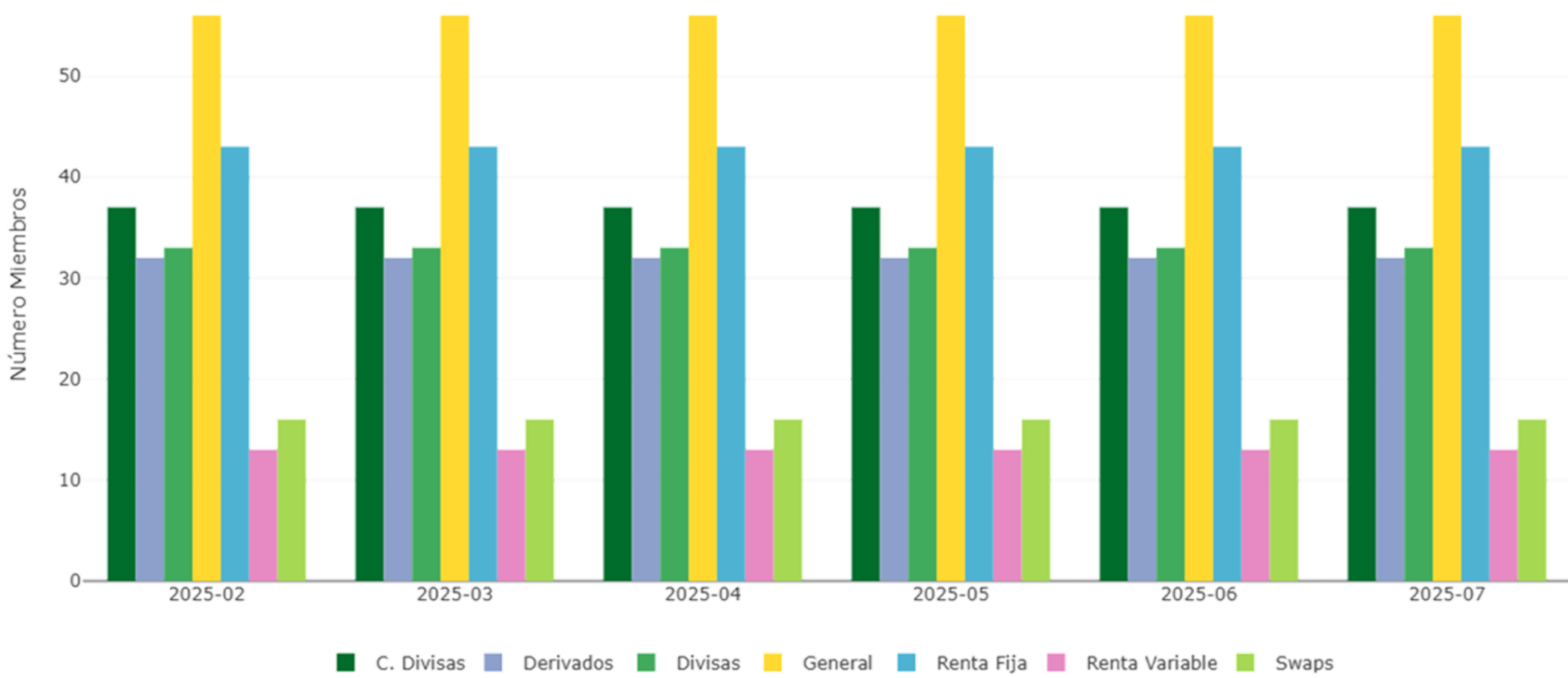


Evolución de Mercado

Julio 2025

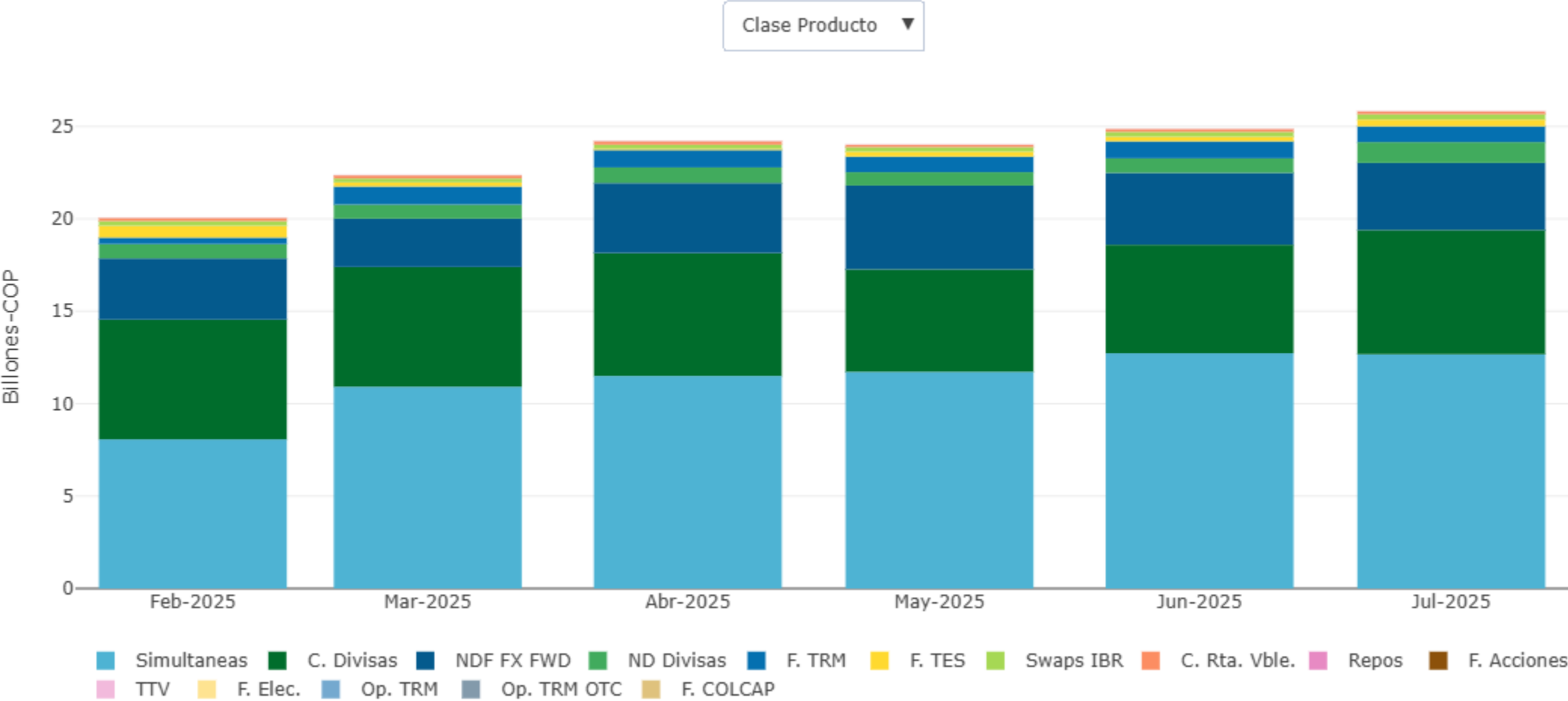


*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31

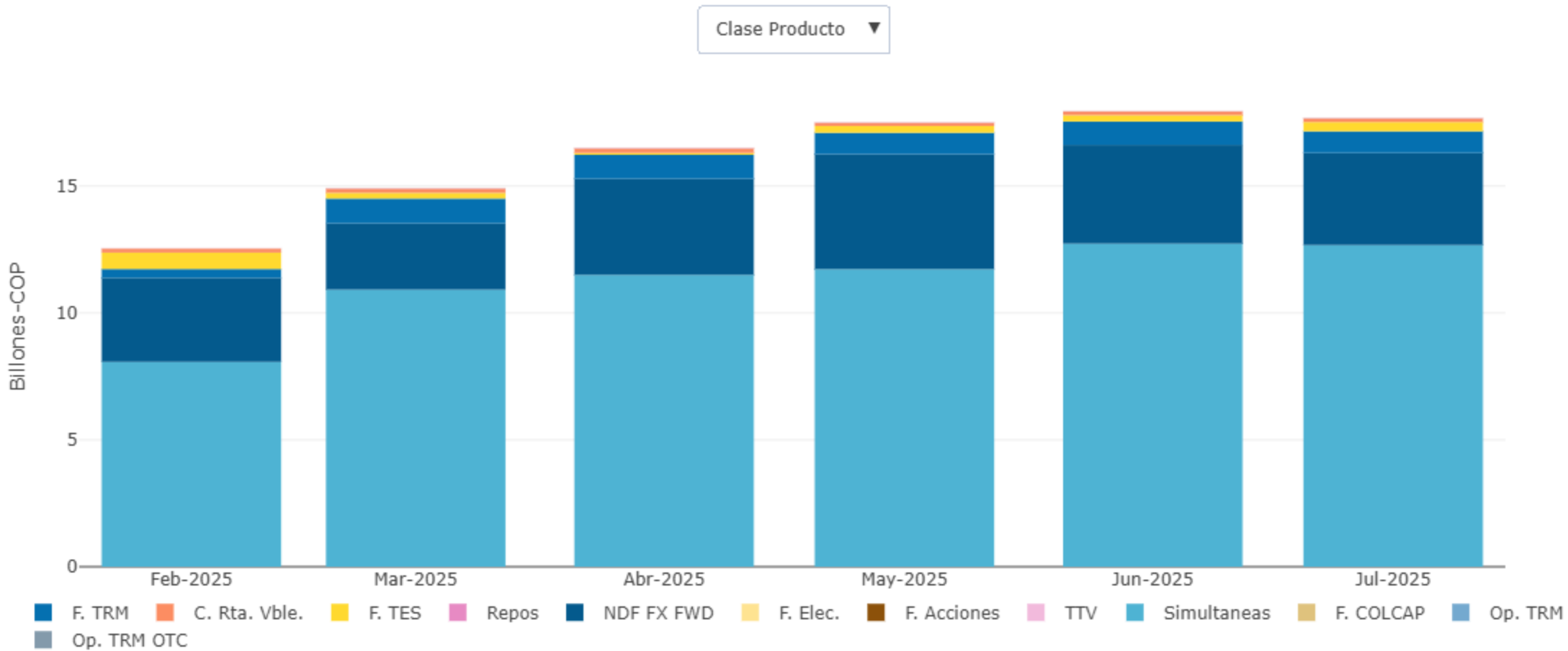
Segmento	Grupo Producto	Clase Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$26,739,090	\$25,824,126	\$593,954,891	\$23,596,339	\$2,878,753,414
Renta Fija	TES	Simultaneas	63.16%	\$16,888,346	\$12,673,804	\$291,497,487	\$11,284,664	\$1,376,728,971
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	24.56%	\$6,567,494	\$6,723,741	\$154,646,032	\$6,300,746	\$768,690,966
Derivados	TRM	NDF FX FWD	6.36%	\$1,701,689	\$3,630,754	\$83,507,348	\$3,630,876	\$442,966,862
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	3.53%	\$945,022	\$1,123,233	\$25,834,350	\$843,399	\$102,894,640
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	1.12%	\$300,000	\$296,570	\$6,821,100	\$248,641	\$30,334,200
Derivados	TRM	F. TRM	0.69%	\$184,492	\$852,101	\$19,598,317	\$812,703	\$99,149,760
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.38%	\$101,738	\$140,157	\$3,223,613	\$148,343	\$18,097,816
Derivados	F. TES	F. TES	0.14%	\$37,504	\$365,610	\$8,409,028	\$307,405	\$37,503,407

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%	\$9,285	\$12,997	\$298,936	\$13,727	\$1,674,691
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$1,306	\$403	\$9,280	\$1,052	\$128,373
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$1,129	\$771	\$17,728	\$1,795	\$219,018
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$1,084	\$2,242	\$51,569	\$2,146	\$261,841
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$13	\$1,566
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$1,744	\$40,102	\$704	\$85,880
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$126	\$15,423

Registros del 10 al 16 de un total de 16
*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



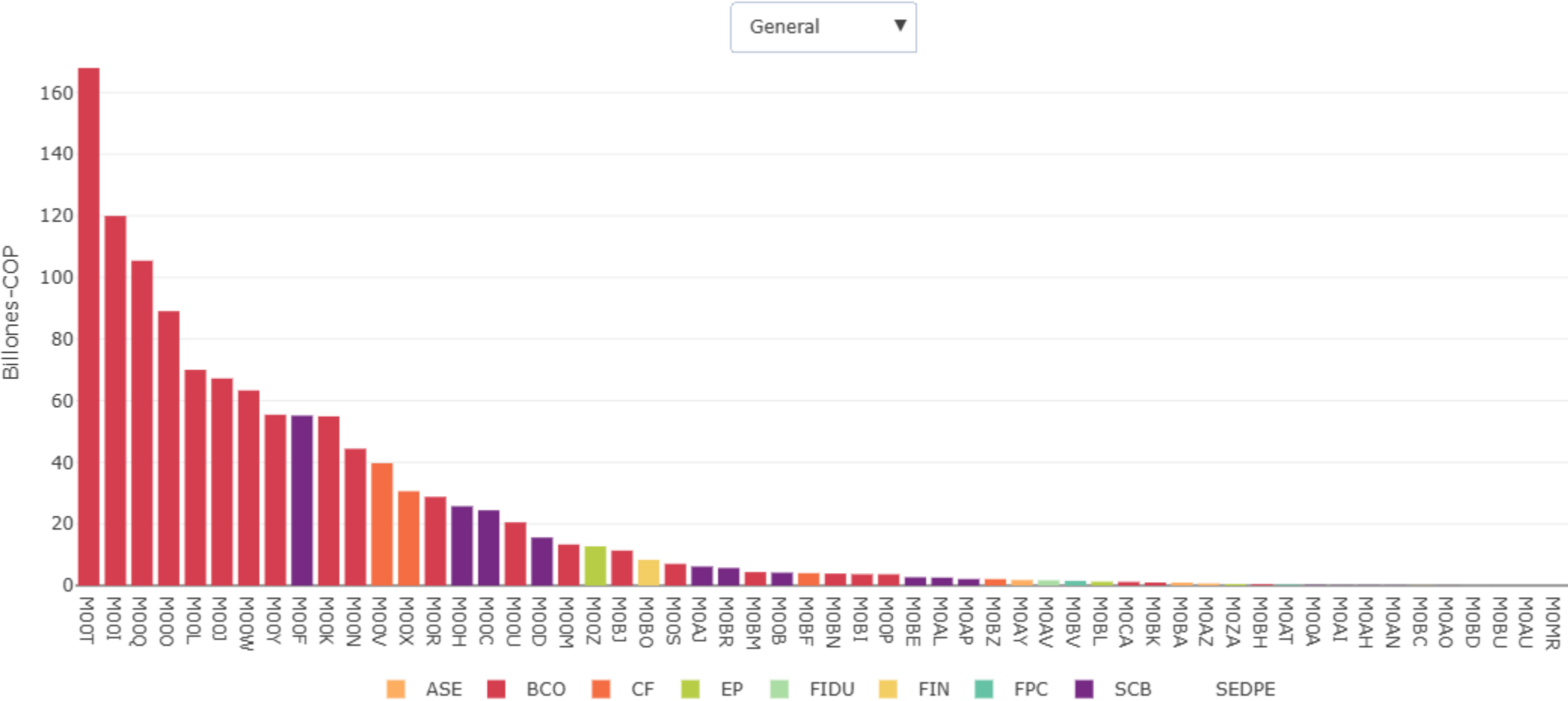
*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



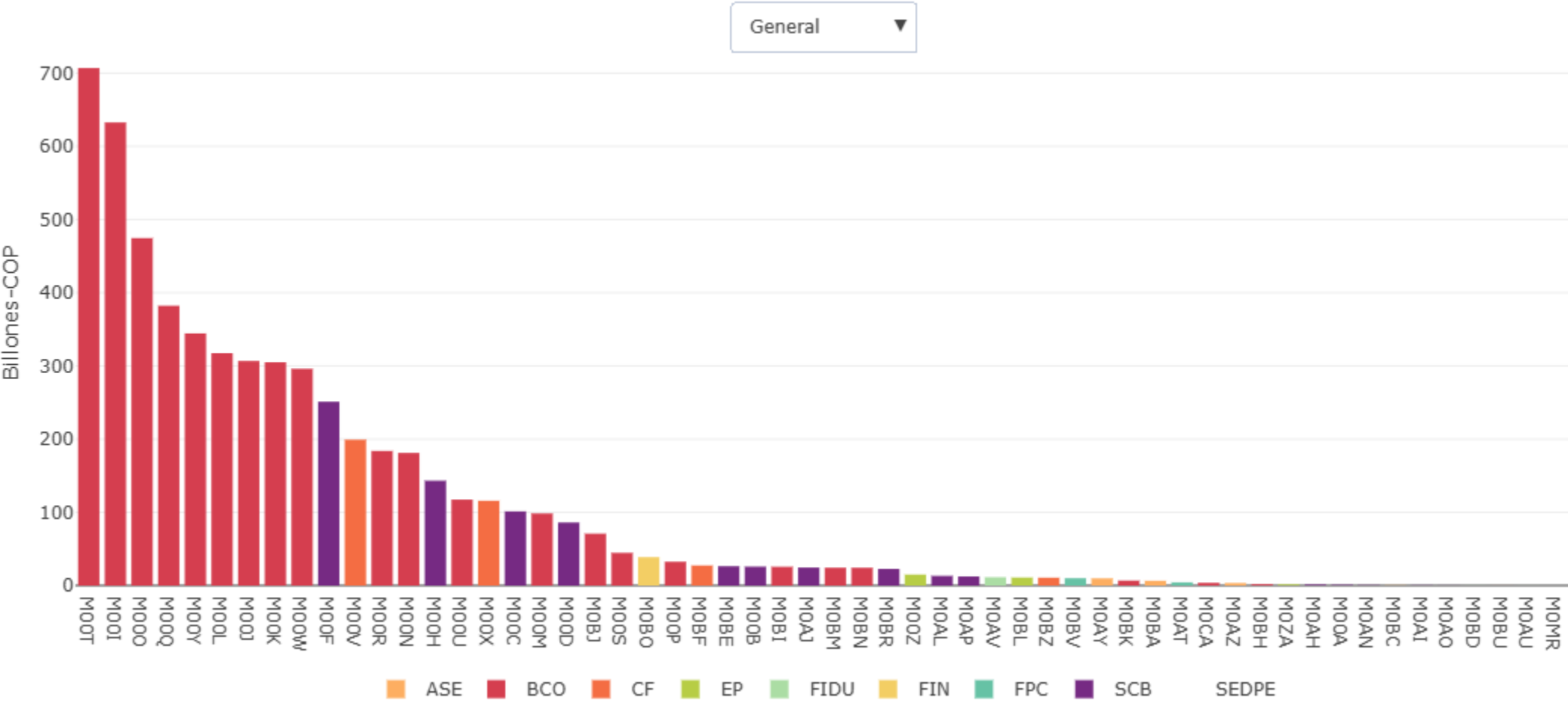
*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



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	\$179,383,911	\$179,383,911	\$172,221,898	\$172,221,898	\$170,343,890	\$170,343,925
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$89,970,758	\$89,970,758	\$85,227,027	\$85,227,027	\$84,657,426	\$84,657,426
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$40,316,700	\$40,316,700	\$39,577,948	\$39,577,948	\$40,680,775	\$40,680,775
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$24,281,346	\$24,281,346	\$22,354,184	\$22,354,184	\$19,670,840	\$19,670,840
Derivados	TRM	F. TRM	\$16,136,518	\$16,136,518	\$16,431,136	\$16,431,136	\$16,817,349	\$16,817,349
Derivados	F. TES	F. TES	\$7,057,662	\$7,057,662	\$6,790,295	\$6,790,295	\$6,728,480	\$6,728,480
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$801,955	\$801,955	\$997,624	\$997,624	\$741,457	\$741,457
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$339,428	\$339,428	\$318,783	\$318,783	\$346,396	\$346,396
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$248,034	\$248,034	\$230,246	\$230,246	\$232,742	\$232,777



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	F. Elec.	F. Elec.	\$95,757	\$95,757	\$95,337	\$95,337	\$123,823	\$123,823
Derivados	TRM	Op. TRM	\$51,187	\$51,187	\$45,550	\$45,550	\$46,374	\$46,374
Derivados	OIS	F. OIS	\$43,365	\$43,365	\$43,366	\$43,366	\$57,247	\$57,247
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$35,169	\$35,169	\$28,697	\$28,697	\$28,843	\$28,843
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$4,241	\$4,241	\$4,313	\$4,313	\$6,717	\$6,717
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$1,790	\$1,790	\$1,121	\$1,121	\$4,795	\$4,795
Derivados	F. Rta. Vble.	F. COLCAP	\$0	\$0	\$0	\$0	\$6	\$6
Derivados	OIS	OIS IBR	\$0	\$0	\$76,273	\$76,273	\$200,619	\$200,619

Registros del 10 al 17 de un total de 17
*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,550,500	\$1,375,196	\$1,404,955
1M-3M	\$1,829,000	\$1,501,435	\$1,489,320
3M-6M	\$583,000	\$723,065	\$1,342,184
6M-9M	\$604,000	\$660,457	\$900,295
9M-1Y	\$569,500	\$661,522	\$595,582
1Y-18M	\$727,250	\$750,793	\$820,939
18M-2Y	\$805,100	\$1,019,274	\$1,102,559
2Y-5Y	\$1,991,600	\$1,706,326	\$938,893
5Y-7Y	\$63,500	\$70,152	\$71,484
7Y-10Y	\$50,000	\$60,272	\$72,230

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2025-02-01 al 2025-07-31



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte