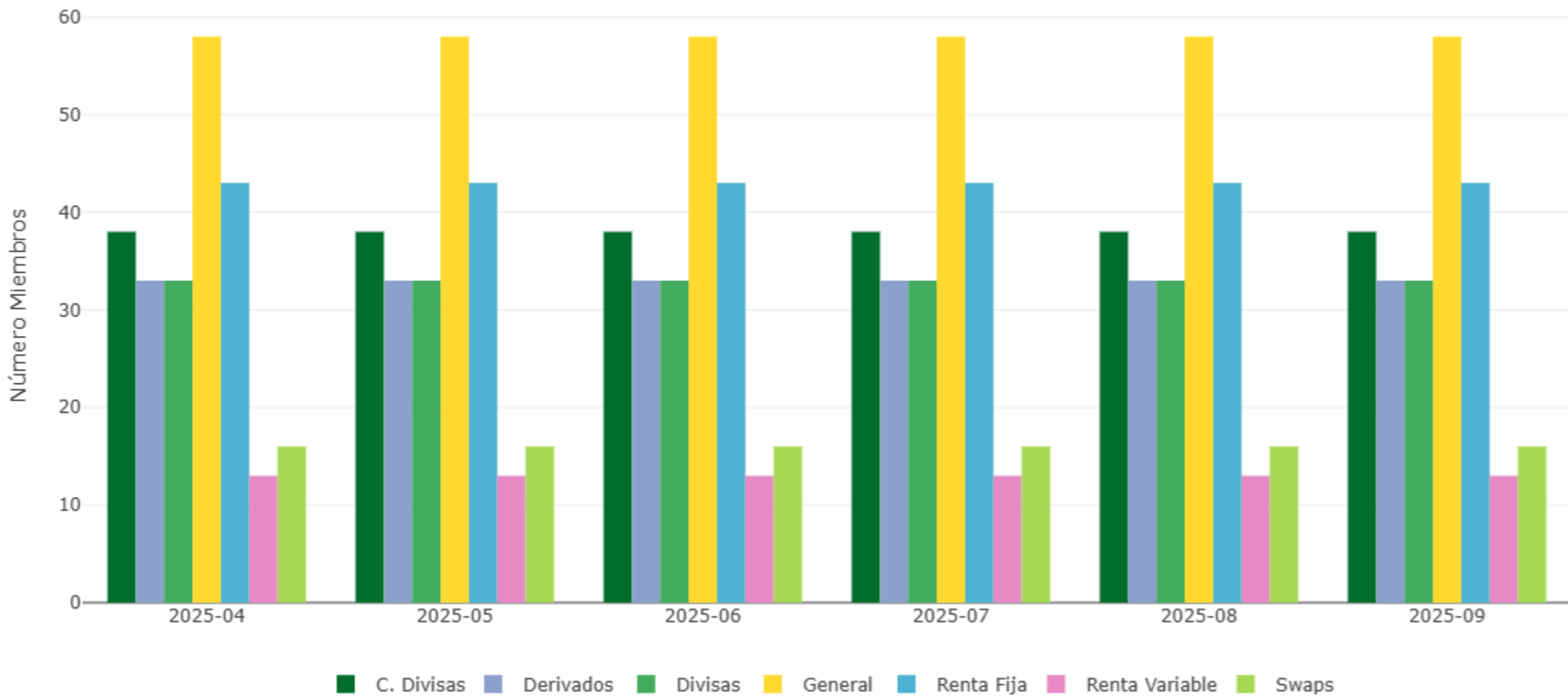




Evolución de Mercado

Septiembre 2025



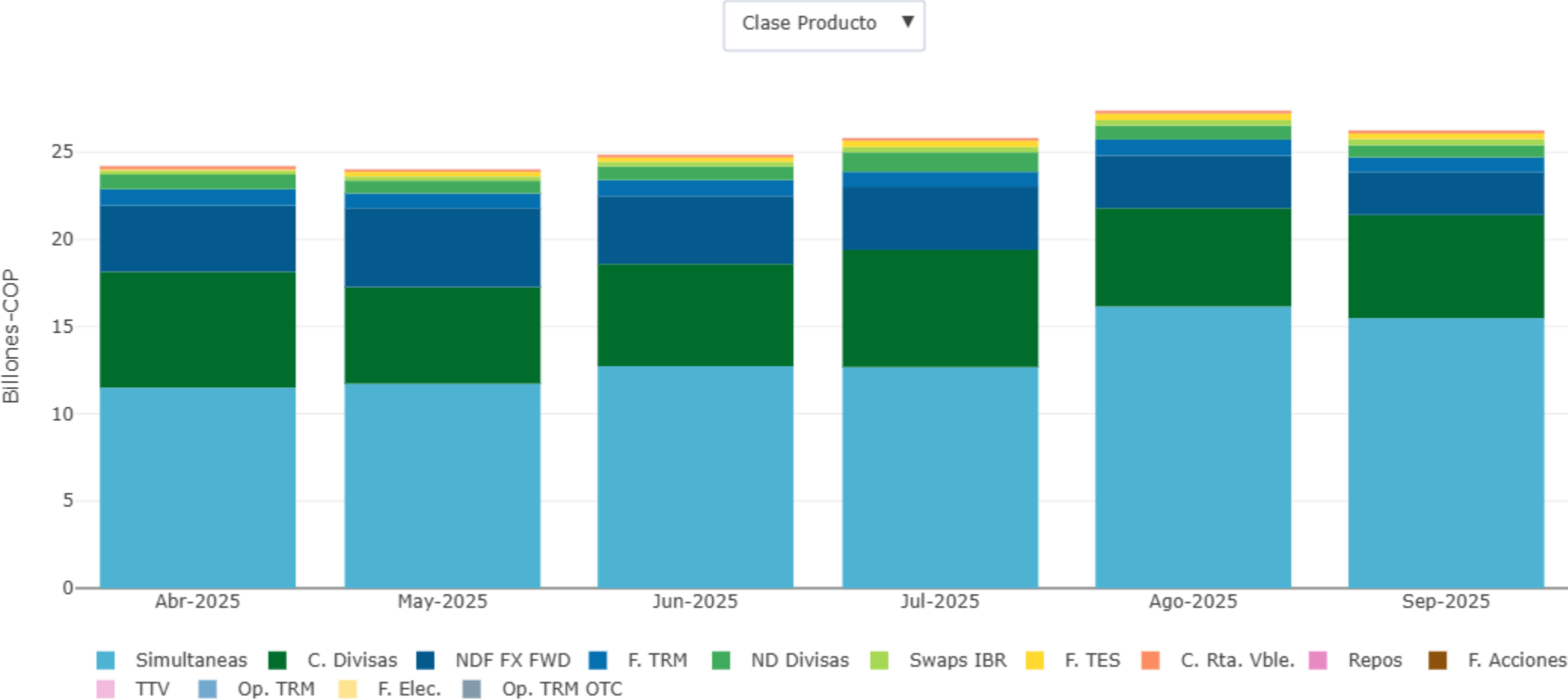
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30

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%	\$25,096,687	\$26,225,236	\$576,955,182	\$25,428,643	\$3,127,723,063
Renta Fija	TES	Simultaneas	52.73%	\$13,233,382	\$15,489,917	\$340,778,176	\$13,370,617	\$1,644,585,849
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	23.95%	\$6,011,233	\$5,894,373	\$129,676,203	\$6,069,233	\$746,515,687
Derivados	TRM	NDF FX FWD	12.76%	\$3,202,220	\$2,464,654	\$54,222,389	\$3,543,339	\$435,830,693
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	6.57%	\$1,649,700	\$349,145	\$7,681,200	\$281,855	\$34,668,150
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	2.23%	\$559,059	\$682,825	\$15,022,144	\$832,350	\$102,379,089
Derivados	TRM	F. TRM	0.80%	\$199,624	\$837,616	\$18,427,547	\$882,651	\$108,566,059
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	0.55%	\$138,034	\$154,925	\$3,408,343	\$146,686	\$18,042,410

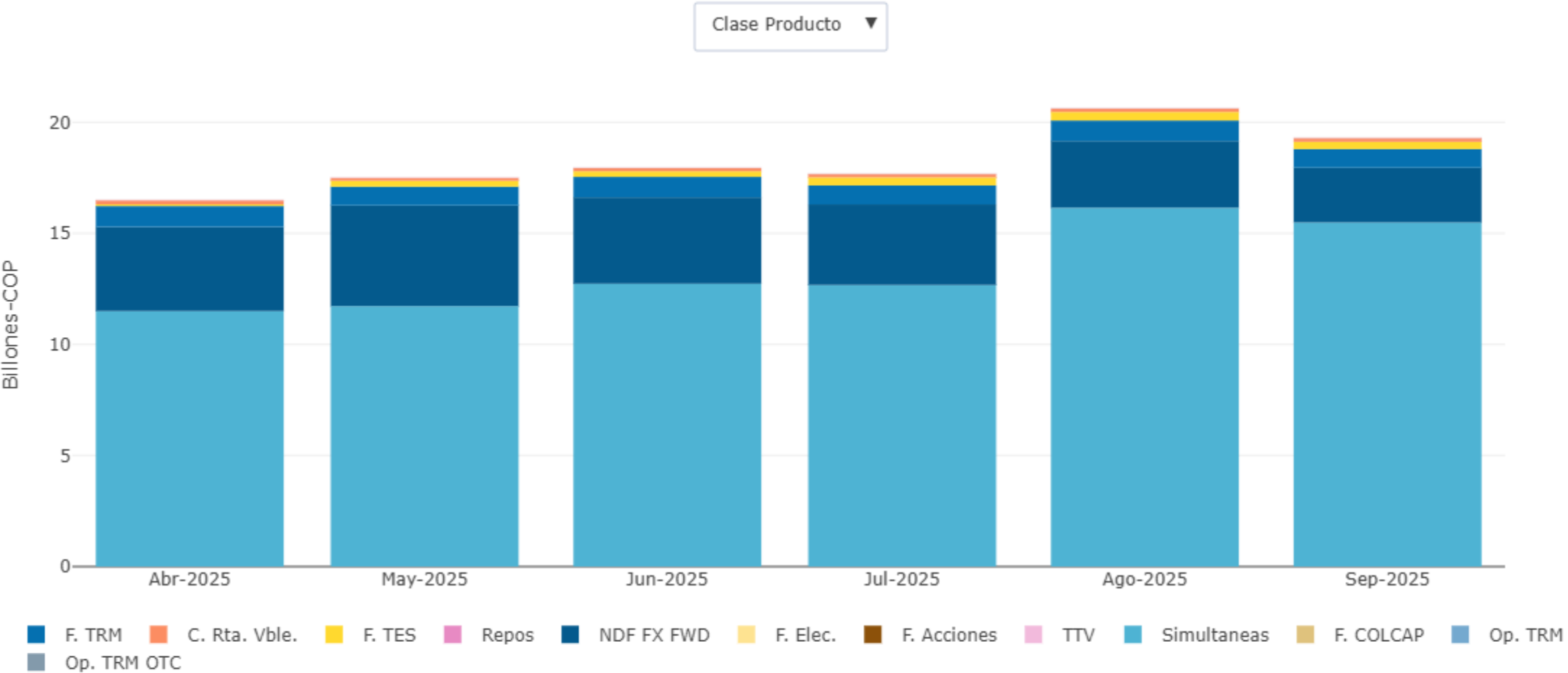
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30

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
Derivados	F. TES	F. TES	0.39%	\$96,637	\$329,877	\$7,257,300	\$282,048	\$34,691,877
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.02%	\$5,731	\$14,128	\$310,818	\$13,764	\$1,693,024
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$486	\$2,421	\$53,264	\$1,831	\$225,254
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	0.00%	\$461	\$3,413	\$75,078	\$2,242	\$275,779
Derivados	F. Elec.	F. Elec.	0.00%	\$119	\$1,003	\$22,068	\$760	\$93,527
Derivados	TRM	Op. TRM	0.00%	\$0	\$109	\$2,392	\$961	\$118,176
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	0.00%	\$0	\$830	\$18,260	\$305	\$37,489

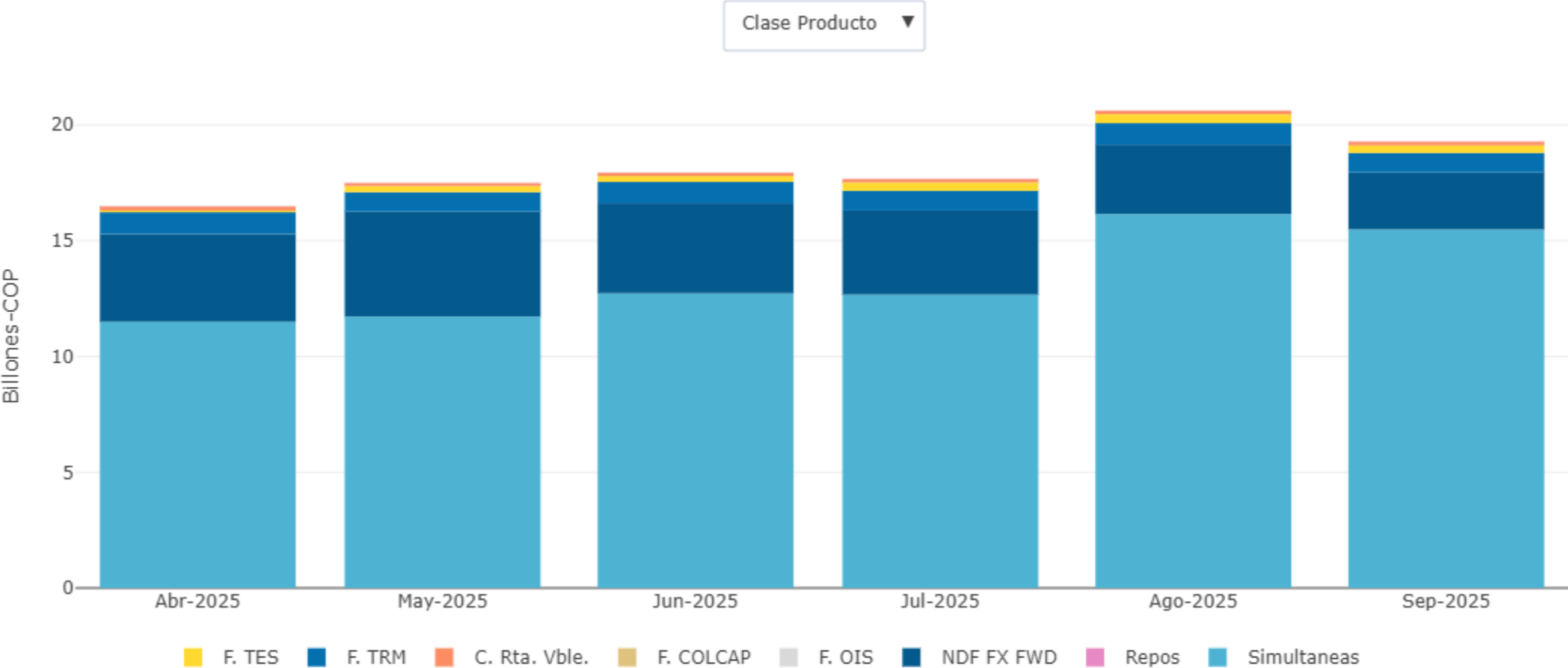
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



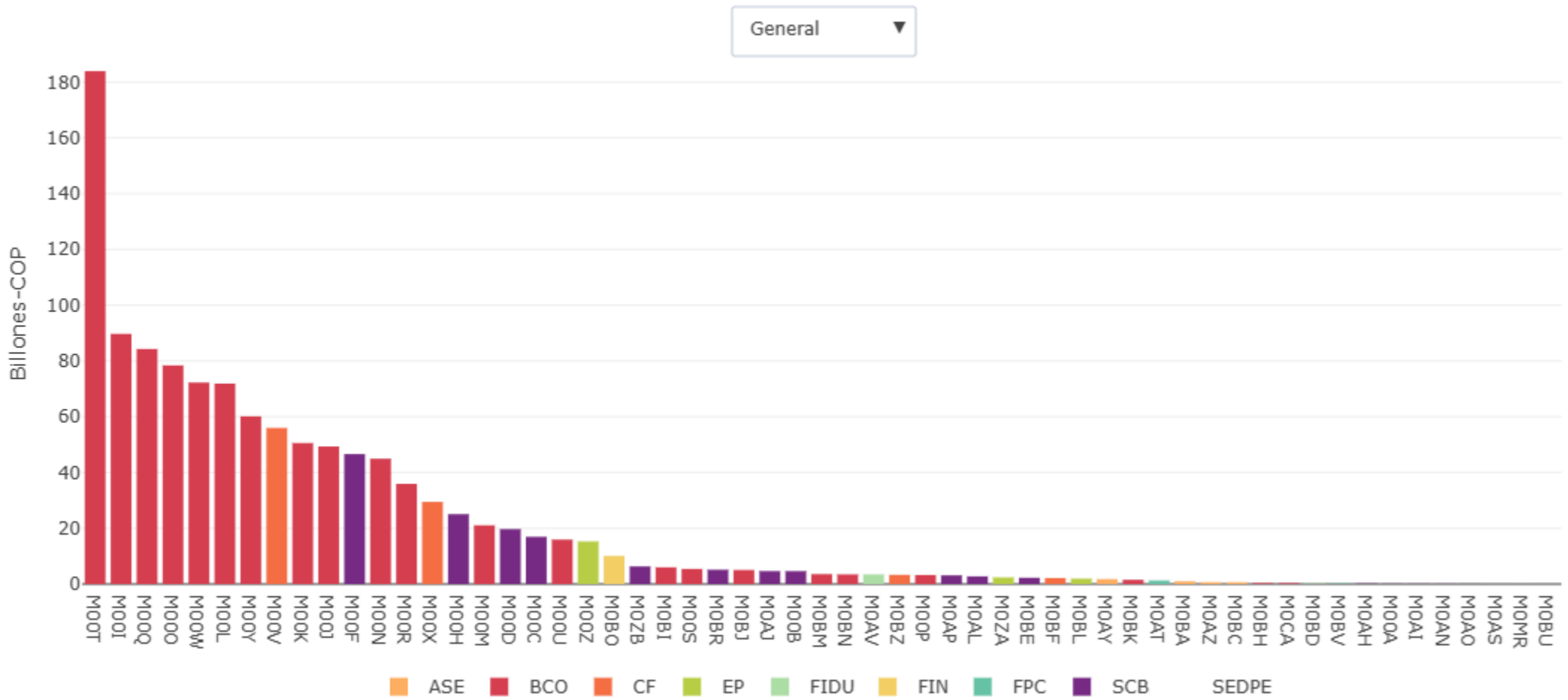
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



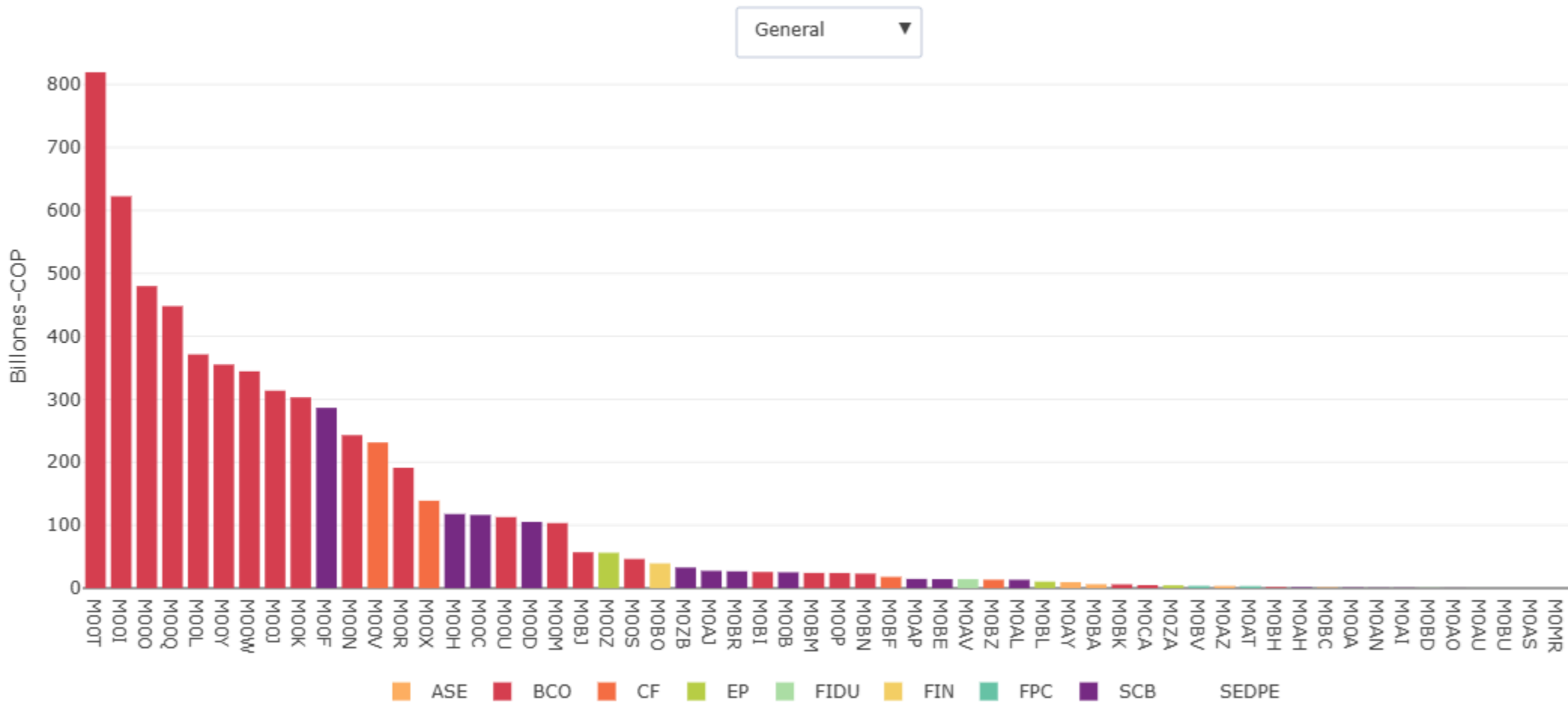
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



*Datos del 2025-09-01 al 2025-09-30



*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30

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	\$166,439,782	\$166,370,433	\$170,086,428	\$170,072,741	\$172,739,384	\$172,736,971
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$78,879,265	\$78,879,265	\$80,743,056	\$80,743,056	\$85,408,200	\$85,408,200
Swaps	Swaps IBR	Swaps IBR	\$42,626,650	\$42,626,650	\$40,639,118	\$40,639,118	\$39,956,999	\$39,956,999
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$20,525,988	\$20,525,988	\$24,045,950	\$24,045,950	\$22,450,219	\$22,450,219
Derivados	TRM	F. TRM	\$15,156,913	\$15,156,913	\$16,429,585	\$16,429,585	\$16,627,433	\$16,627,433
Derivados	F. TES	F. TES	\$7,770,421	\$7,770,421	\$6,710,844	\$6,710,844	\$6,656,713	\$6,656,713
Divisas	ND Divisas	ND Divisas	\$606,478	\$537,129	\$623,764	\$610,076	\$733,455	\$731,007
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$459,957	\$459,957	\$386,919	\$386,919	\$356,732	\$356,732
C. Renta Variable	C. Rta. Vble.	C. Rta. Vble.	\$180,881	\$180,881	\$267,570	\$267,571	\$230,466	\$230,502

Registros del 1 al 9 de un total de 16
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



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	F. Elec.	F. Elec.	\$91,559	\$91,559	\$81,213	\$81,213	\$97,750	\$97,750
Derivados	TRM	Op. TRM	\$51,950	\$51,950	\$58,679	\$58,679	\$41,992	\$41,992
Derivados	OIS	F. OIS	\$38,148	\$38,148	\$38,148	\$38,148	\$44,841	\$44,841
Derivados	F. Rta. Vble.	F. Acciones	\$31,841	\$31,841	\$37,720	\$37,720	\$31,198	\$31,198
Derivados	TRM	Op. TRM OTC	\$18,921	\$18,921	\$17,742	\$17,742	\$8,387	\$8,387
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$811	\$811	\$6,121	\$6,121	\$5,019	\$5,019
Derivados	OIS	OIS IBR	\$0	\$0	\$0	\$0	\$89,982	\$89,982

Registros del 10 al 16 de un total de 16
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30

Reango	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0M-1M	\$1,787,000	\$1,514,818	\$1,469,862
1M-3M	\$1,011,500	\$924,523	\$1,304,256
3M-6M	\$1,168,500	\$979,568	\$1,093,439
6M-9M	\$834,500	\$640,682	\$624,484
9M-1Y	\$997,050	\$919,298	\$708,179
1Y-18M	\$1,237,000	\$1,361,739	\$919,652
18M-2Y	\$485,600	\$668,873	\$961,485
2Y-5Y	\$3,044,350	\$2,941,964	\$1,648,403
5Y-7Y	\$91,500	\$81,455	\$73,638
7Y-10Y	\$57,000	\$48,091	\$64,756

Registros del 1 al 10 de un total de 10
*Datos del 2025-04-01 al 2025-09-30



crc

Cámara de Riesgo Central de Contraparte