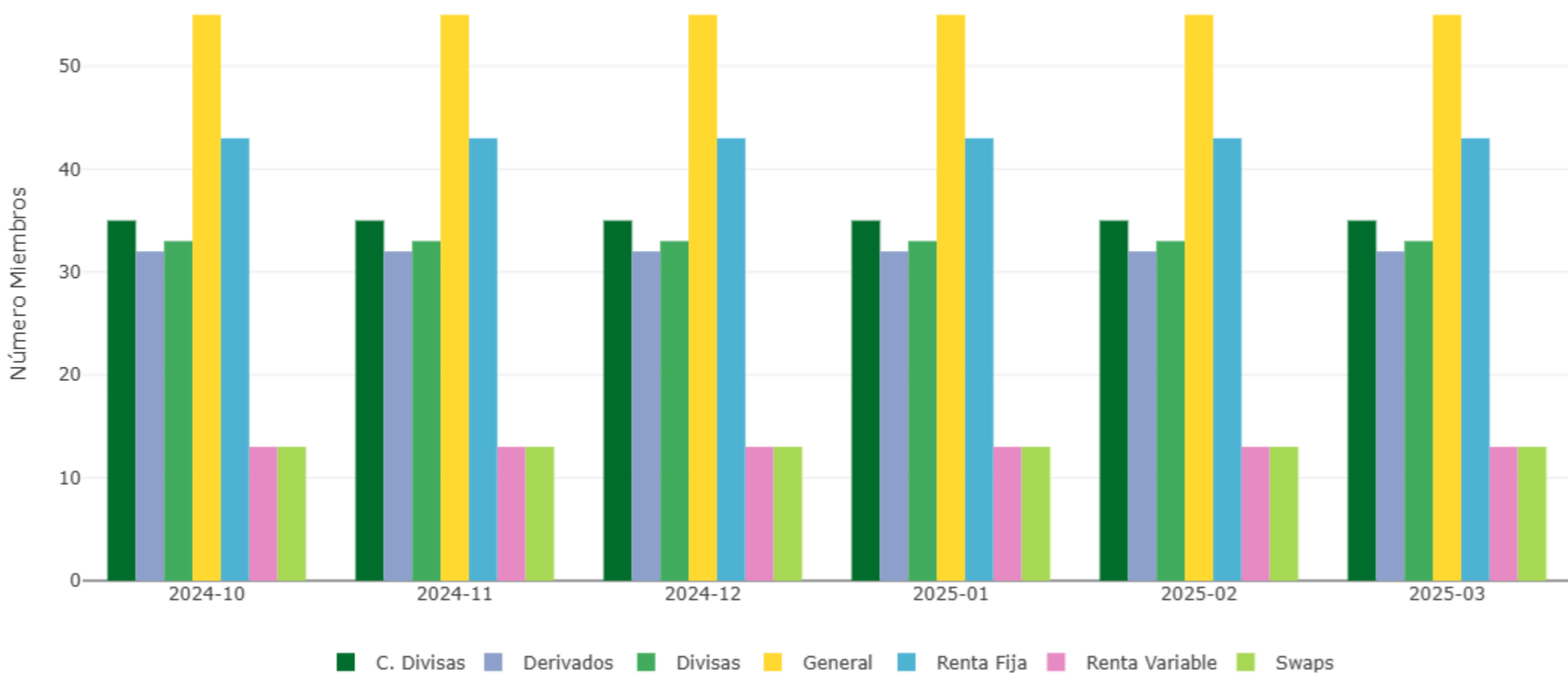


Evolución de Mercado

Marzo 2025



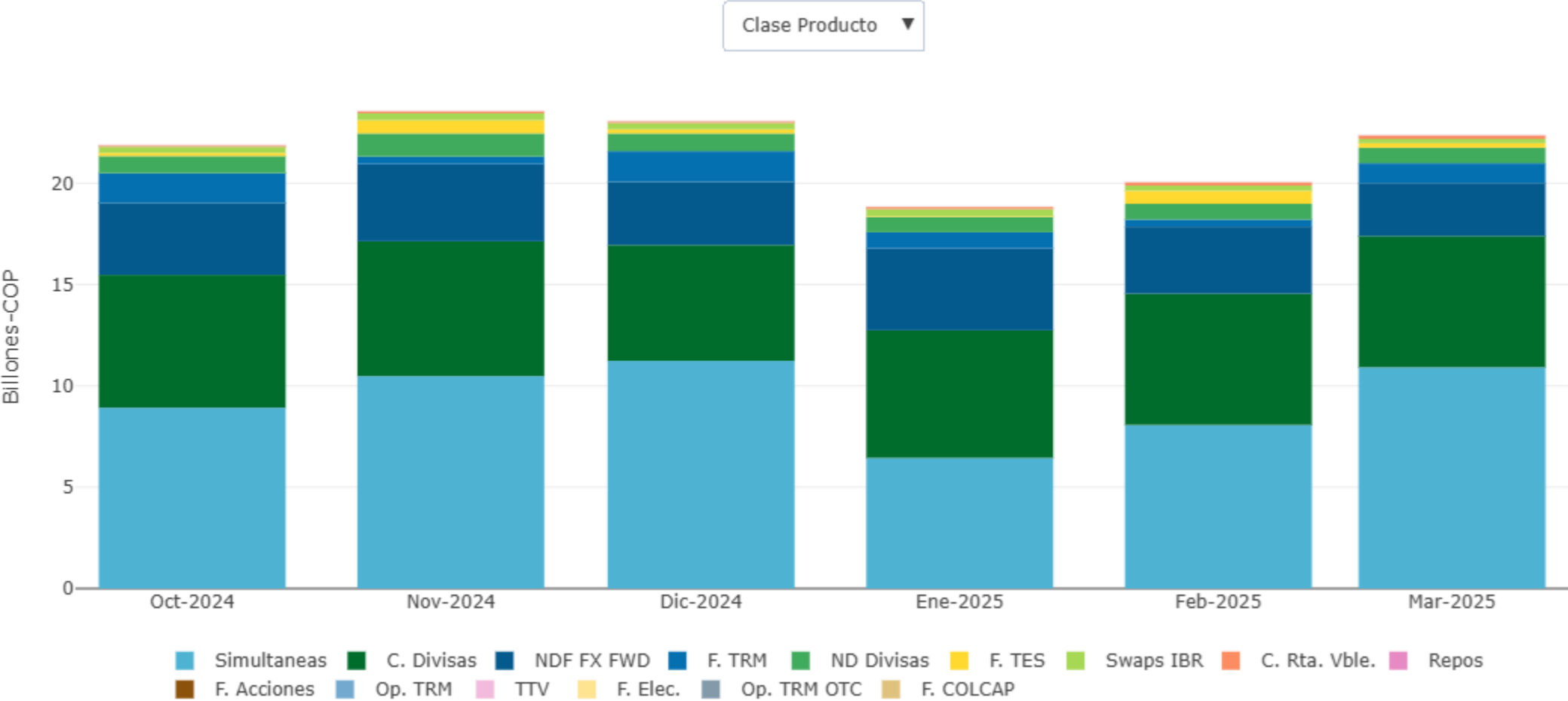
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31

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%	\$19,550,868	\$22,367,061	\$447,341,227	\$21,590,833	\$2,634,081,602
Renta Fija	TES	Simultaneas	59.28%	\$11,590,681	\$10,919,485	\$218,389,704	\$9,306,573	\$1,135,401,870
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	28.18%	\$5,509,723	\$6,478,063	\$129,561,267	\$6,361,374	\$776,087,580
Derivados	TRM	NDF FX FWD	6.83%	\$1,336,023	\$2,612,738	\$52,254,756	\$3,412,197	\$416,288,013
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.80%	\$548,013	\$763,905	\$15,278,093	\$855,185	\$104,332,604
Derivados	TRM	F. TRM	1.11%	\$217,047	\$975,093	\$19,501,864	\$925,061	\$112,857,485
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	0.98%	\$192,000	\$211,150	\$4,223,000	\$293,400	\$35,794,750
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.73%	\$143,441	\$159,899	\$3,197,982	\$105,468	\$12,867,048
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.07%	\$13,133	\$15,168	\$303,368	\$11,473	\$1,399,706

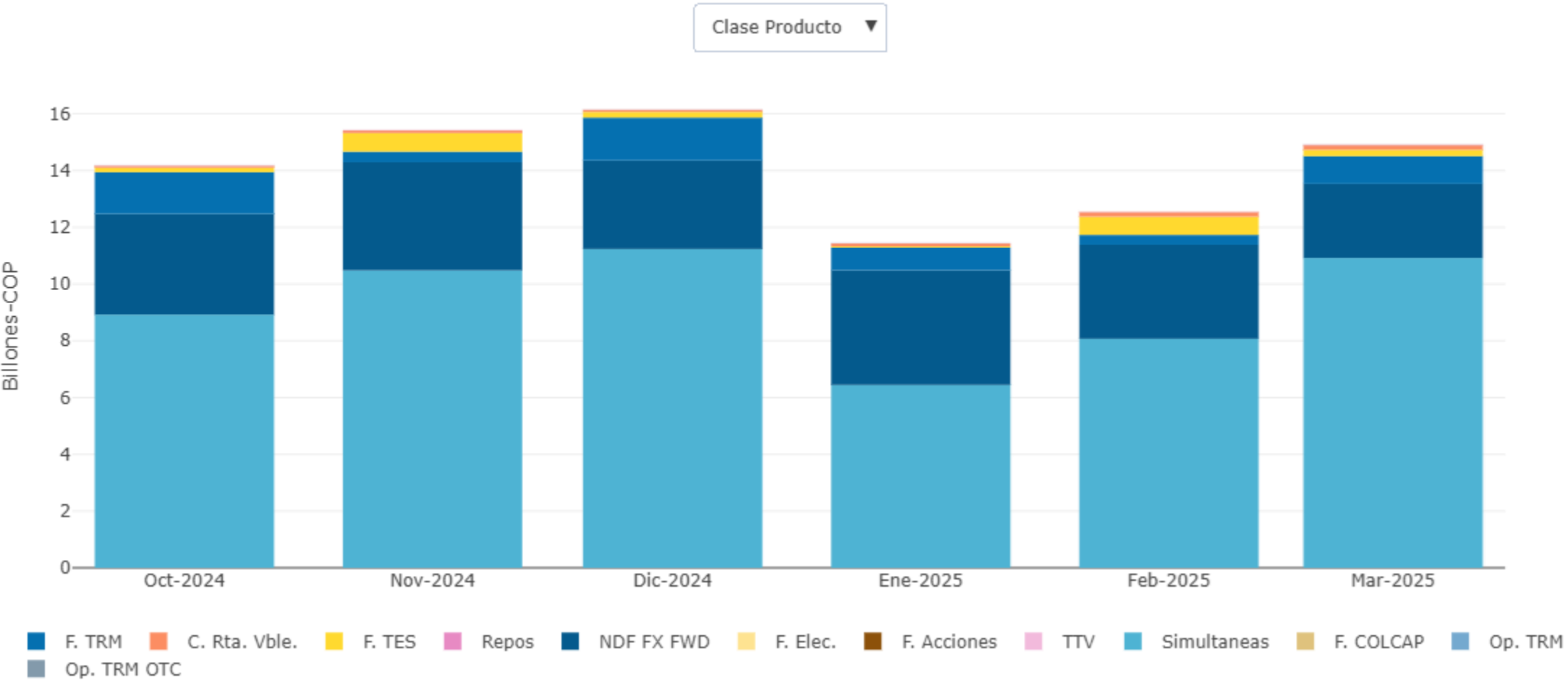
Registros del 1 al 9 de un total de 16
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31

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	TTV	0.00%	\$569	\$1,575	\$31,495	\$1,341	\$163,651
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$237	\$2,958	\$59,154	\$1,486	\$181,282
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$78	\$1,566	\$14	\$1,651
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$0	\$256	\$5,130	\$706	\$86,128
Derivados	F. TES	F. TES	0.00%	\$0	\$226,150	\$4,522,994	\$314,851	\$38,411,840
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$334	\$6,677	\$1,507	\$183,881
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$209	\$4,177	\$198	\$24,113

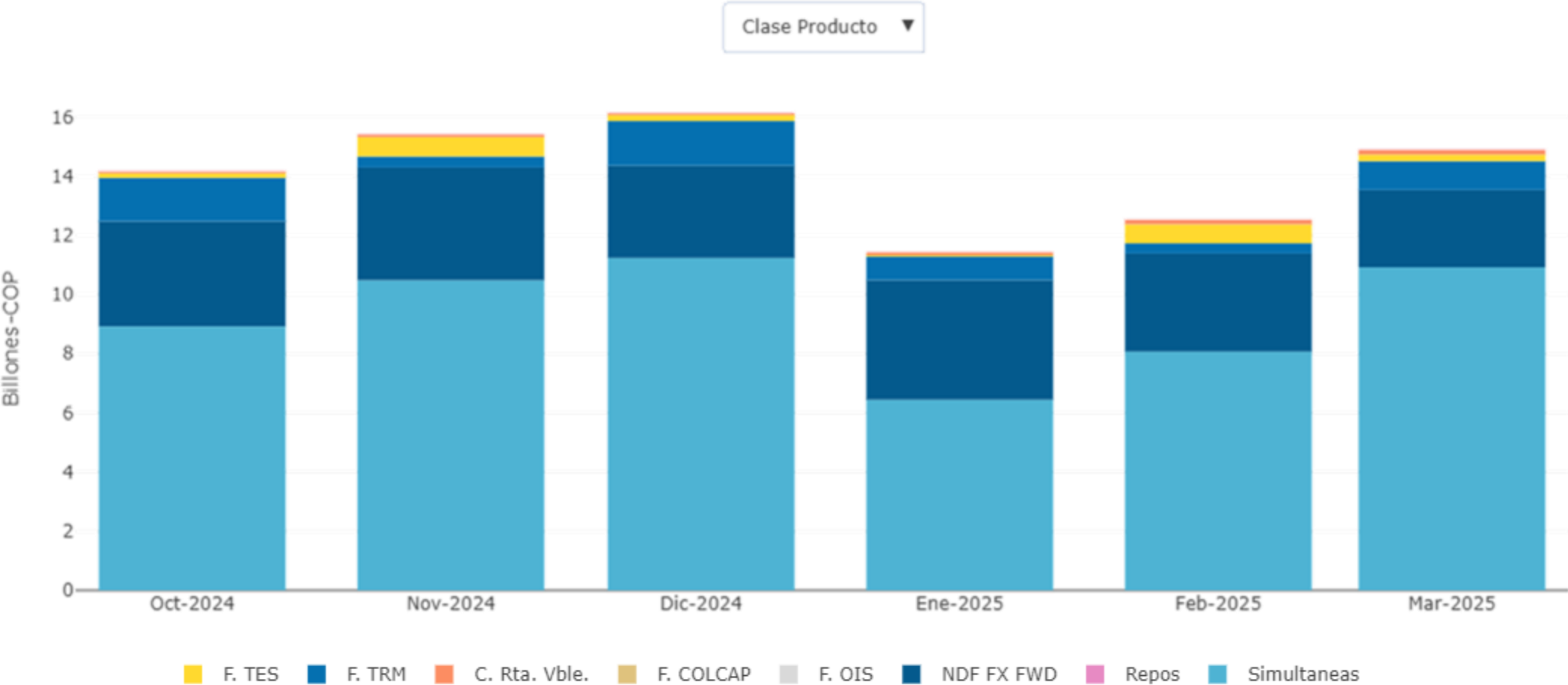
Registros del 10 al 16 de un total de 16
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



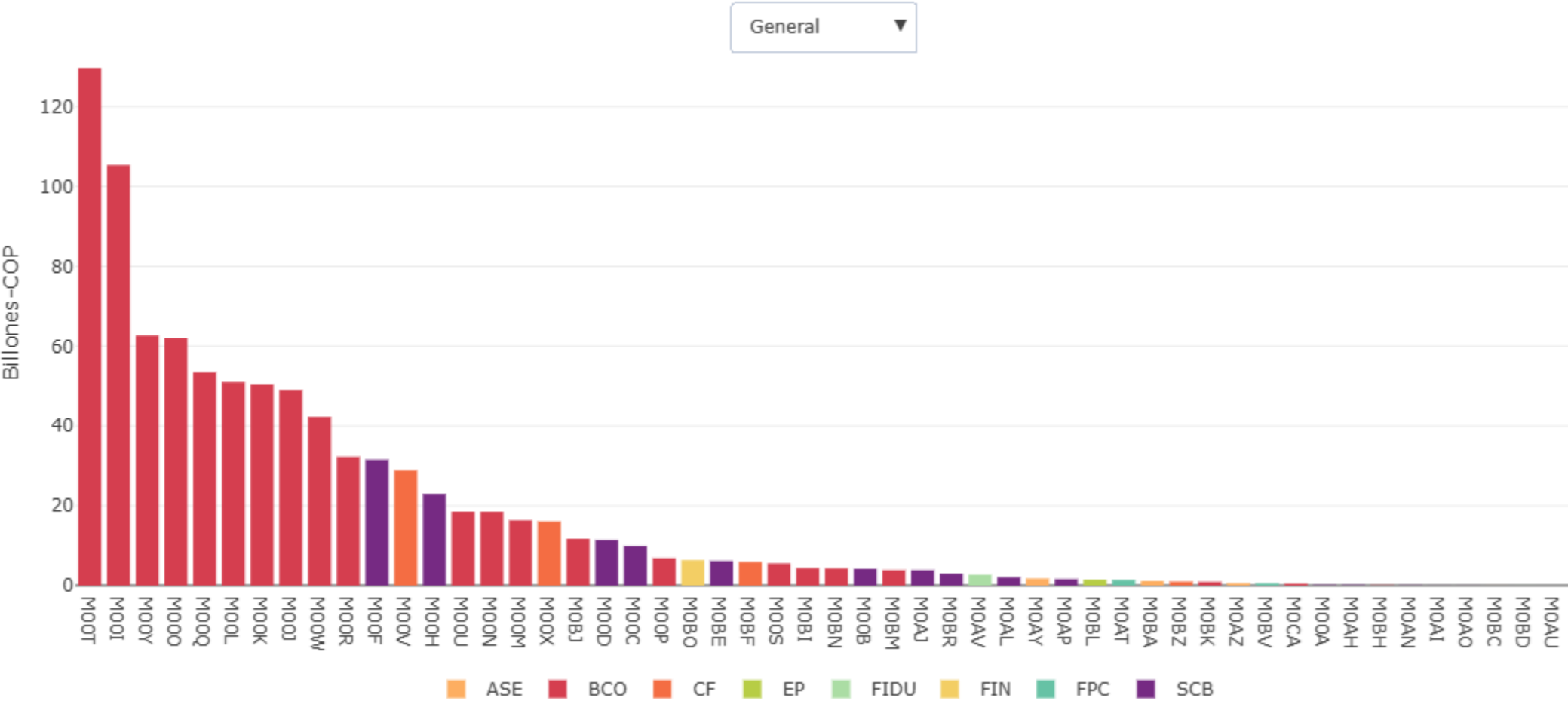
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



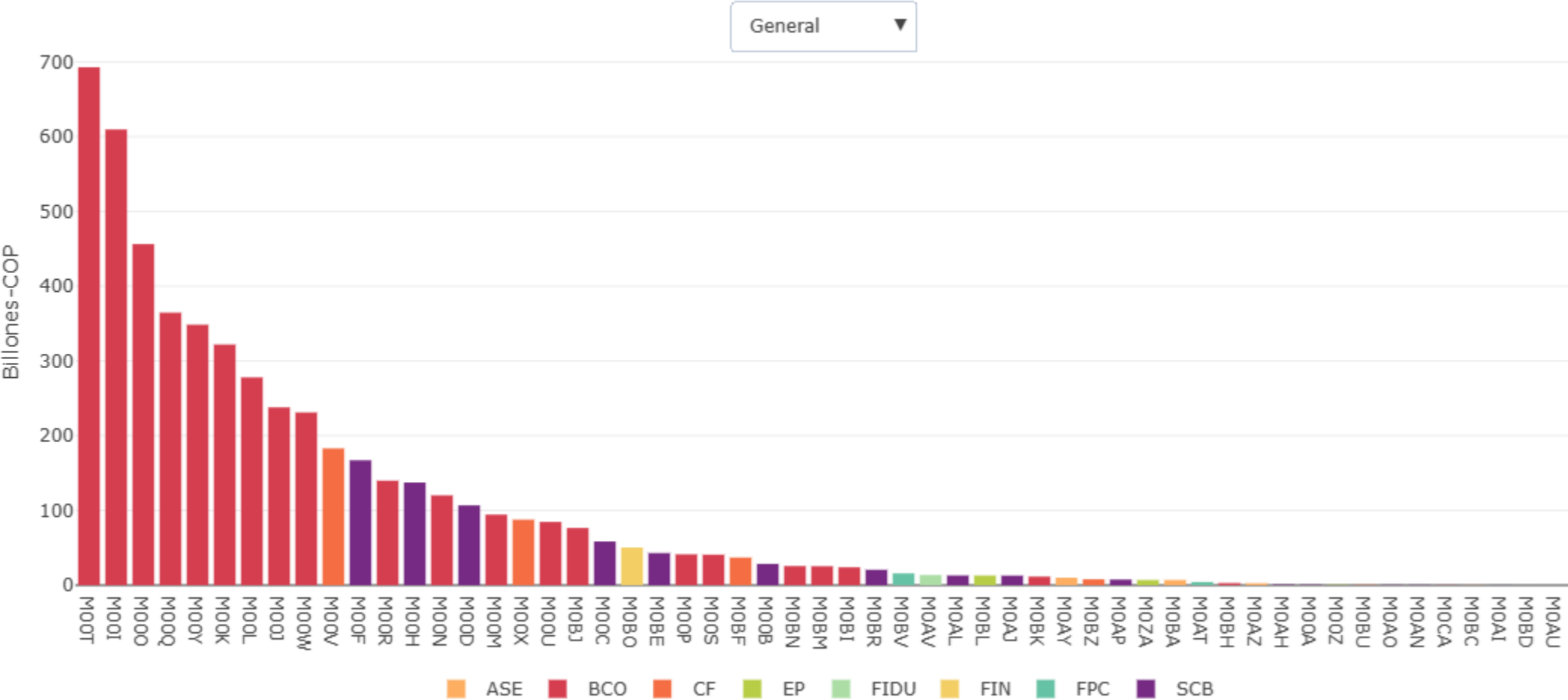
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31

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	\$167,710,964	\$167,710,964	\$165,561,077	\$165,561,077	\$160,824,636	\$160,824,652
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$82,296,119	\$82,296,119	\$80,024,312	\$80,024,312	\$80,108,244	\$80,108,244
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$41,623,000	\$41,623,000	\$42,201,850	\$42,201,850	\$39,207,365	\$39,207,365
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$19,649,403	\$19,649,403	\$17,743,895	\$17,743,895	\$14,992,726	\$14,992,726
Derivados	TRM	F. TRM	\$15,473,147	\$15,473,147	\$16,890,743	\$16,890,743	\$17,310,571	\$17,310,571
Derivados	F. TES	F. TES	\$6,894,428	\$6,894,428	\$6,751,318	\$6,751,318	\$6,262,905	\$6,262,905
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$513,171	\$513,171	\$688,093	\$688,093	\$746,414	\$746,414
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$390,877	\$390,877	\$376,062	\$376,062	\$325,033	\$325,033
Derivados	OIS	OIS IBR	\$293,949	\$293,949	\$293,924	\$293,924	\$1,032,556	\$1,032,556

Registros del 1 al 9 de un total de 18
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31

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
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$278,701	\$278,701	\$274,273	\$274,273	\$177,649	\$177,665
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$136,117	\$136,117	\$146,192	\$146,192	\$171,983	\$171,983
Derivados	OIS	F. OIS	\$69,160	\$69,160	\$69,146	\$69,146	\$201,006	\$201,006
Derivados	TRM	Op. TRM	\$43,939	\$43,939	\$58,270	\$58,270	\$65,149	\$65,149
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$24,457	\$24,457	\$29,881	\$29,881	\$30,126	\$30,126
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$15,941	\$15,941	\$4,061	\$4,061	\$3,661	\$3,661
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$8,554	\$8,554	\$9,020	\$9,020	\$6,107	\$6,107
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$39	\$39	\$17	\$17
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$0	\$0	\$0	\$0	\$183,125	\$183,125

*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31

Reango ▾	Posición Abierta Último Día M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP ▾	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP ▾
0M-1M	\$736,000	\$1,083,600	\$1,885,303
1M-3M	\$1,591,500	\$1,798,425	\$1,538,225
3M-6M	\$1,113,000	\$1,245,975	\$1,397,221
6M-9M	\$1,147,000	\$1,301,575	\$1,327,422
9M-1Y	\$526,500	\$565,300	\$882,893
1Y-18M	\$976,750	\$881,200	\$882,193
18M-2Y	\$957,500	\$972,125	\$811,670
2Y-5Y	\$700,000	\$624,725	\$404,627
5Y-7Y	\$90,500	\$73,400	\$80,045
7Y-10Y	\$55,250	\$61,650	\$90,578

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2024-10-01 al 2025-03-31



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte