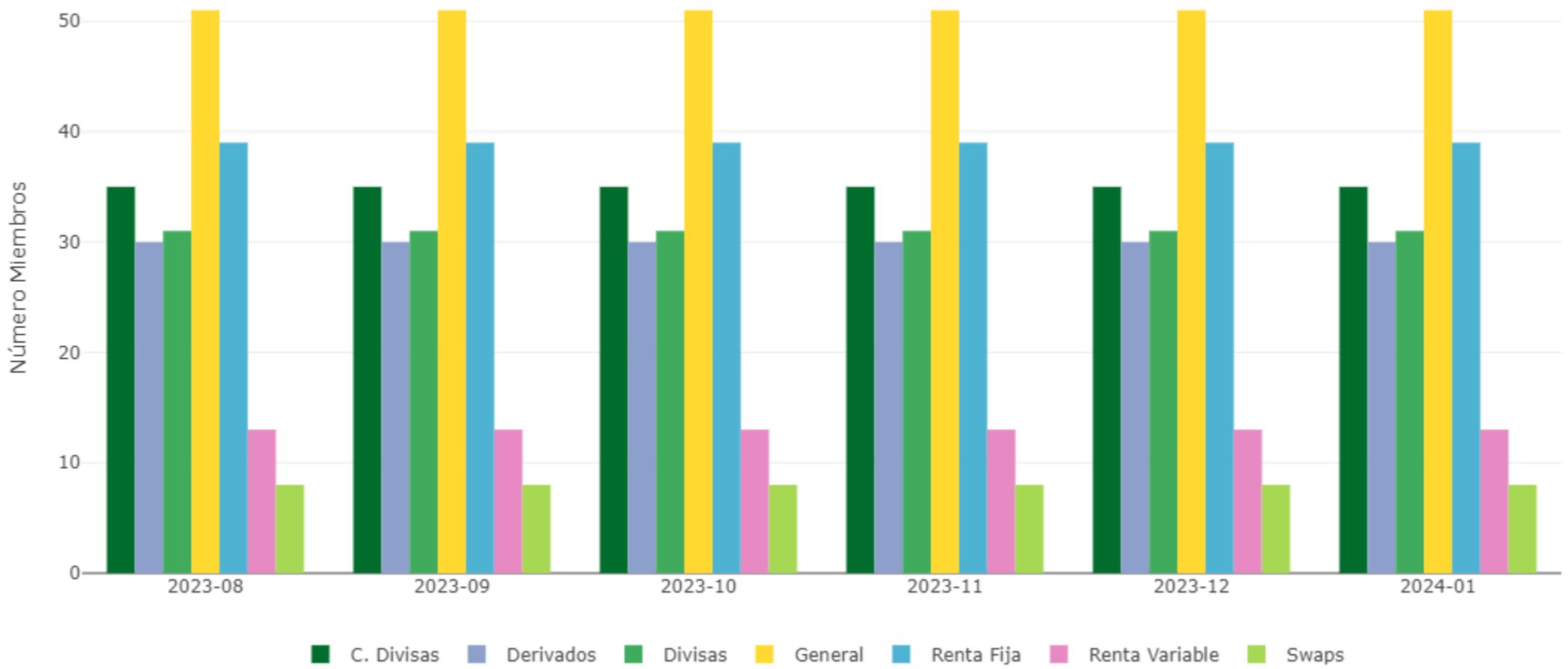


Evolución de Mercado

Enero 2025



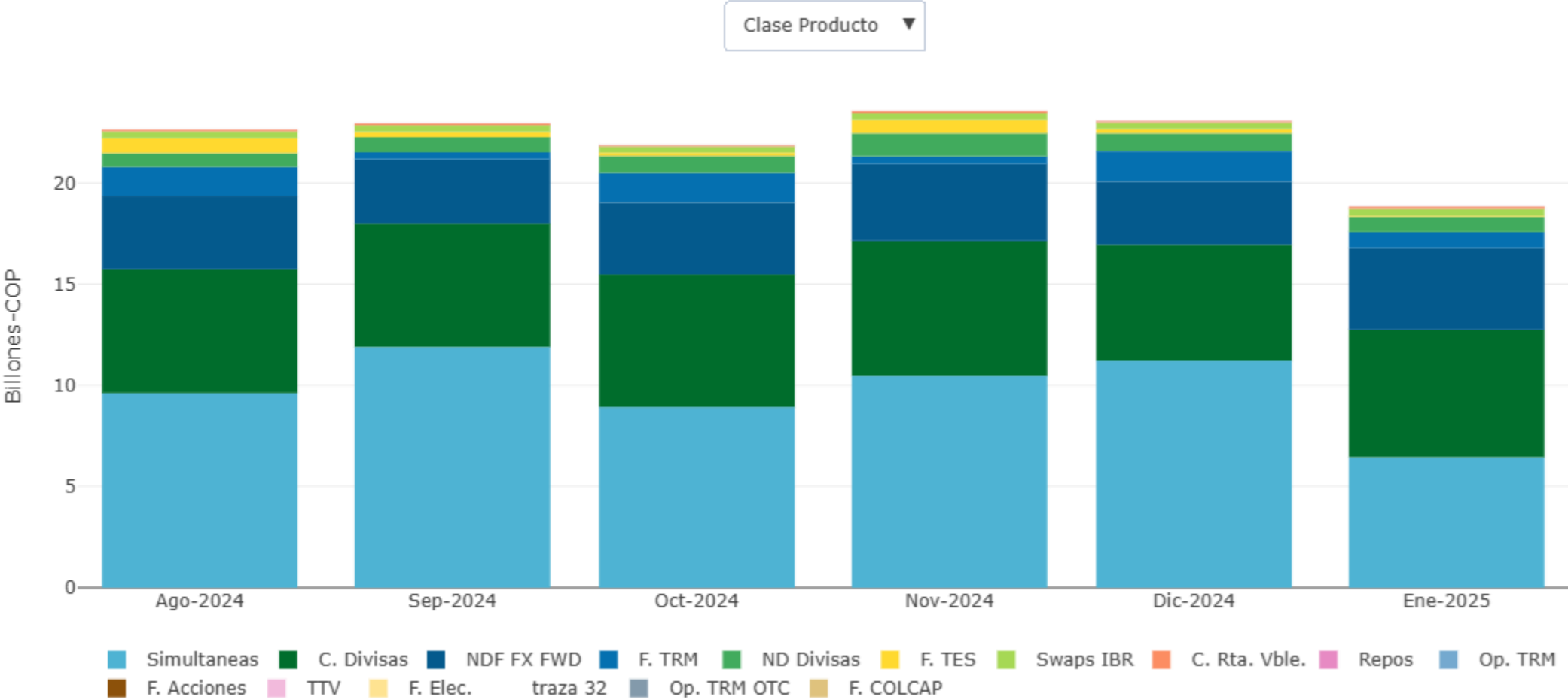
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

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%	\$18,535,172	\$18,841,023	\$395,661,479	\$22,114,859	\$2,720,127,600
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	31.75%	\$5,885,373	\$6,294,394	\$132,182,267	\$6,239,759	\$767,490,359
Renta Fija	TES	Simultaneas	30.80%	\$5,708,289	\$6,444,221	\$135,328,645	\$9,736,673	\$1,197,610,740
Derivados	TRM	NDF FX FWD	26.41%	\$4,894,361	\$4,043,822	\$84,920,266	\$3,552,489	\$436,956,164
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	5.77%	\$1,069,000	\$339,476	\$7,129,000	\$326,825	\$40,199,500
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.62%	\$671,889	\$756,373	\$15,883,840	\$835,074	\$102,714,078
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.77%	\$143,420	\$102,828	\$2,159,380	\$80,434	\$9,893,332
Derivados	TRM	F. TRM	0.71%	\$130,872	\$796,062	\$16,717,306	\$995,856	\$122,490,300
Derivados	F. TES	F. TES	0.09%	\$16,148	\$46,266	\$971,591	\$332,716	\$40,924,007

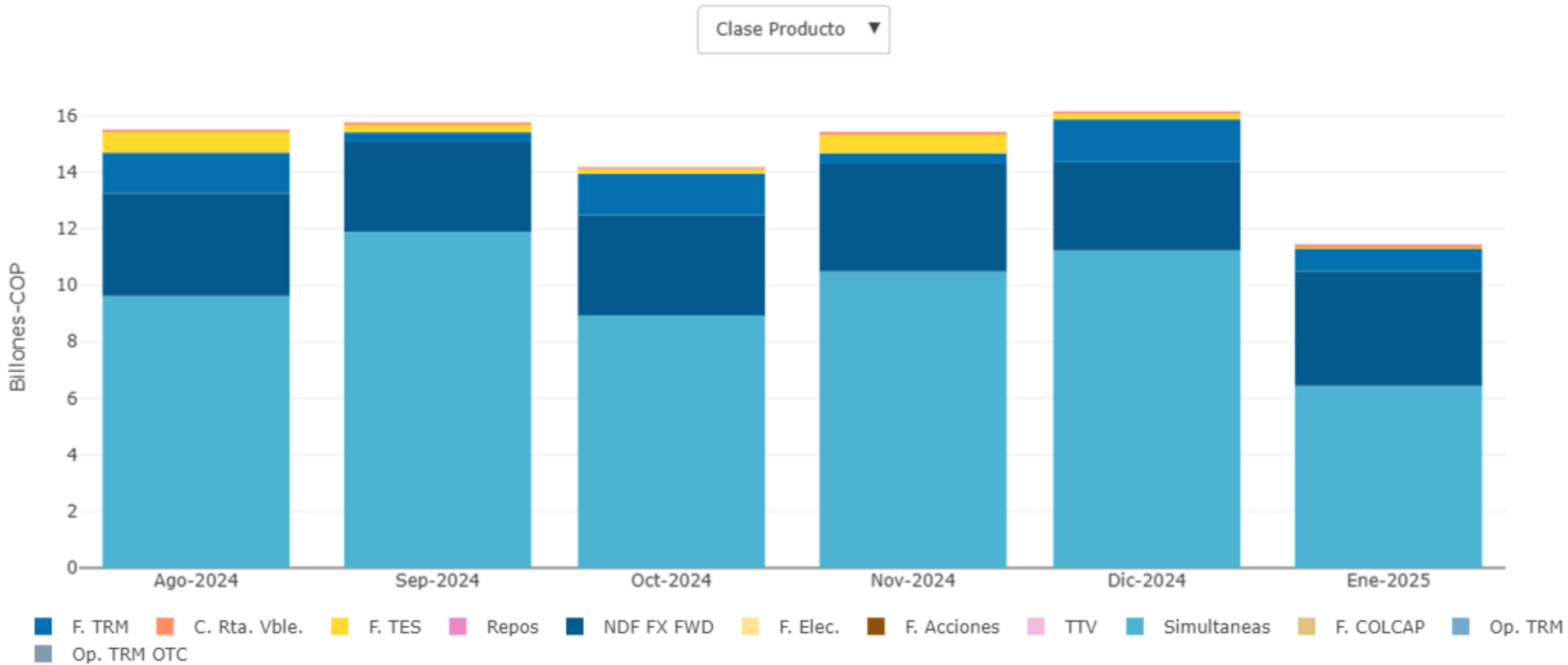
Registros del 1 al 9 de un total de 17
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

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	0.07%	\$13,140	\$9,111	\$191,326	\$9,894	\$1,216,916
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$2,007	\$980	\$20,572	\$1,205	\$148,212
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$651	\$958	\$20,109	\$1,255	\$154,375
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$23	\$1	\$23	\$1	\$85
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$111	\$2,335	\$676	\$83,185
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$3,921	\$82,351	\$1,506	\$185,259
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$260	\$5,469	\$115	\$14,089
Swaps			0.00%	\$0	\$2,238	\$47,000	\$382	\$47,000

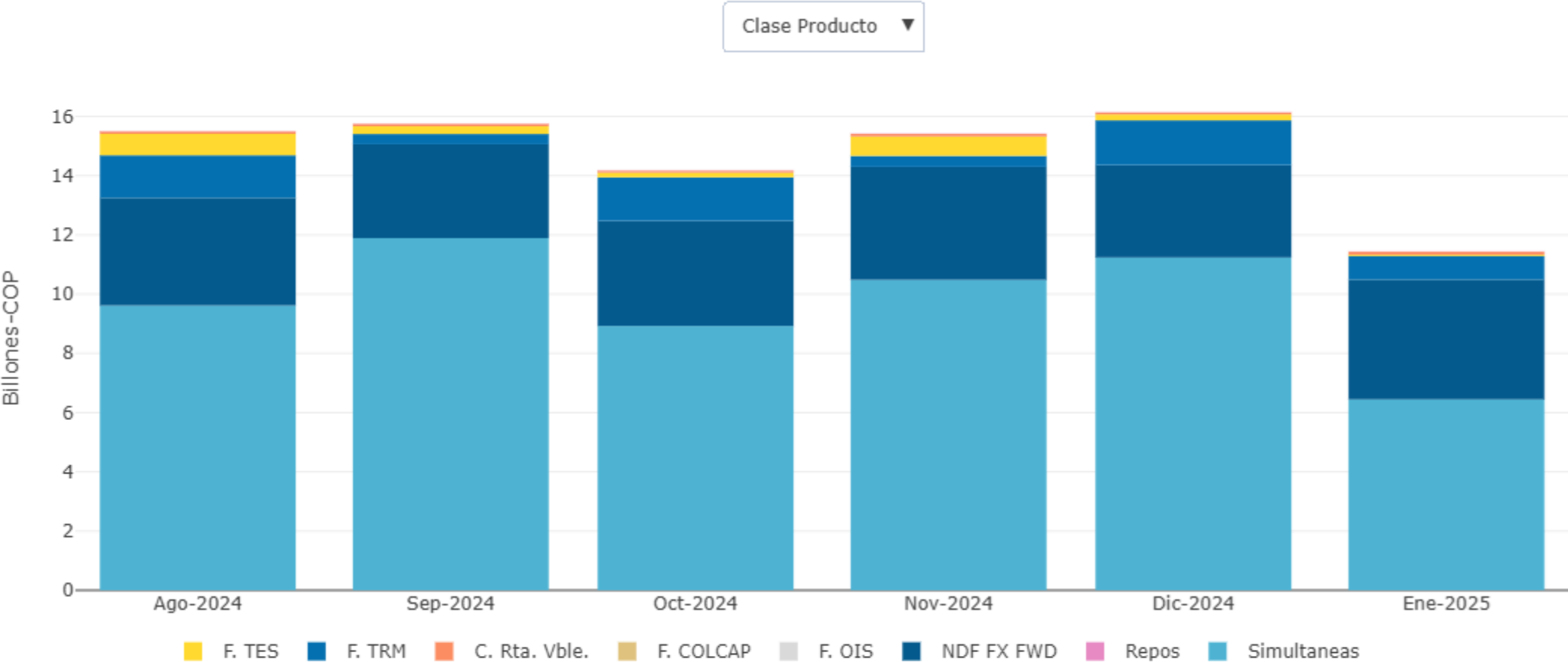
Registros del 10 al 17 de un total de 17
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



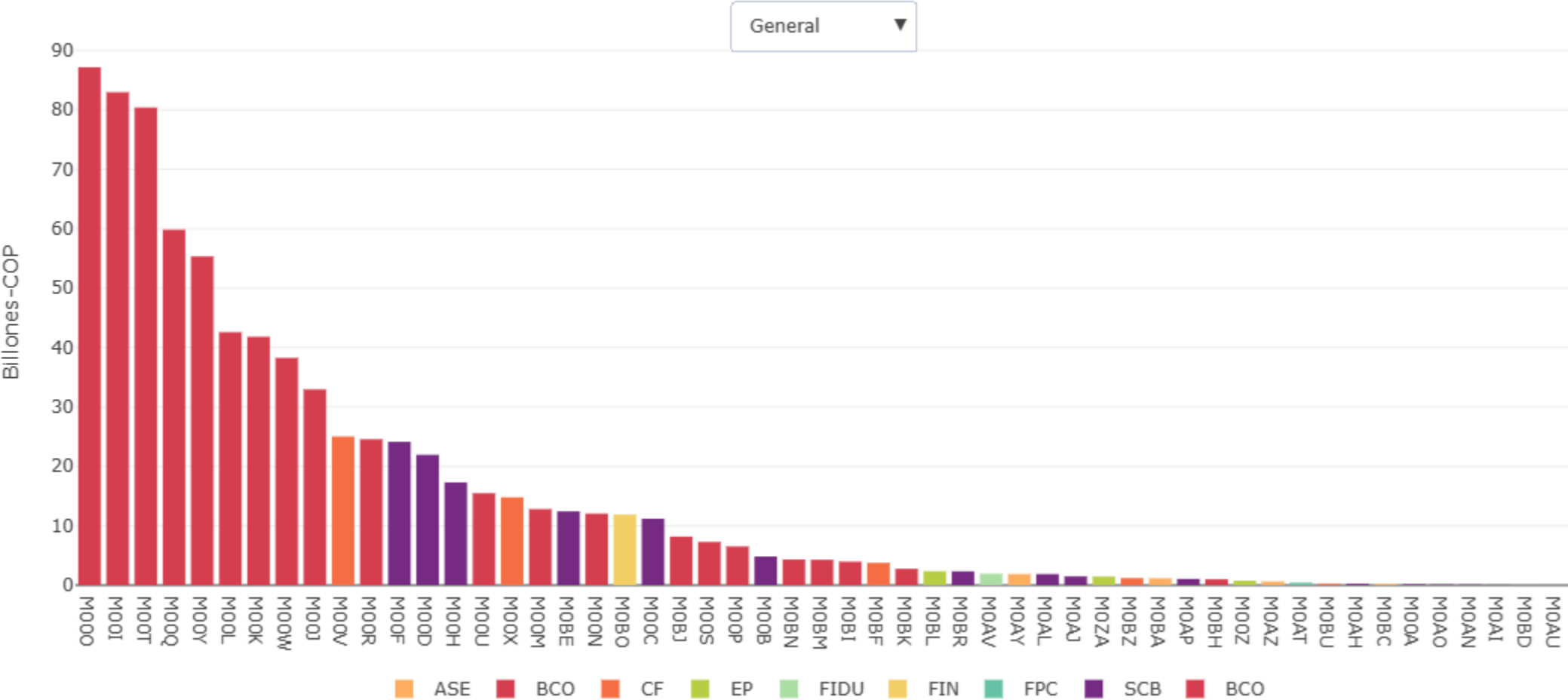
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



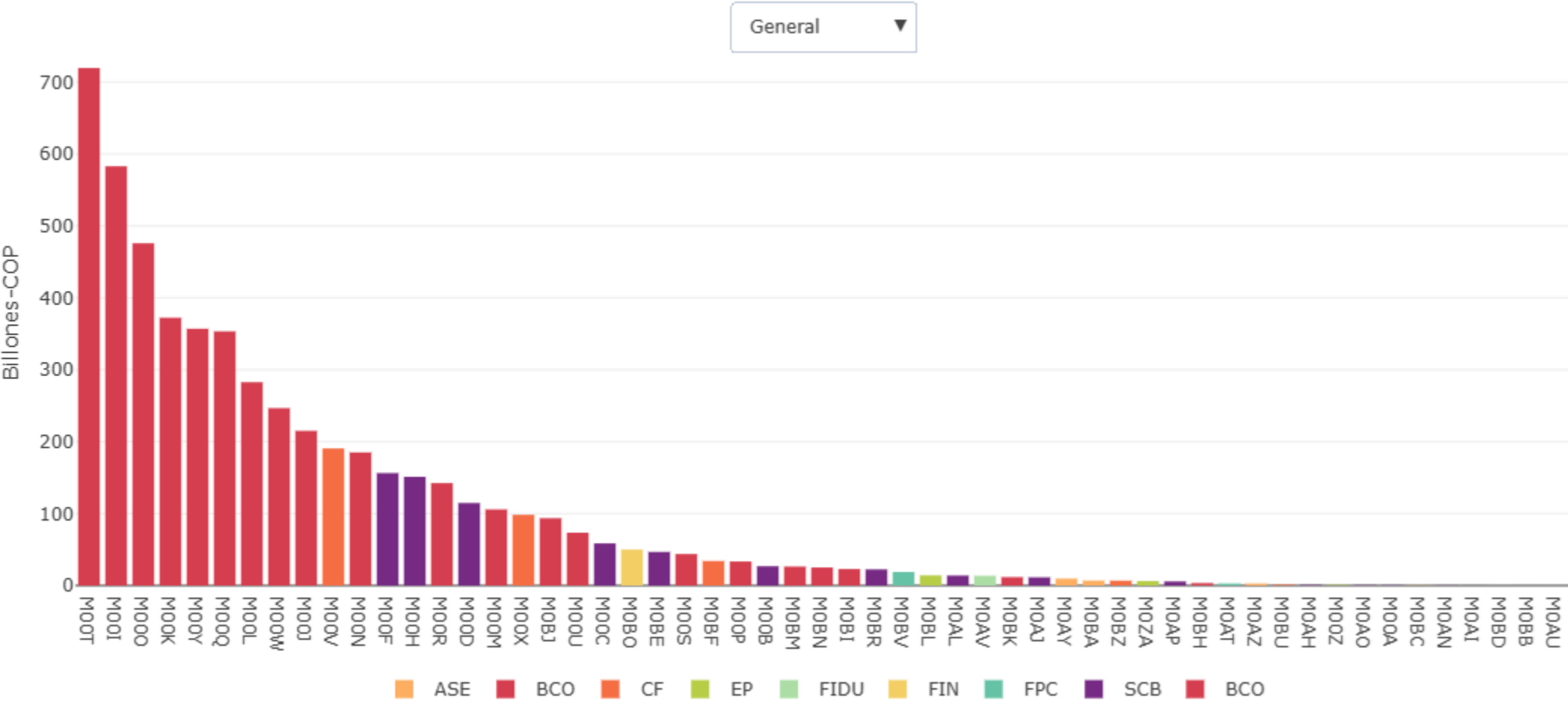
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

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	\$169,074,474	\$169,074,474	\$162,230,230	\$162,230,321	\$156,158,611	\$156,158,707
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$86,054,608	\$86,054,608	\$83,725,465	\$83,725,465	\$77,458,288	\$77,458,288
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$41,935,000	\$41,935,000	\$39,861,810	\$39,861,810	\$36,040,341	\$36,040,341
Derivados	TRM	F. TRM	\$19,586,740	\$19,586,740	\$17,489,271	\$17,489,271	\$17,244,059	\$17,244,059
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$11,988,986	\$11,988,986	\$11,779,597	\$11,779,597	\$14,762,026	\$14,762,026
Derivados	F. TES	F. TES	\$7,435,088	\$7,435,088	\$7,275,733	\$7,275,733	\$6,433,603	\$6,433,603
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$596,924	\$596,924	\$654,281	\$654,281	\$732,845	\$732,845
Derivados	OIS	OIS IBR	\$398,700	\$398,700	\$485,533	\$485,533	\$2,050,035	\$2,050,035
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$319,502	\$319,502	\$169,598	\$169,689	\$147,960	\$148,056

Registros del 1 al 9 de un total de 19
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

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 Variable	Repos y TTV	Repos	\$309,358	\$309,358	\$308,206	\$308,206	\$302,656	\$302,656
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$163,115	\$163,115	\$161,829	\$161,829	\$173,148	\$173,148
Derivados	OIS	F. OIS	\$98,818	\$98,818	\$113,271	\$113,271	\$317,480	\$317,480
Derivados	TRM	Op. TRM	\$86,179	\$86,179	\$69,280	\$69,280	\$48,254	\$48,254
Swaps			\$47,000	\$47,000	\$13,429	\$13,429	\$2,293	\$2,293
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$30,406	\$30,406	\$38,705	\$38,705	\$29,935	\$29,935
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$14,484	\$14,484	\$3,422	\$3,422	\$3,216	\$3,216
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$9,567	\$9,567	\$8,978	\$8,978	\$3,211	\$3,211
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$21	\$21	\$80	\$80

*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31

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
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$0	\$0	\$71,802	\$71,802	\$409,182	\$409,182

Registros del 19 al 19 de un total de 19
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,256,500	\$1,349,833	\$2,142,016
1M-3M	\$1,722,500	\$1,194,857	\$1,593,512
3M-6M	\$2,029,000	\$1,845,476	\$1,140,996
6M-9M	\$1,752,000	\$1,525,548	\$1,196,589
9M-1Y	\$438,500	\$542,167	\$1,037,654
1Y-18M	\$719,500	\$953,000	\$883,919
18M-2Y	\$1,006,250	\$787,821	\$654,171
2Y-5Y	\$276,500	\$285,119	\$384,858
5Y-7Y	\$76,500	\$86,357	\$83,504
7Y-10Y	\$94,250	\$100,679	\$98,821

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2024-08-01 al 2025-01-31



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte