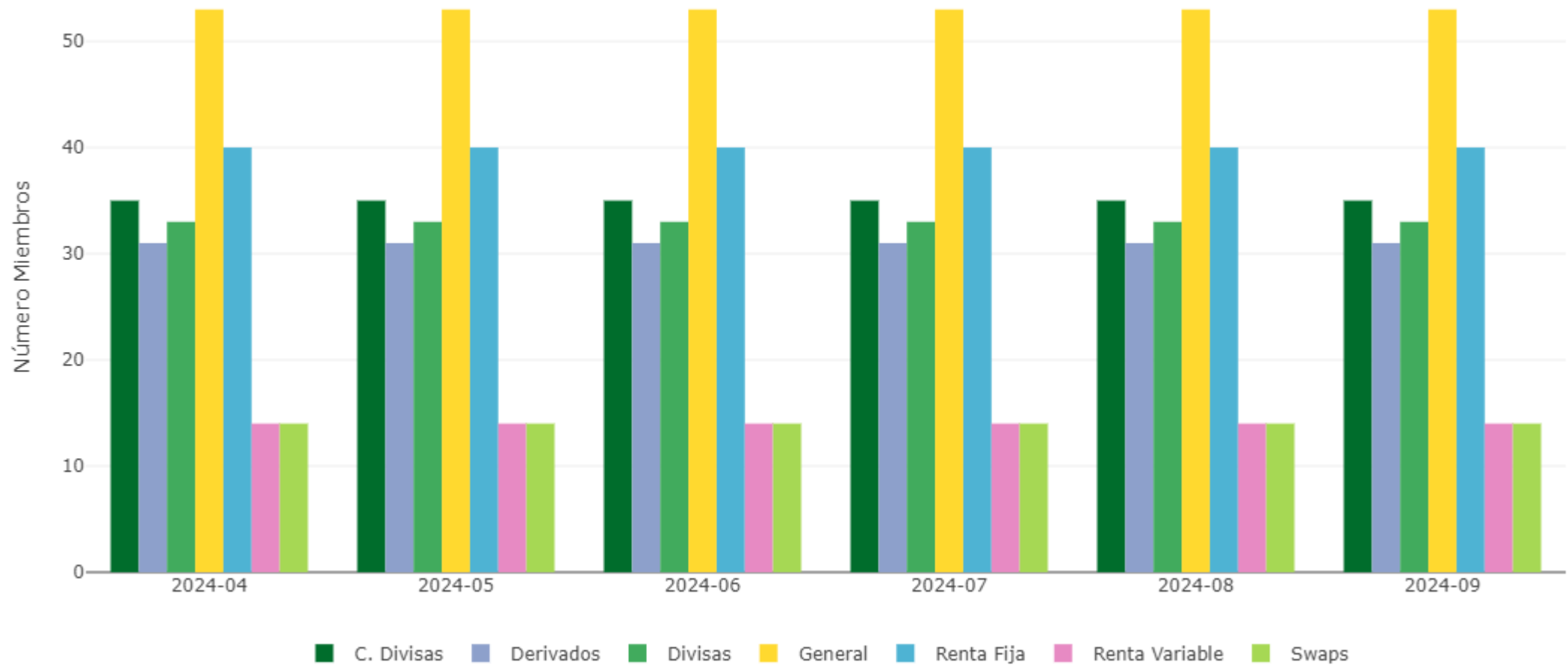


# Evolución de Mercado

---

Septiembre 2024



\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30

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%	\$17,201,719	\$22,942,949	\$481,801,919	\$22,810,486	\$2,828,500,203
Renta Fija	TES	Simultaneas	40.52%	\$6,969,677	\$11,891,647	\$249,724,594	\$10,796,384	\$1,338,751,676
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	29.67%	\$5,103,304	\$6,111,347	\$128,338,279	\$6,208,603	\$769,866,723
Derivados	TRM	NDF FX FWD	23.80%	\$4,093,443	\$3,165,940	\$66,484,734	\$3,385,307	\$419,778,007
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.57%	\$442,721	\$740,614	\$15,552,898	\$814,266	\$100,969,036
Derivados	F. TES	F. TES	1.44%	\$247,165	\$259,011	\$5,439,234	\$365,319	\$45,299,511
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	1.12%	\$192,000	\$330,202	\$6,934,250	\$304,192	\$37,719,750
Derivados	TRM	F. TRM	0.53%	\$91,104	\$349,871	\$7,347,301	\$830,572	\$102,990,875
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.28%	\$48,175	\$80,940	\$1,699,744	\$89,900	\$11,147,597

Registros del 1 al 9 de un total de 17

\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30

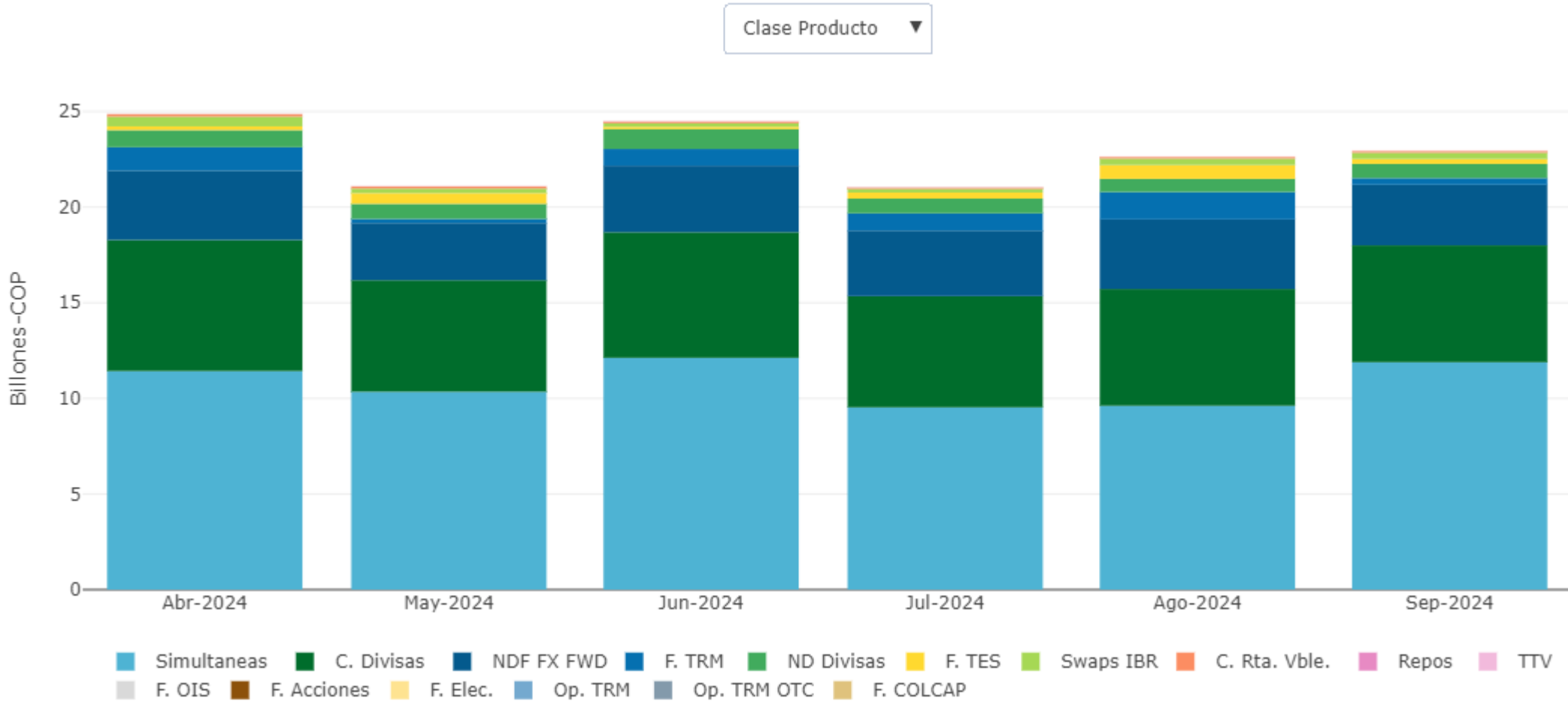
Anterior 1 2 Siguiete

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
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.07%	\$12,072	\$9,010	\$189,216	\$10,225	\$1,267,950
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.01%	\$1,707	\$2,183	\$45,851	\$1,125	\$139,557
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$352	\$1,010	\$21,208	\$2,191	\$271,655
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$10	\$1,282
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$916	\$19,246	\$860	\$106,605
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$1,253	\$155,332
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$235	\$4,935	\$231	\$28,644
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$20	\$430	\$48	\$6,003

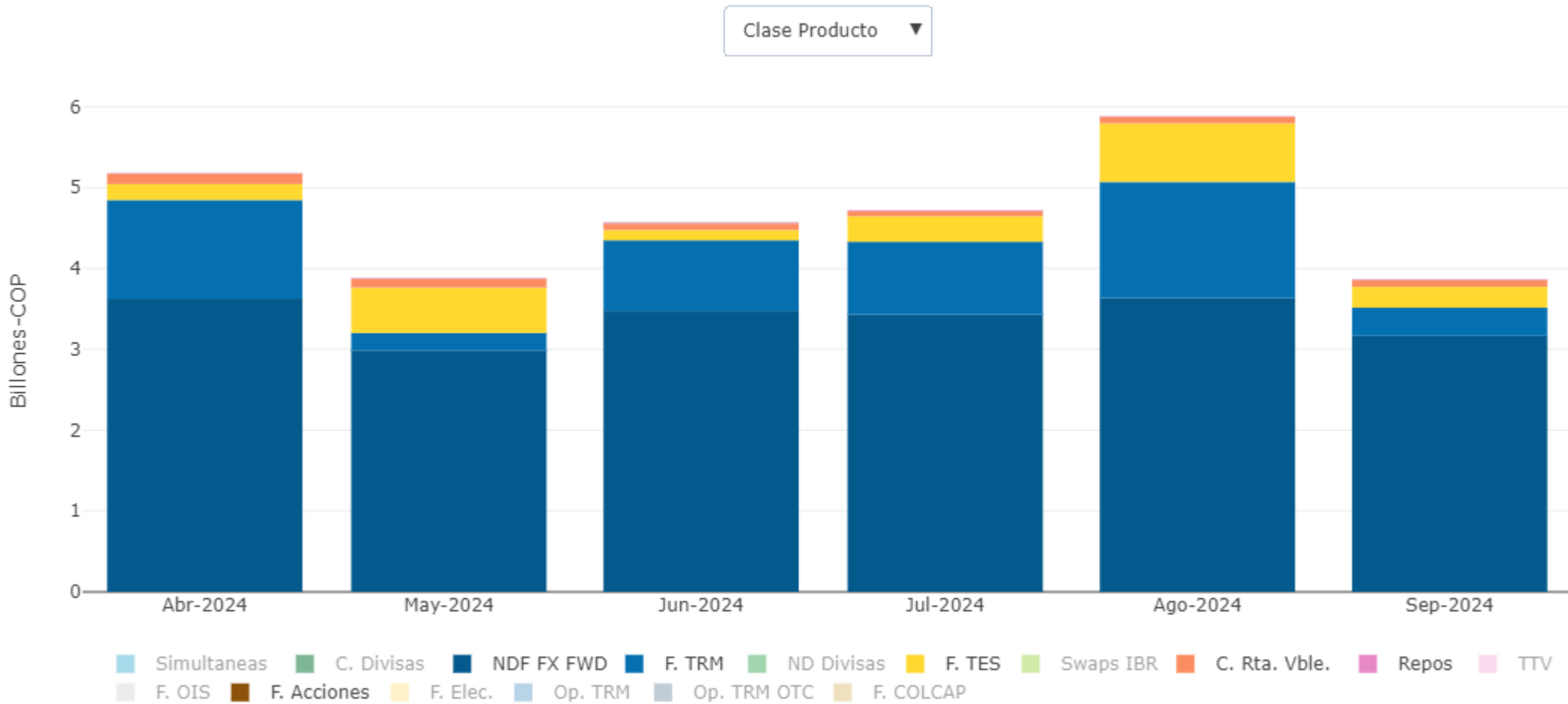
Anterior 1 **2** Siguiente

Registros del 10 al 17 de un total de 17

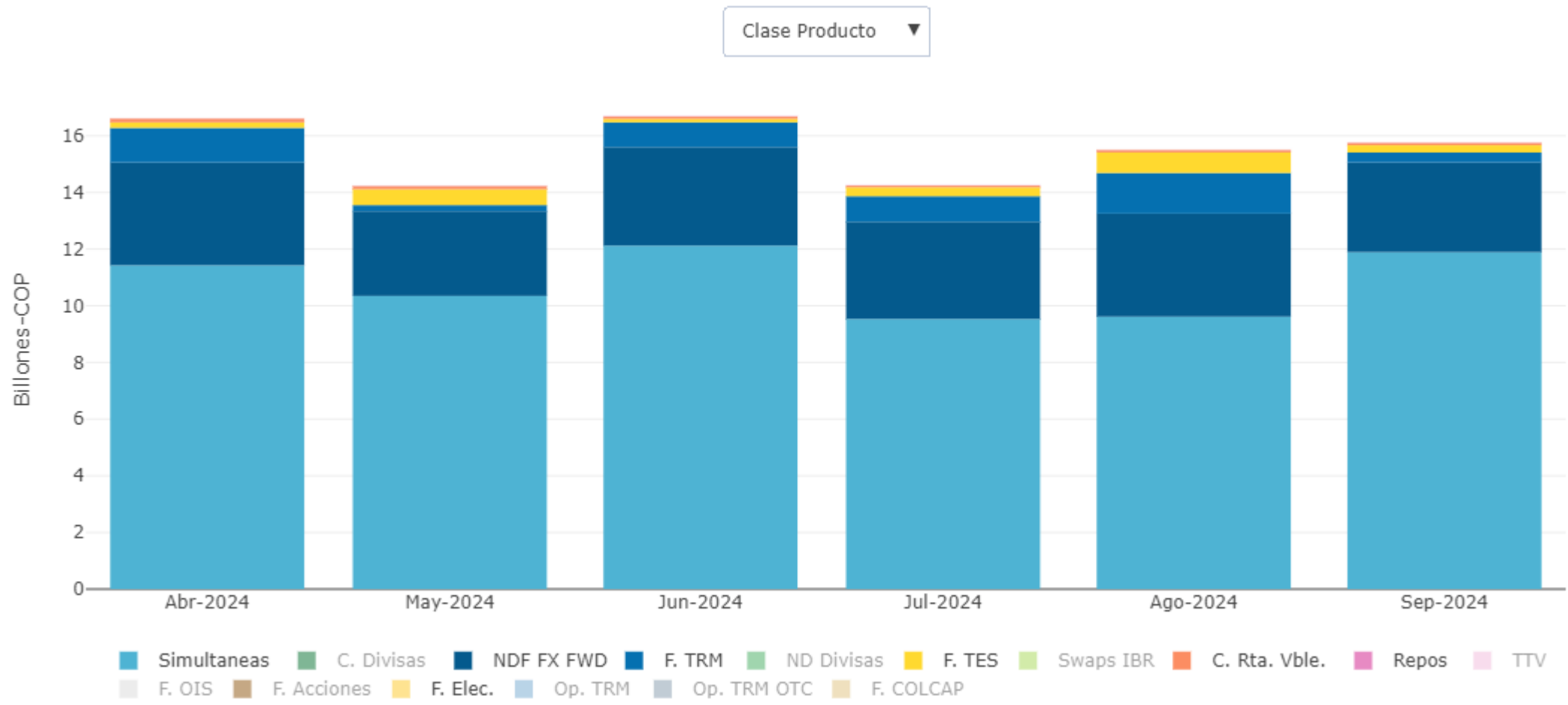
\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30



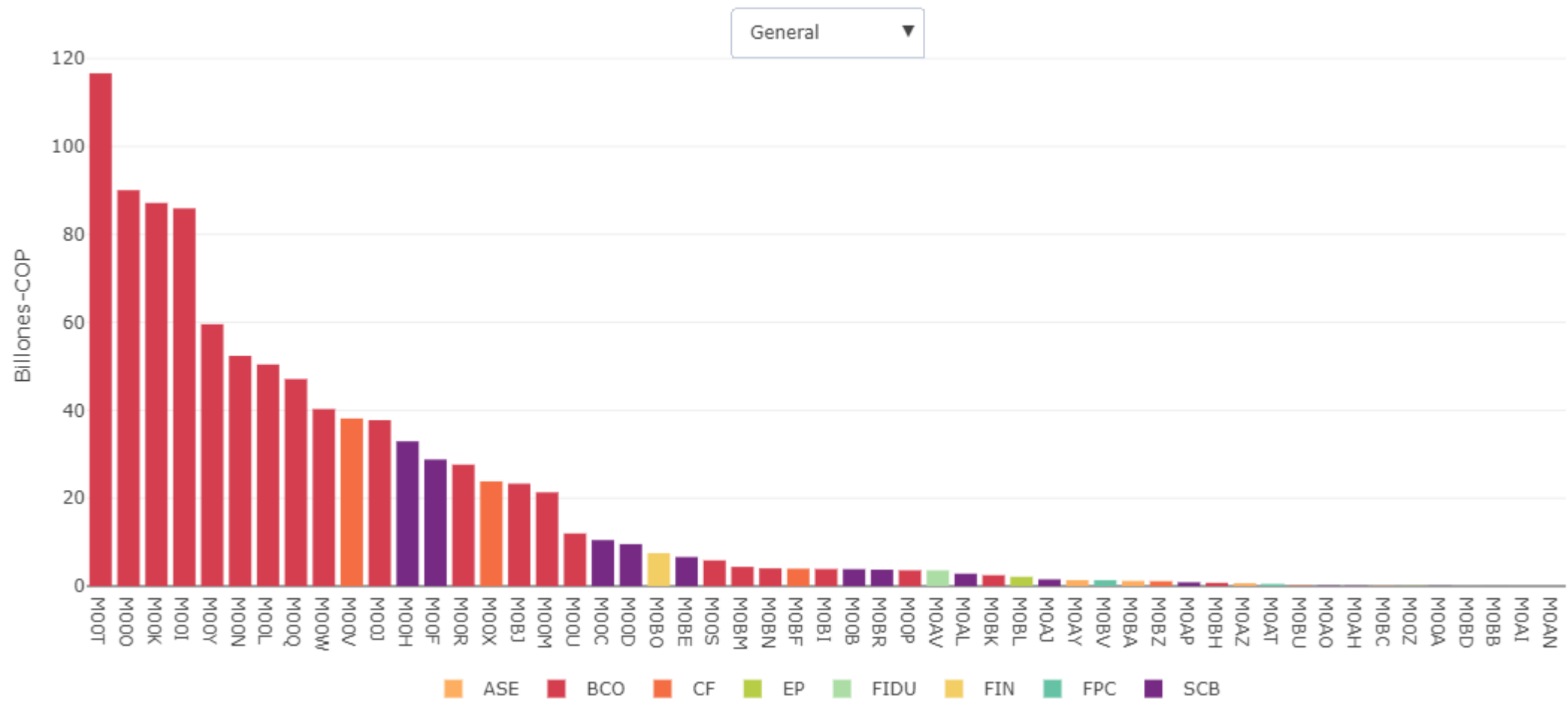
\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30



\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30

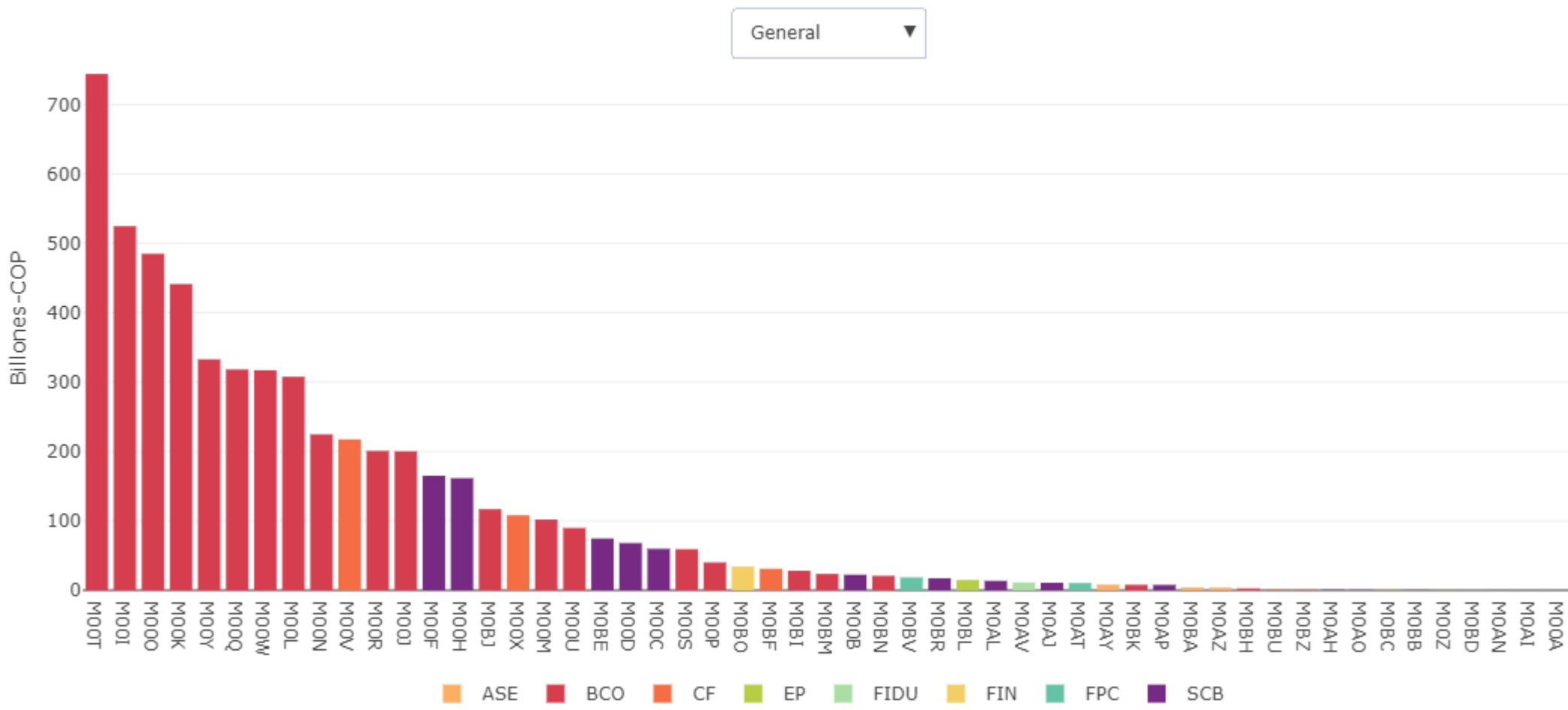


\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30



\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30





\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30

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	\$152,525,568	\$152,525,568	\$152,380,649	\$152,381,123	\$141,105,534	\$141,105,621
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$74,644,990	\$74,644,990	\$73,658,000	\$73,658,000	\$65,698,133	\$65,698,133
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$35,134,250	\$35,134,250	\$34,610,857	\$34,610,857	\$28,153,556	\$28,153,556
Derivados	TRM	F. TRM	\$16,332,586	\$16,332,586	\$16,402,267	\$16,402,267	\$15,674,964	\$15,674,964
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$15,775,467	\$15,775,467	\$16,024,204	\$16,024,204	\$14,998,120	\$14,998,120
Derivados	F. TES	F. TES	\$6,004,273	\$6,004,273	\$6,250,049	\$6,250,049	\$6,059,399	\$6,059,399
Derivados	OIS	OIS IBR	\$2,726,099	\$2,726,099	\$3,113,048	\$3,113,048	\$6,800,853	\$6,800,853
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$549,408	\$549,408	\$615,543	\$615,543	\$1,394,459	\$1,394,459
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$402,955	\$402,955	\$646,339	\$646,339	\$712,985	\$712,985

Anterior 1 2 Siguiete

Registros del 1 al 9 de un total de 18

\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30

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	\$373,049	\$373,049	\$373,084	\$373,084	\$965,091	\$965,091
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$262,697	\$262,697	\$247,699	\$247,699	\$287,239	\$287,239
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$195,146	\$195,146	\$171,356	\$171,356	\$139,167	\$139,167
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$78,550	\$78,550	\$213,241	\$213,716	\$168,049	\$168,136
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$18,735	\$18,735	\$32,713	\$32,713	\$24,802	\$24,802
Derivados	TRM	Op. TRM	\$14,729	\$14,729	\$18,267	\$18,267	\$21,660	\$21,660
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$12,217	\$12,217	\$3,556	\$3,556	\$4,659	\$4,659
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$417	\$417	\$260	\$260	\$1,850	\$1,850
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$166	\$166	\$548	\$548

\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30



Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$2,057,000	\$2,133,452	\$1,738,621
1M-3M	\$2,442,000	\$2,485,833	\$1,345,363
3M-6M	\$695,000	\$651,810	\$1,077,343
6M-9M	\$937,500	\$1,045,190	\$700,286
9M-1Y	\$1,019,000	\$1,000,405	\$990,254
1Y-18M	\$821,500	\$942,452	\$668,980
18M-2Y	\$698,250	\$705,524	\$374,956
2Y-5Y	\$422,000	\$447,476	\$446,831
5Y-7Y	\$94,000	\$87,571	\$90,105
7Y-10Y	\$113,500	\$110,833	\$83,395

Registros del 1 al 10 de un total de 10  
\*Datos del 2024-04-01 al 2024-09-30



# croc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte