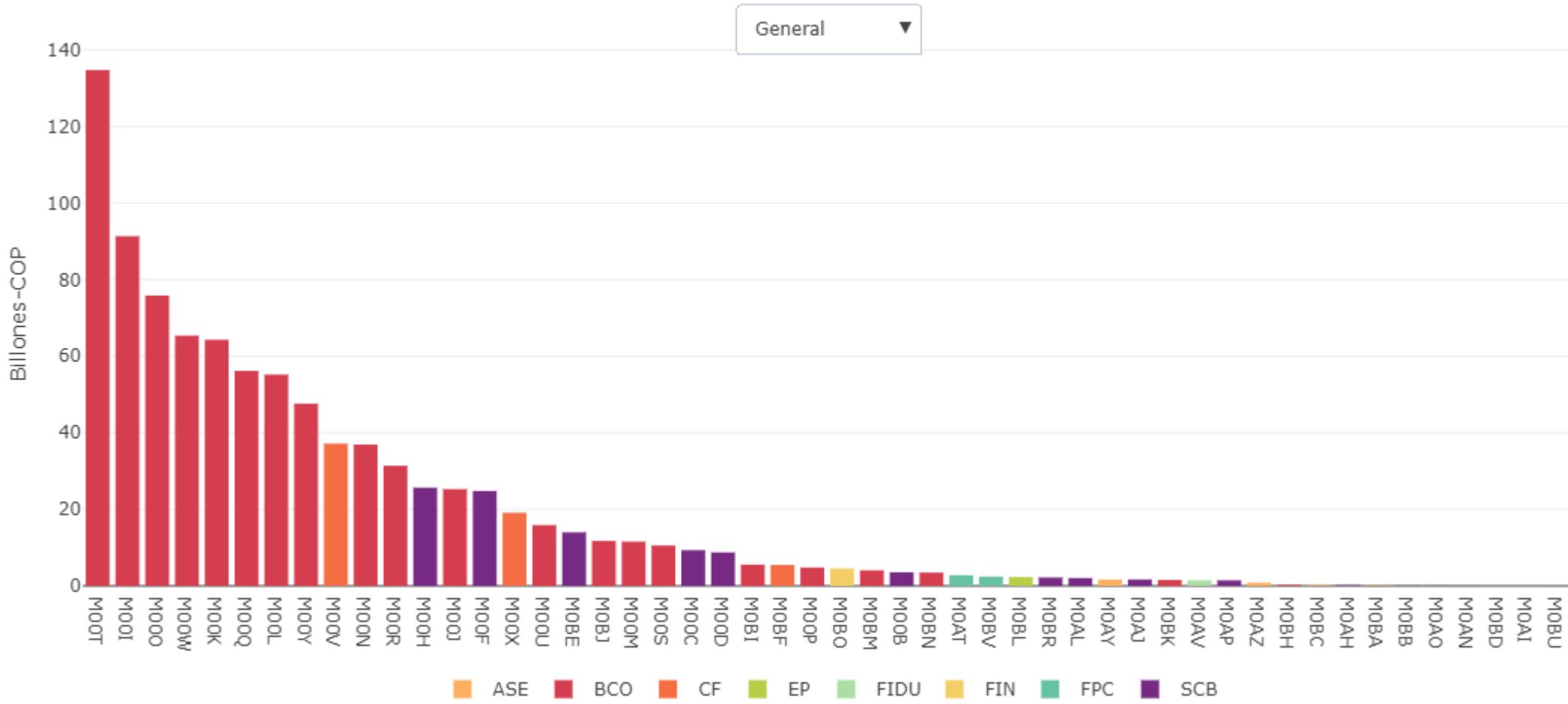
*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



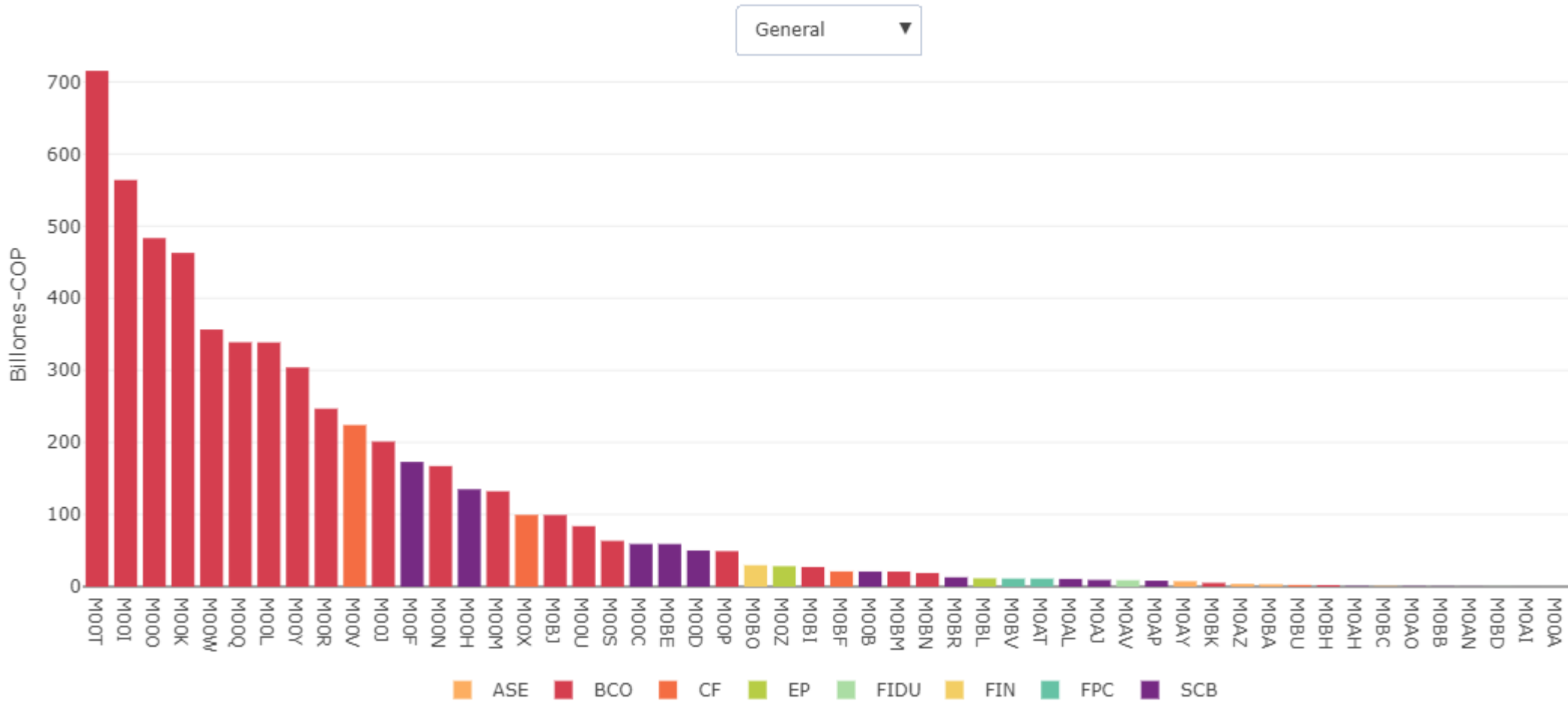
*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

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
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$146,286,424	\$146,286,424	\$139,023,567	\$139,023,567	\$133,481,598	\$133,481,605
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$73,089,578	\$73,089,578	\$66,296,617	\$66,296,617	\$59,789,262	\$59,789,262
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$28,375,000	\$28,375,000	\$27,733,045	\$27,733,045	\$21,859,996	\$21,859,996
Derivados	TRM	F. TRM	\$15,860,385	\$15,860,385	\$15,440,432	\$15,440,432	\$14,513,453	\$14,513,453
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$14,589,196	\$14,589,196	\$13,715,008	\$13,715,008	\$15,801,716	\$15,801,716
Derivados	F. TES	F. TES	\$6,967,198	\$6,967,198	\$7,294,842	\$7,294,842	\$4,717,415	\$4,717,415
Derivados	OIS	OIS IBR	\$4,518,375	\$4,518,375	\$5,318,277	\$5,318,277	\$11,283,869	\$11,283,869
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$838,846	\$838,846	\$1,036,287	\$1,036,287	\$2,721,878	\$2,721,878
Derivados	OIS	F. OIS	\$750,280	\$750,280	\$926,471	\$926,471	\$1,200,170	\$1,200,170

Anterior 1 2 3 Siguiente

Registros del 1 al 9 de un total de 19

*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

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	\$702,591	\$702,591	\$661,840	\$661,840	\$753,029	\$753,029
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$311,695	\$311,695	\$310,941	\$310,941	\$268,783	\$268,783
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$122,455	\$122,455	\$120,219	\$120,219	\$121,901	\$121,901
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$96,959	\$96,959	\$112,339	\$112,339	\$168,336	\$168,343
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$27,443	\$27,443	\$27,425	\$27,425	\$22,530	\$22,530
Derivados	TRM	Op. TRM	\$26,761	\$26,761	\$22,062	\$22,062	\$20,033	\$20,033
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$8,572	\$8,572	\$6,795	\$6,795	\$3,850	\$3,849
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$834	\$834	\$706	\$706	\$2,432	\$2,432
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$256	\$256	\$259	\$259	\$854	\$854

*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31



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	\$232,093	\$232,093

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 19 al 19 de un total de 19
*Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,261,000	\$1,212,409	\$1,270,074
1M-3M	\$1,232,000	\$1,036,932	\$871,574
3M-6M	\$1,106,500	\$1,188,795	\$1,027,738
6M-9M	\$864,500	\$740,182	\$476,410
9M-1Y	\$1,080,000	\$1,005,295	\$779,869
1Y-18M	\$964,000	\$729,500	\$530,668
18M-2Y	\$351,500	\$385,250	\$255,066
2Y-5Y	\$448,000	\$473,455	\$421,717
5Y-7Y	\$93,500	\$86,273	\$103,930
7Y-10Y	\$80,500	\$80,500	\$77,455

Registros del 1 al 10 de un total de 10
 *Datos del 2024-02-01 al 2024-07-31

Anterior 1 Siguiente



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte