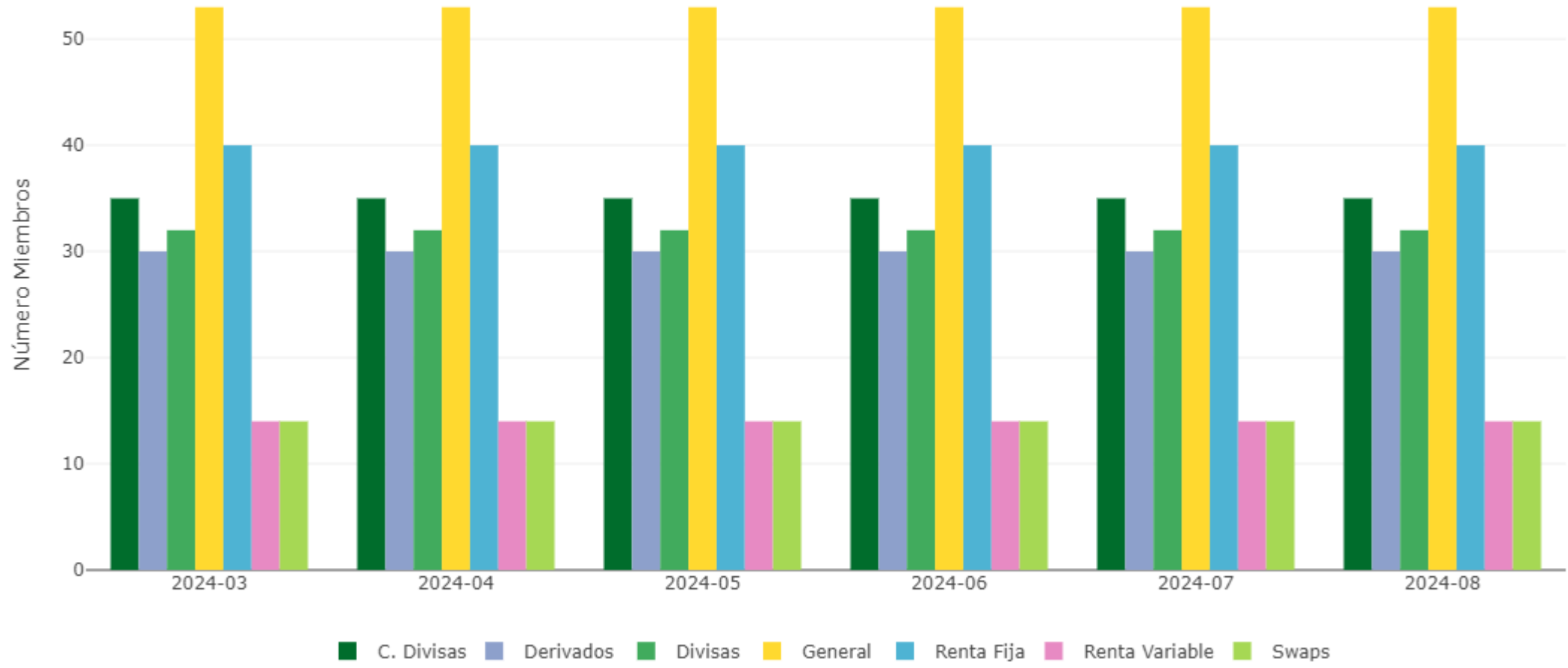


Evolución de Mercado

Agosto 2024



*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

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%	\$19,108,998	\$22,634,640	\$452,692,803	\$22,913,954	\$2,772,588,437
Renta Fija	TES	Simultaneas	41.44%	\$7,919,068	\$9,615,914	\$192,318,272	\$10,927,692	\$1,322,250,776
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	34.30%	\$6,553,953	\$6,105,629	\$122,112,589	\$6,099,971	\$738,096,466
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.74%	\$2,434,525	\$3,633,967	\$72,679,340	\$3,370,047	\$407,775,695
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	4.30%	\$822,127	\$683,634	\$13,672,687	\$819,741	\$99,188,673
Derivados	F. TES	F. TES	3.04%	\$579,992	\$724,620	\$14,492,404	\$337,831	\$40,877,549
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	1.65%	\$314,439	\$80,762	\$1,615,242	\$97,241	\$11,766,120
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	1.33%	\$255,000	\$339,075	\$6,781,500	\$292,070	\$35,340,500
Derivados	TRM	F. TRM	1.17%	\$224,521	\$1,437,700	\$28,754,005	\$893,327	\$108,092,624

Anterior 2 Siguiente

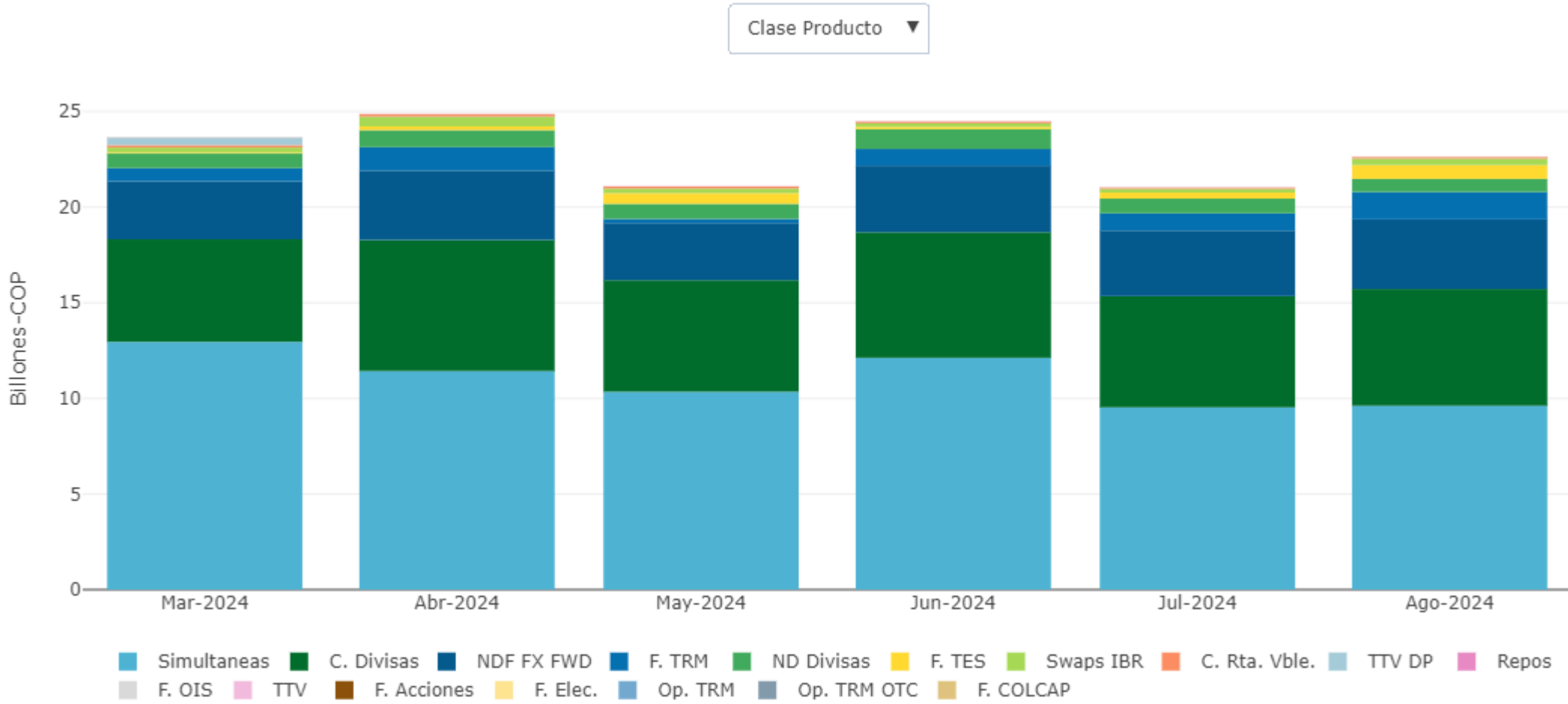
Registros del 1 al 9 de un total de 18

*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

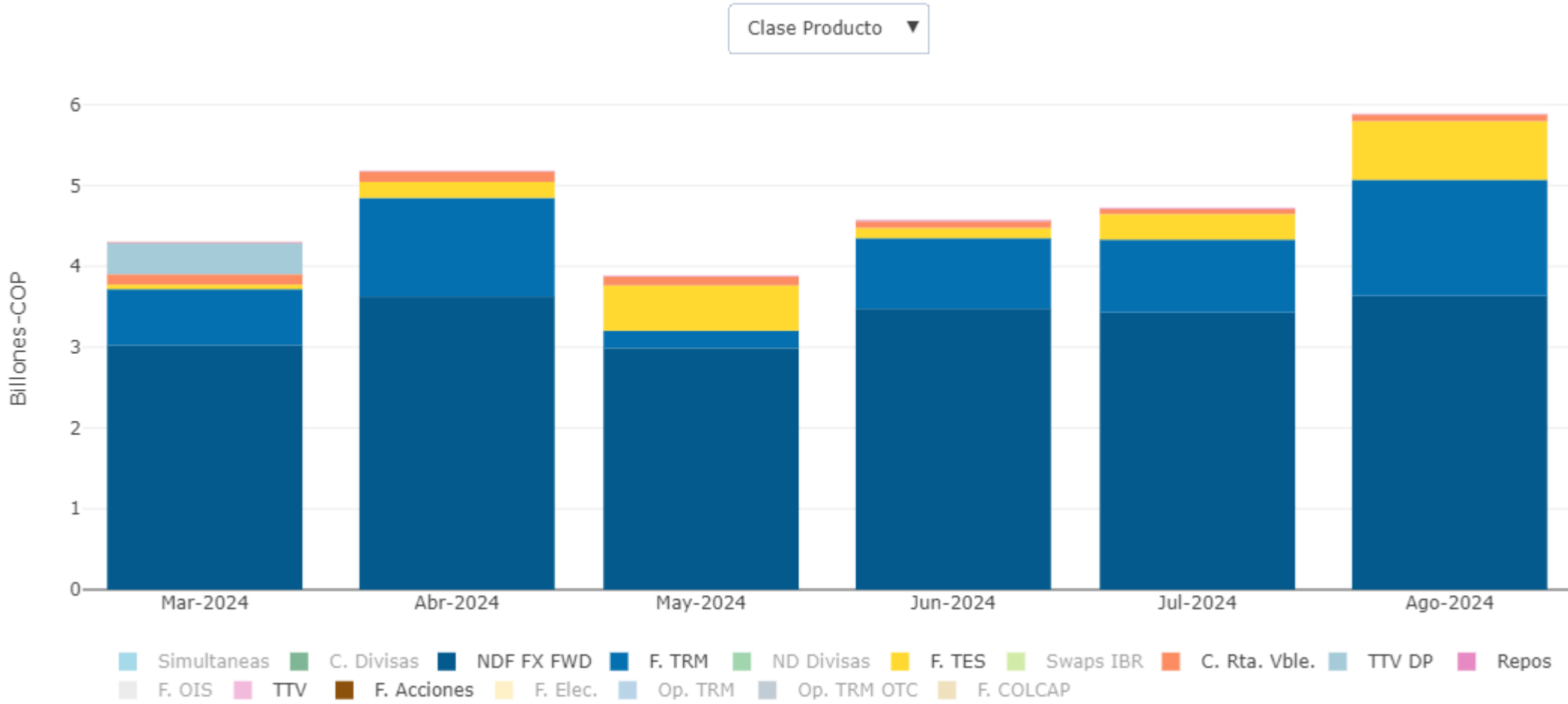
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.03%	\$4,793	\$8,238	\$164,766	\$10,351	\$1,252,511
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$415	\$2,016	\$40,330	\$2,183	\$264,178
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$166	\$405	\$8,107	\$1,269	\$153,550
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$26	\$3,193
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$2,480	\$49,602	\$824	\$99,733
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$4,013	\$485,610
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$198	\$3,959	\$249	\$30,082
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$92	\$11,124
Renta Fija	TES	TTV DP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$57,025	\$6,900,054

Anterior 1 **2** Siguiente

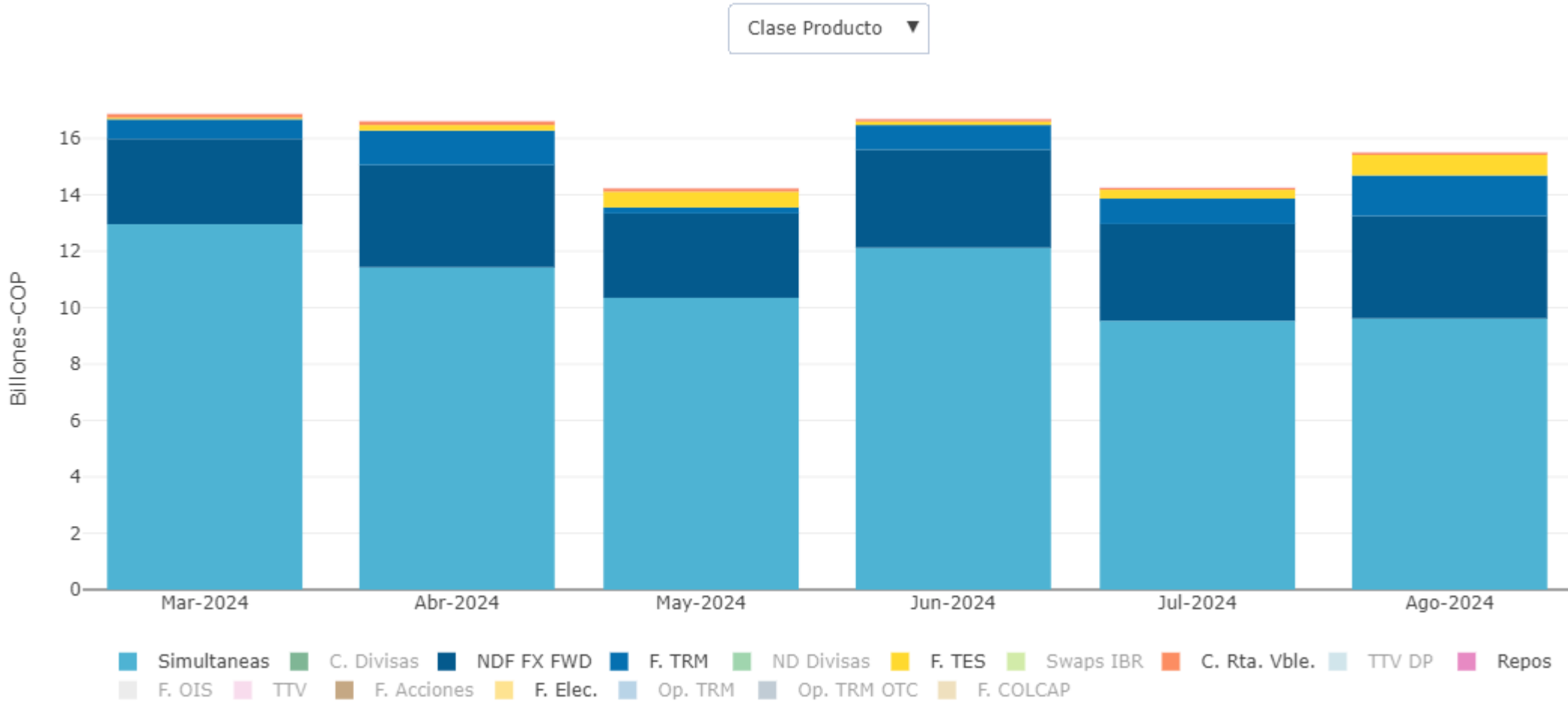
Registros del 10 al 18 de un total de 18
*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30



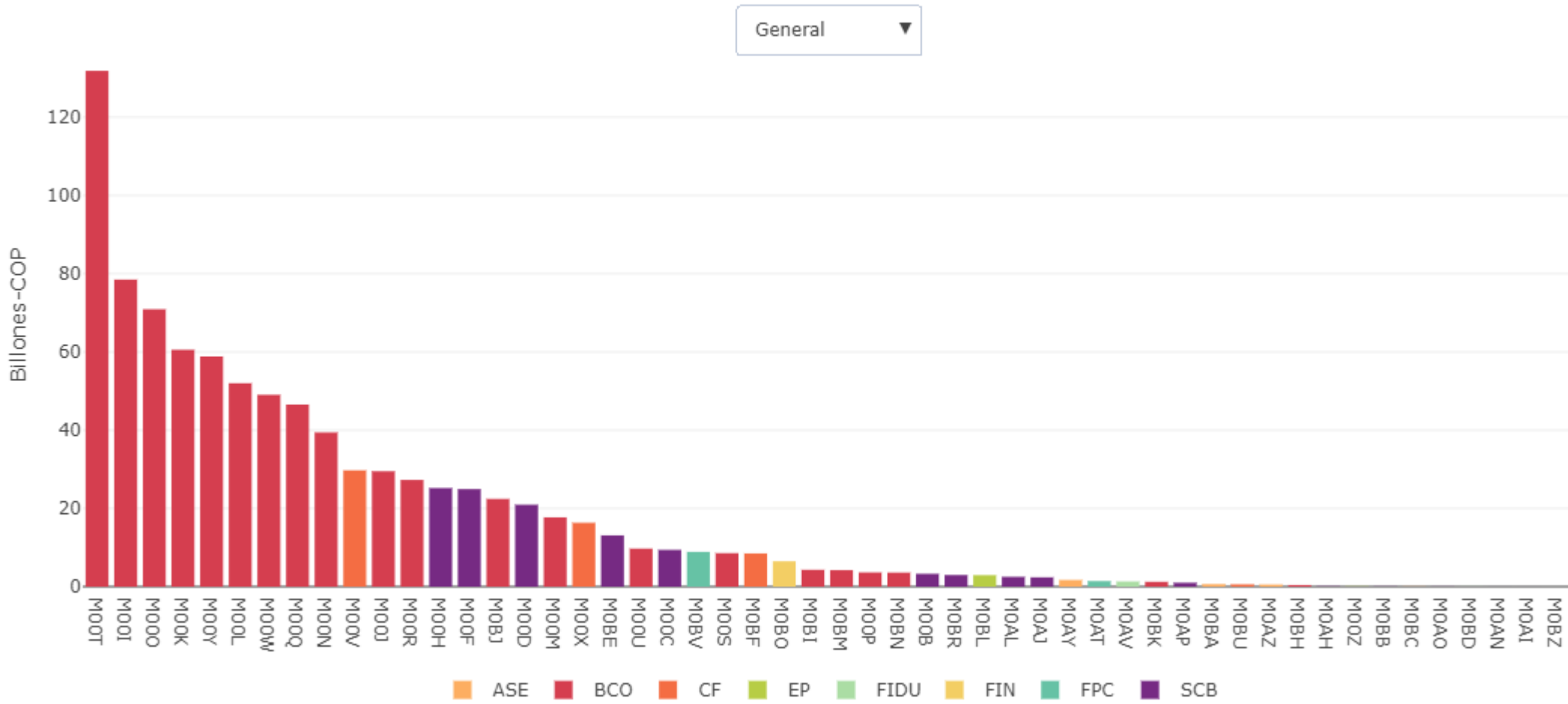
*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30



*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30



*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30



*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

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
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$149,839,584	\$149,839,584	\$149,759,858	\$149,759,858	\$137,130,298	\$137,130,306
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$70,935,426	\$70,935,426	\$73,781,409	\$73,781,409	\$62,935,521	\$62,935,521
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$32,699,500	\$32,699,500	\$31,006,600	\$31,006,600	\$25,114,248	\$25,114,248
Derivados	TRM	F. TRM	\$16,106,159	\$16,106,159	\$17,012,523	\$17,012,523	\$15,160,219	\$15,160,219
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$15,492,354	\$15,492,354	\$13,514,616	\$13,514,616	\$15,222,058	\$15,222,058
Derivados	F. TES	F. TES	\$8,745,688	\$8,745,688	\$8,220,647	\$8,220,647	\$5,531,585	\$5,531,585
Derivados	OIS	OIS IBR	\$3,296,187	\$3,296,187	\$3,710,811	\$3,710,811	\$8,747,880	\$8,747,880
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$735,646	\$735,646	\$609,863	\$609,863	\$716,628	\$716,628
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$684,286	\$684,286	\$753,085	\$753,085	\$1,903,022	\$1,903,022

Anterior 2 3 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 19

*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

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
Derivados	OIS	F. OIS	\$373,178	\$373,178	\$486,260	\$486,260	\$1,100,219	\$1,100,219
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$301,318	\$301,318	\$126,005	\$126,005	\$171,289	\$171,296
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$241,538	\$241,538	\$318,152	\$318,152	\$287,083	\$287,083
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$169,980	\$169,980	\$163,241	\$163,241	\$130,570	\$130,570
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$31,349	\$31,349	\$27,721	\$27,721	\$23,529	\$23,529
Derivados	TRM	Op. TRM	\$24,874	\$24,874	\$23,634	\$23,634	\$21,655	\$21,655
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$1,844	\$1,844	\$4,779	\$4,779	\$4,583	\$4,583
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$257	\$257	\$253	\$253	\$696	\$696
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$0	\$0	\$258	\$258	\$2,429	\$2,429

*Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30



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
Renta Fija	TES	TTV DP	\$0	\$0	\$0	\$0	\$57,085	\$57,085

Anterior 1 2 3 Siguiete

Registros del 19 al 19 de un total de 19
 *Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,795,000	\$1,655,525	\$1,500,806
1M-3M	\$1,890,500	\$1,343,975	\$1,054,153
3M-6M	\$708,000	\$995,200	\$1,106,314
6M-9M	\$1,069,000	\$1,077,550	\$584,483
9M-1Y	\$985,000	\$986,125	\$914,690
1Y-18M	\$950,500	\$886,375	\$579,909
18M-2Y	\$517,500	\$499,525	\$292,384
2Y-5Y	\$456,000	\$444,475	\$431,645
5Y-7Y	\$85,000	\$66,425	\$96,504
7Y-10Y	\$106,500	\$77,050	\$77,124

Registros del 1 al 10 de un total de 10
 *Datos del 2024-03-01 al 2024-08-30

Anterior 1 Siguiente



croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte