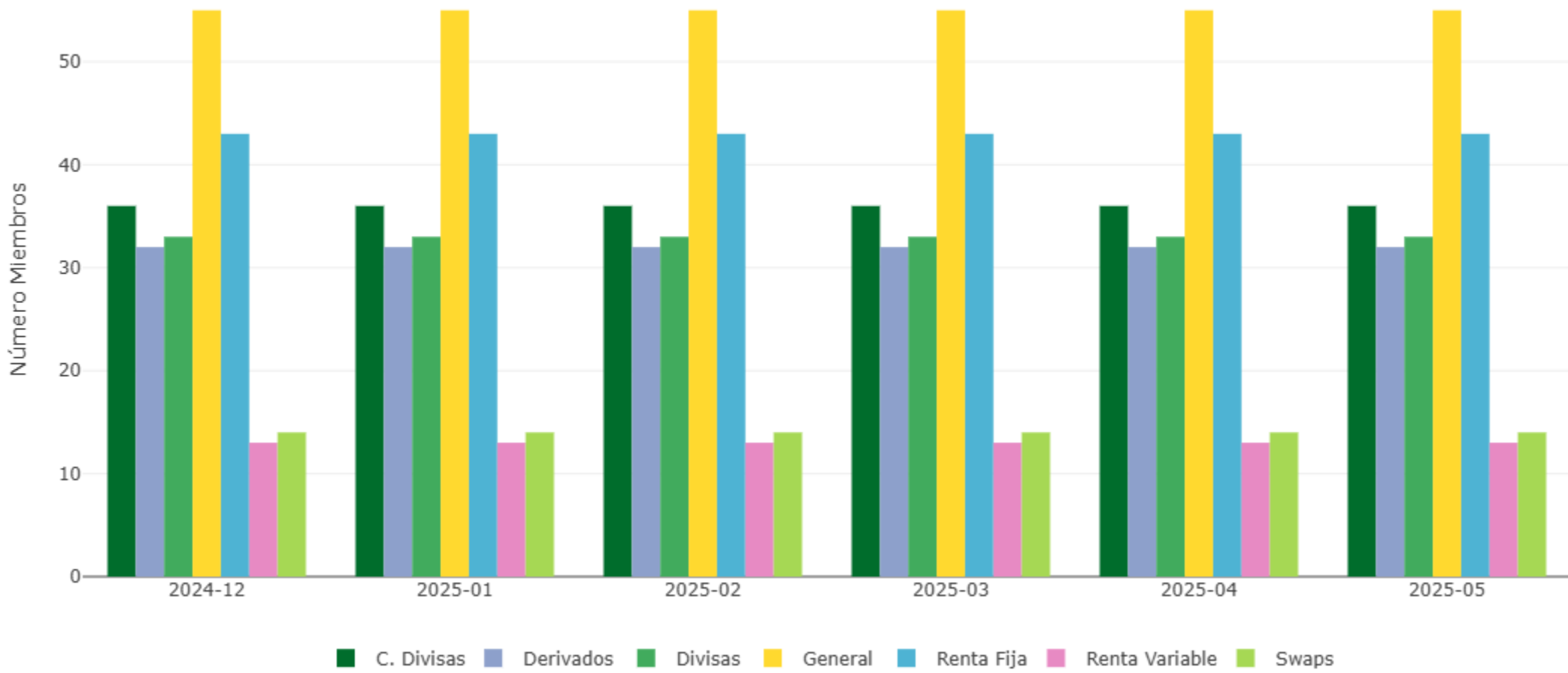


Evolución de Mercado

Mayo 2025



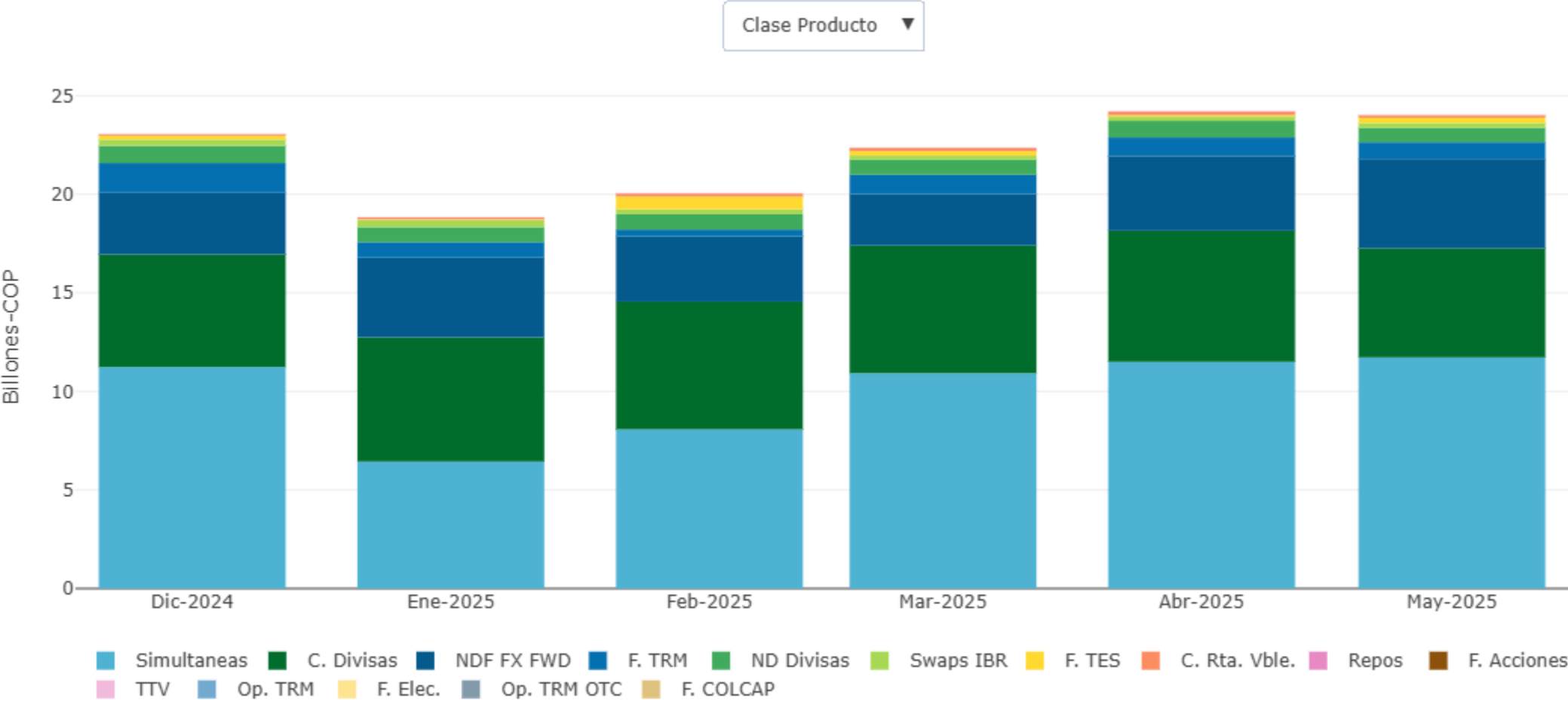
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30

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%	\$23,270,130	\$24,023,475	\$504,492,965	\$22,082,145	\$2,694,021,746
Renta Fija	TES	Simultaneas	41.11%	\$9,566,332	\$11,725,737	\$246,240,480	\$9,968,237	\$1,216,124,866
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	25.76%	\$5,994,326	\$5,542,839	\$116,399,609	\$6,187,959	\$754,930,966
Derivados	TRM	NDF FX FWD	23.02%	\$5,357,424	\$4,531,490	\$95,161,298	\$3,579,688	\$436,721,960
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.70%	\$860,073	\$724,435	\$15,213,125	\$789,247	\$96,288,174
Derivados	F. TES	F. TES	2.40%	\$559,573	\$268,966	\$5,648,294	\$242,261	\$29,555,883
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	1.78%	\$414,152	\$121,105	\$2,543,203	\$129,745	\$15,828,926
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	1.35%	\$313,000	\$247,838	\$5,204,600	\$265,419	\$32,381,100
Derivados	TRM	F. TRM	0.79%	\$183,862	\$841,735	\$17,676,432	\$901,054	\$109,928,643

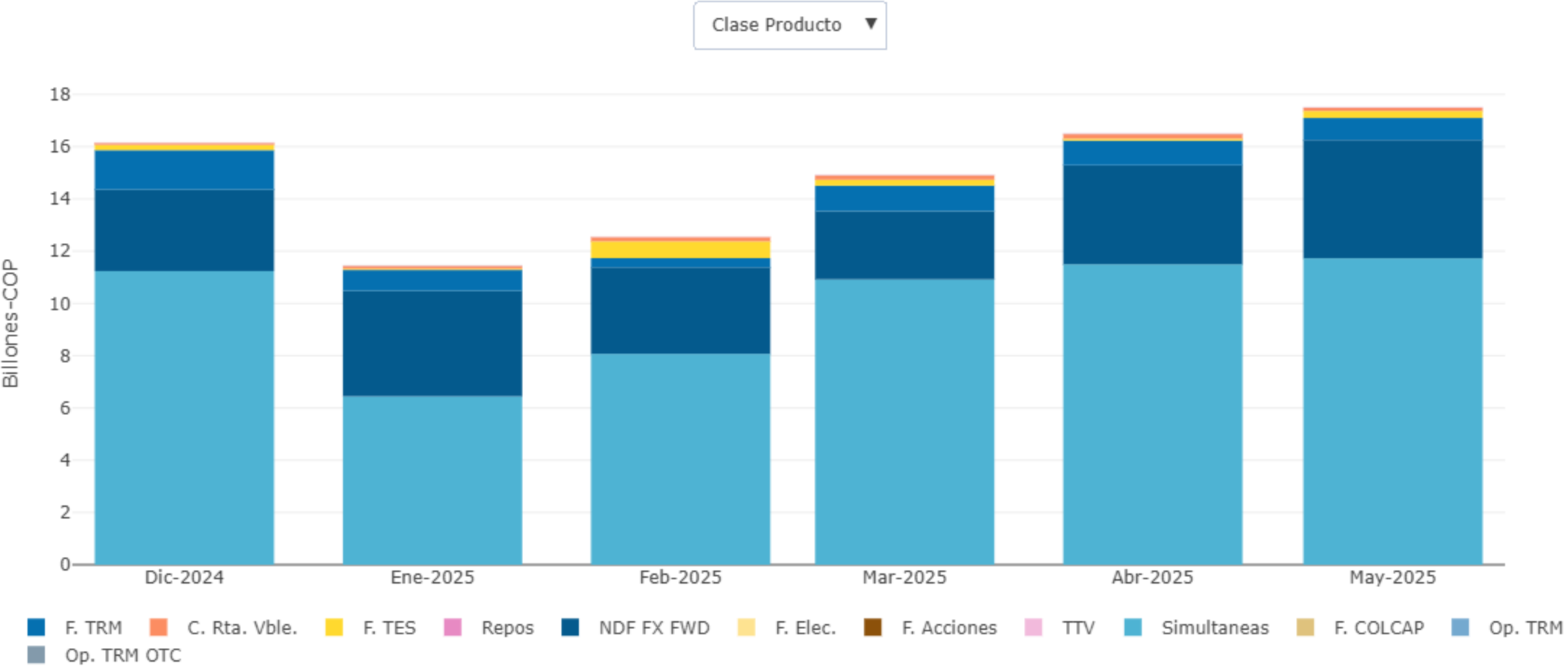
Registros del 1 al 9 de un total de 16
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30

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	0.05%	\$12,796	\$15,051	\$316,070	\$12,708	\$1,550,409
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.03%	\$6,124	\$927	\$19,467	\$920	\$112,253
Derivados	TRM	Op. TRM	0.01%	\$2,100	\$160	\$3,364	\$1,021	\$124,594
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$367	\$1,548	\$32,508	\$1,745	\$212,891
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$0	\$1,643	\$34,513	\$1,959	\$238,971
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$13	\$1,630
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$168	\$20,481

Registros del 10 al 16 de un total de 16
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



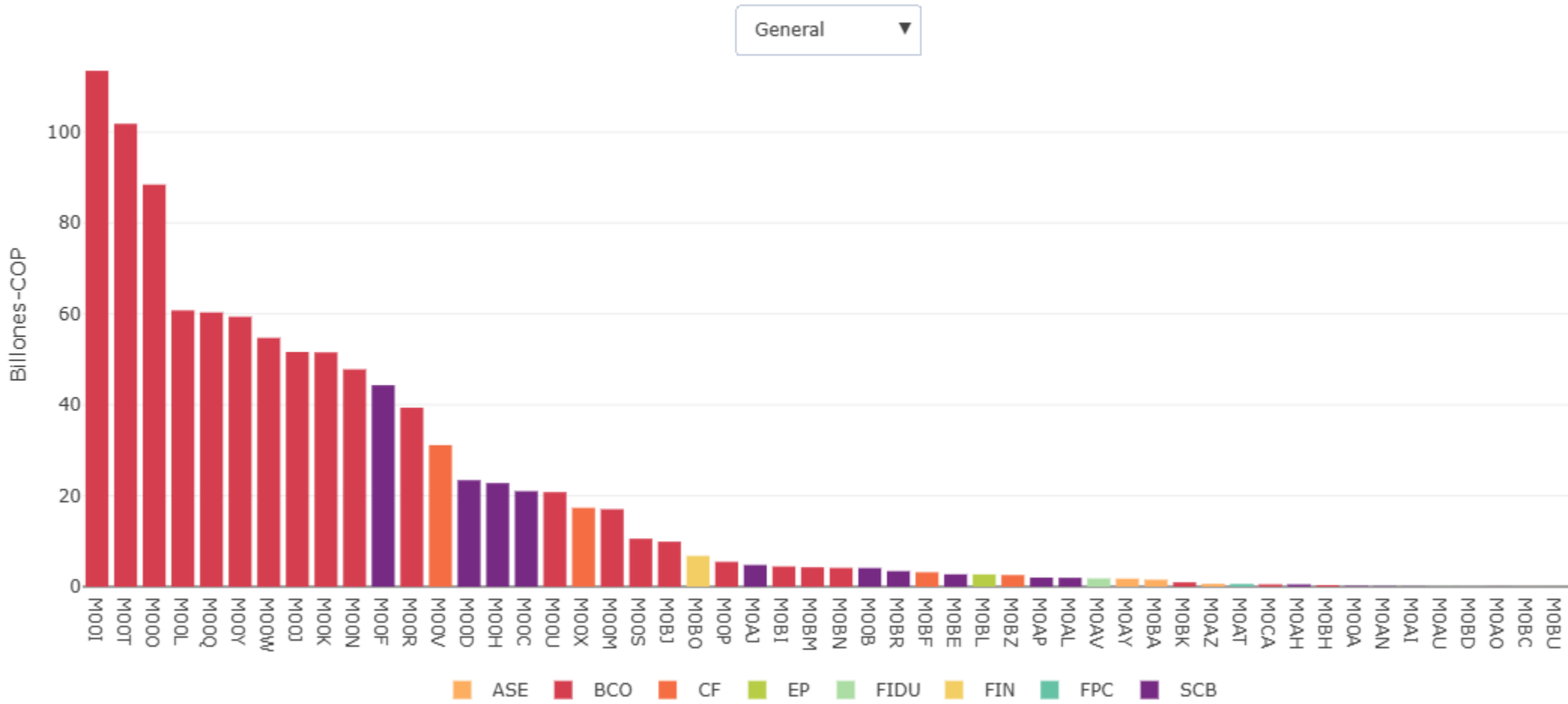
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



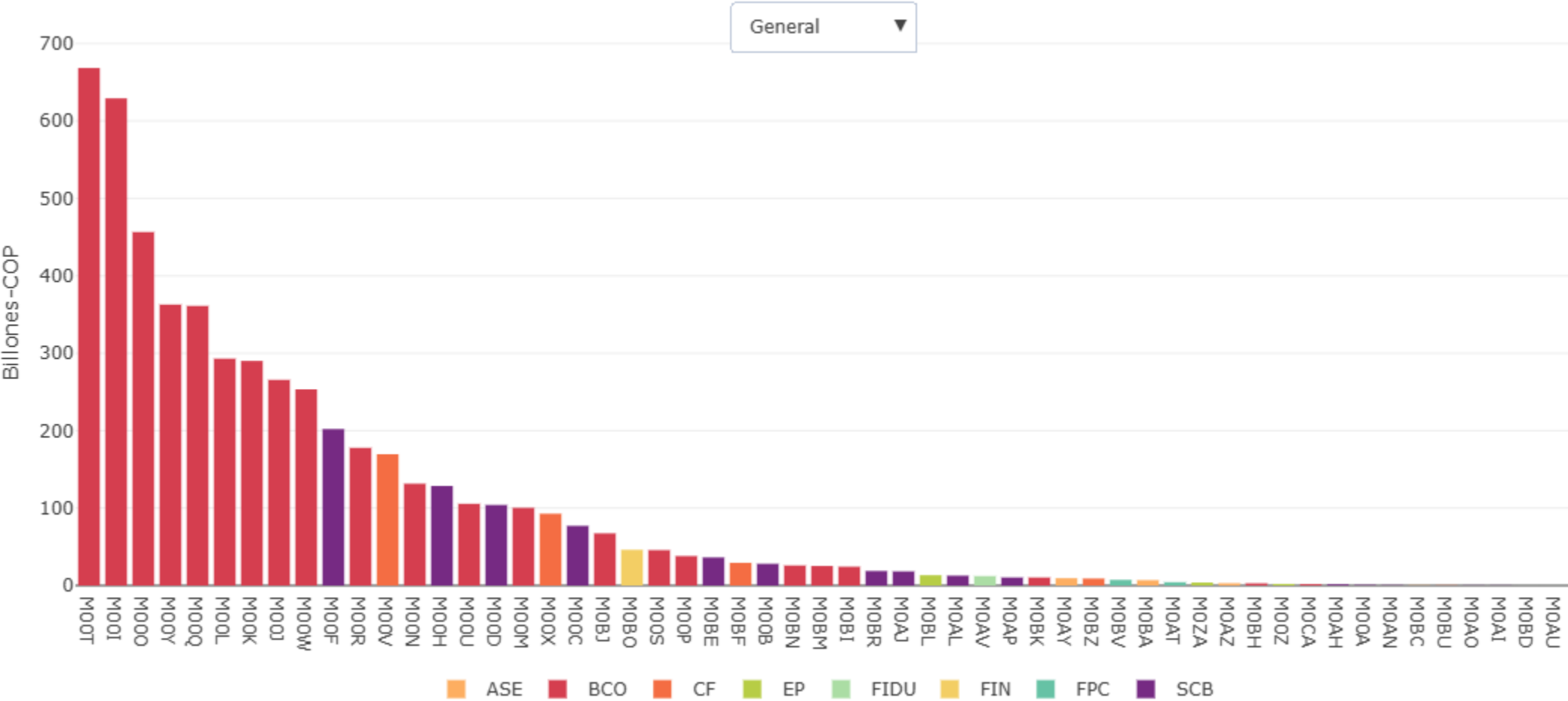
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



*Datos del 2025-05-01 al 2025-05-30



*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



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	\$175,576,100	\$175,576,100	\$174,172,120	\$174,172,128	\$166,687,242	\$166,687,264
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$88,320,384	\$88,320,384	\$87,309,611	\$87,309,611	\$83,364,052	\$83,364,052
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$38,942,600	\$38,942,600	\$39,147,948	\$39,147,948	\$40,623,438	\$40,623,438
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$22,271,116	\$22,271,116	\$21,530,403	\$21,530,403	\$16,680,245	\$16,680,245
Derivados	TRM	F. TRM	\$16,034,581	\$16,034,581	\$17,429,424	\$17,429,424	\$17,292,433	\$17,292,433
Derivados	F. TES	F. TES	\$8,045,262	\$8,045,262	\$7,280,985	\$7,280,985	\$6,664,797	\$6,664,797
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$849,324	\$849,324	\$658,238	\$658,238	\$700,968	\$700,968
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$400,776	\$400,776	\$285,528	\$285,528	\$339,205	\$339,205
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$373,434	\$373,434	\$175,610	\$175,617	\$204,056	\$204,078

Registros del 1 al 9 de un total de 18
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



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	OIS IBR	\$118,584	\$118,584	\$132,323	\$132,323	\$415,599	\$415,599
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	\$104,878	\$104,878	\$100,803	\$100,803	\$147,671	\$147,671
Derivados	OIS	F. OIS	\$43,358	\$43,358	\$48,366	\$48,366	\$106,640	\$106,640
Derivados	TRM	Op. TRM	\$38,502	\$38,502	\$36,877	\$36,877	\$57,542	\$57,542
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$27,548	\$27,548	\$26,032	\$26,032	\$31,489	\$31,489
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$5,352	\$5,352	\$5,484	\$5,484	\$7,541	\$7,541
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$401	\$401	\$4,488	\$4,488	\$5,084	\$5,084
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$0	\$0	\$13	\$13
Derivados	IBR FOR.	IBR FOR.	\$0	\$0	\$0	\$0	\$46,468	\$46,468

Registros del 10 al 18 de un total de 18
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,269,000	\$1,588,452	\$1,564,361
1M-3M	\$1,314,500	\$1,289,167	\$1,400,980
3M-6M	\$1,597,500	\$1,625,071	\$1,583,471
6M-9M	\$518,000	\$470,119	\$1,137,799
9M-1Y	\$589,000	\$571,881	\$615,881
1Y-18M	\$674,750	\$793,583	\$900,764
18M-2Y	\$1,313,100	\$1,157,971	\$975,405
2Y-5Y	\$943,000	\$905,810	\$556,410
5Y-7Y	\$66,000	\$68,929	\$76,148
7Y-10Y	\$92,250	\$86,679	\$80,389

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2024-12-01 al 2025-05-30



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte