Evolución de Mercado

Febrero 2020

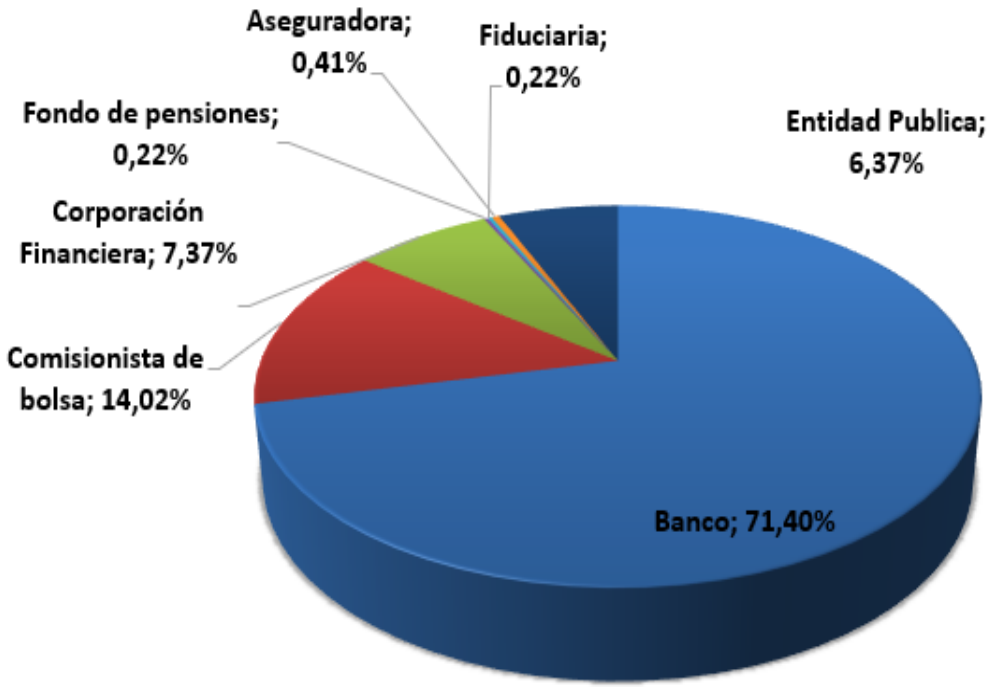
VIGILADO SUPERINTENDENCIA FINANCIERA DE COLOMBIA

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- *Volumen Operado*
  - Ranking: Estandarizados y No Estandarizados año 2020– con Simultáneas y Repos

No	Entidad	Total
1	Bancolombia	10,85%
2	Banco de Bogotá	10,68%
3	BBVA Colombia	9,09%
4	Colpatria	7,57%
5	CrediCorp Capital	7,43%
6	GNB Sudameris	7,20%
7	Ministerio de Hacienda y Credito Publico	6,37%
8	Davivienda	4,87%
9	Citibank	4,78%
10	Banco Agrario	4,15%
11	Corficolombiana	3,58%
12	JPmorgan	3,29%
13	BTG Pactual	2,89%
14	Banco AV Villas	2,70%
15	Banco Itau Corpbanca	2,47%
16	Banco de Occidente	2,41%
17	Bancoldex	2,15%
18	Alianza Valores	2,08%
19	Banco Santander	1,48%
20	Banco Popular	1,00%
21	Acciones y Valores	0,58%

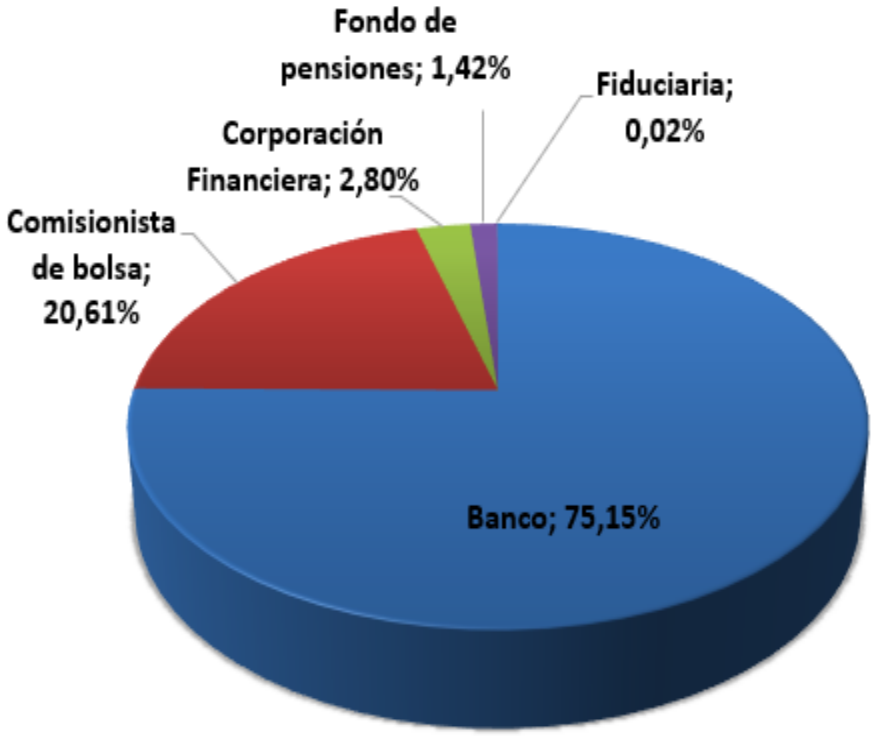


CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- *Volumen Operado*
  - Ranking: Estandarizados y No Estandarizados año 2020- Sin Simultáneas y Repos

No	Entidad	Total
1	BBVA Colombia	13,08%
2	Banco de Bogotá	12,37%
3	Bancolombia	11,64%
4	Banco de Occidente	10,10%
5	Davivienda	7,13%
6	Bancoldex	6,74%
7	CrediCorp Capital	5,76%
8	Alianza Valores	5,47%
9	BTG Pactual	5,23%
10	Banco Santander	4,07%
11	Banco Itau Corpbanca	3,20%
12	Colpatria	2,89%
13	Corficolombiana	1,75%
14	Acciones y Valores	1,61%
15	Protección	1,42%
16	Citibank	1,39%
17	Corredores Davivienda	1,20%
18	JPmorgan	1,05%
19	Banco Popular	1,04%
20	Banco Agrario	0,76%
21	GNB Sudameris	0,74%
22	Valores Bancolombia	0,72%
23	UltraSerfinco	0,43%
24	Casa de Bolsa	0,12%
25	Itau Comisionista de Bolsa	0,08%
26	FiduBancolombia	0,02%

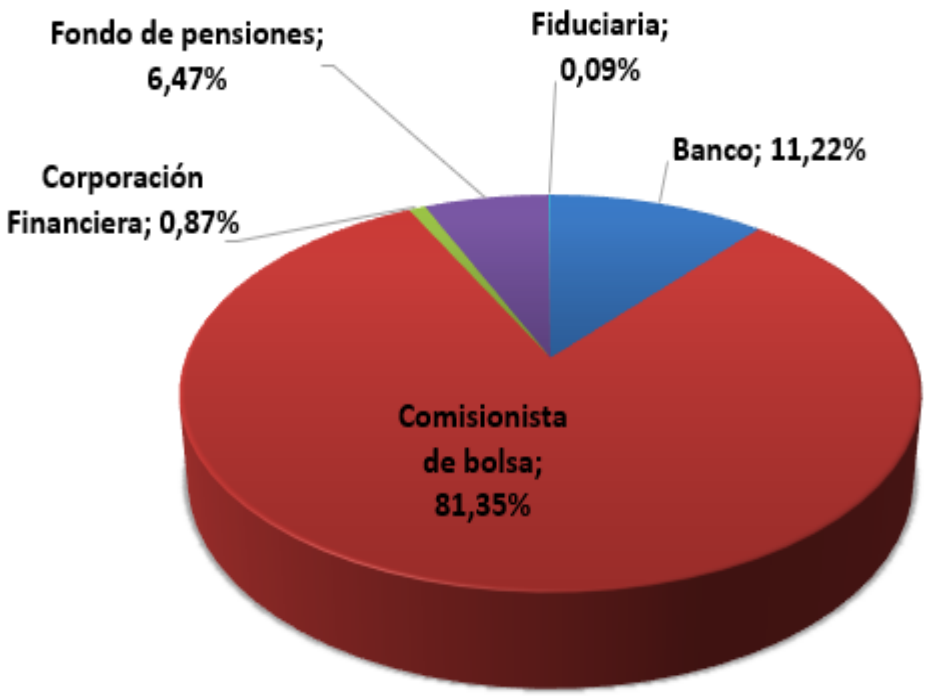


CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- *Volumen Operado*
  - Ranking: Estandarizados año 2020

No	Entidad	Total
1	Alianza Valores	22,26%
2	CrediCorp Capital	22,08%
3	BTG Pactual	18,13%
4	Acciones y Valores	7,27%
5	Protección	6,47%
6	Corredores Davivienda	5,48%
7	Davivienda	4,33%
8	Valores Bancolombia	3,26%
9	Bancolombia	3,12%
10	UltraSerfinco	1,95%
11	Citibank	1,63%
12	BBVA Colombia	0,87%
13	JPmorgan	0,84%
14	Banco de Bogotá	0,77%
15	Casa de Bolsa	0,55%
16	Itau Comisionista de Bolsa	0,38%
17	Banco Itau Corpbanca	0,27%
18	Banco Agrario	0,17%
19	FiduBancolombia	0,09%
20	Banco de Occidente	0,06%
21	Corficolombiana	0,03%

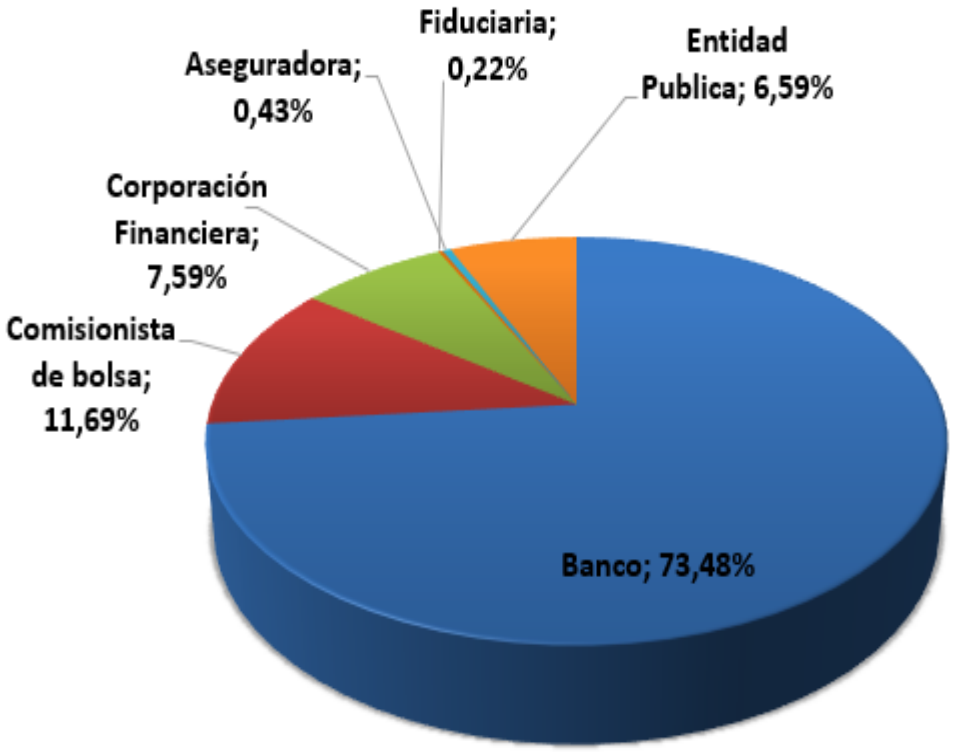


CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- *Volumen Operado*
  - Ranking: No Estandarizados año 2020– Con Simultáneas y Repos

No	Entidad	Total
1	Bancolombia	11,12%
2	Banco de Bogotá	11,03%
3	BBVA Colombia	9,37%
4	Colpatria	7,83%
5	GNB Sudameris	7,45%
6	CrediCorp Capital	6,92%
7	Ministerio de Hacienda y Credito Publico	6,59%
8	Davivienda	4,89%
9	Citibank	4,89%
10	Banco Agrario	4,29%
11	Corficolombiana	3,70%
12	JPmorgan	3,38%
13	Banco AV Villas	2,79%
14	Banco Itau Corpbanca	2,54%
15	Banco de Occidente	2,50%
16	BTG Pactual	2,36%
17	Bancoldex	2,22%
18	Banco Santander	1,53%
19	Alianza Valores	1,39%
20	Banco Popular	1,03%
21	BNP Paribas Corp Financiera	0,51%

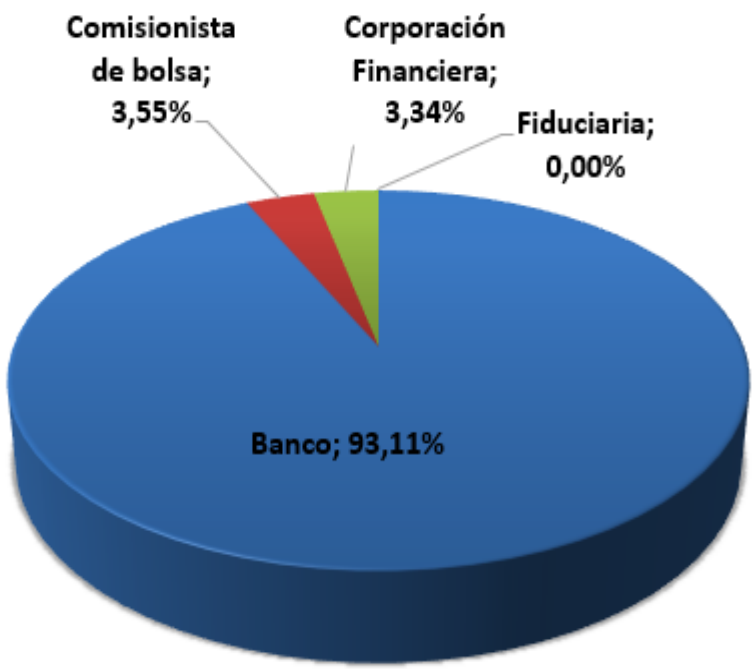


CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- *Volumen Operado*
  - Ranking: No Estandarizados año 2020 – Sin Simultáneas y Repos

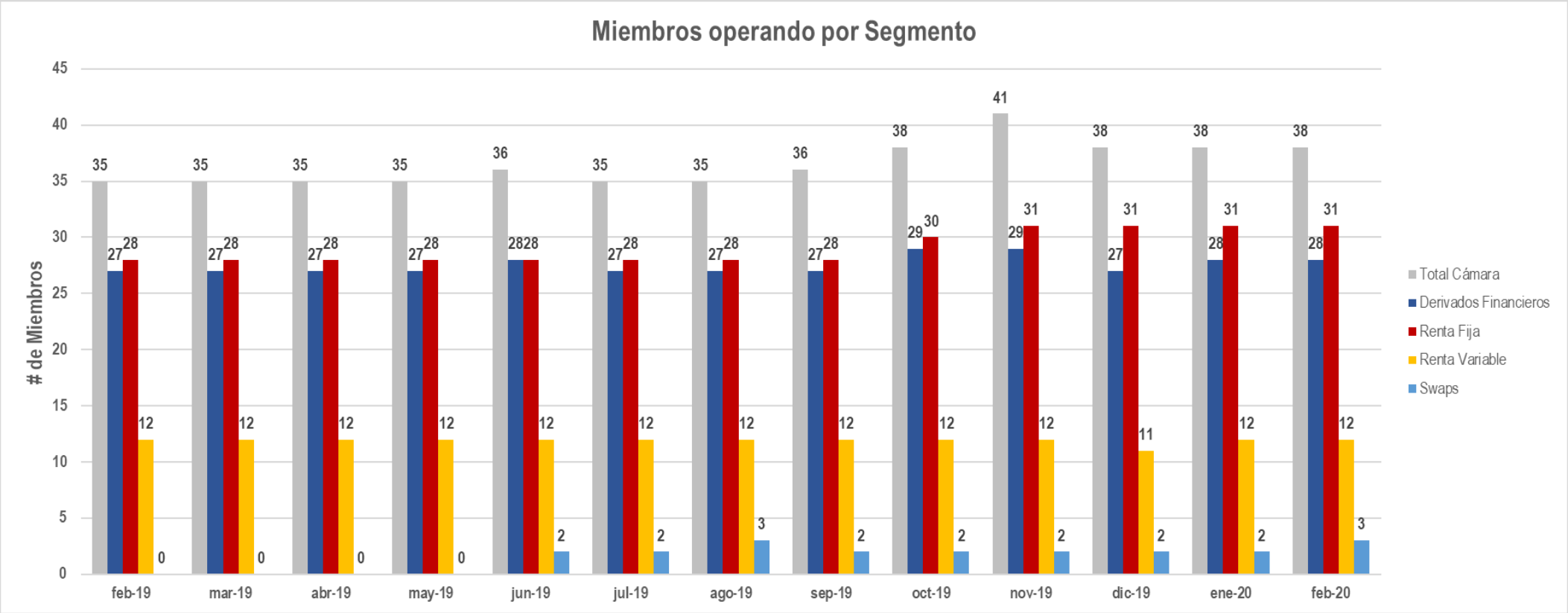
No	Entidad	Total
1	BBVA Colombia	16,51%
2	Banco de Bogotá	15,63%
3	Bancolombia	14,03%
4	Banco de Occidente	12,92%
5	Bancoldex	8,64%
6	Davivienda	7,92%
7	Banco Santander	5,21%
8	Banco Itau Corpbanca	4,03%
9	Colpatria	3,70%
10	Corficolombiana	2,24%
11	BTG Pactual	1,61%
12	Banco Popular	1,33%
13	Citibank	1,32%
14	CrediCorp Capital	1,17%
15	JPmorgan	1,10%
16	GNB Sudameris	0,94%
17	Banco Agrario	0,93%
18	Alianza Valores	0,75%
19	Acciones y Valores	0,02%



CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

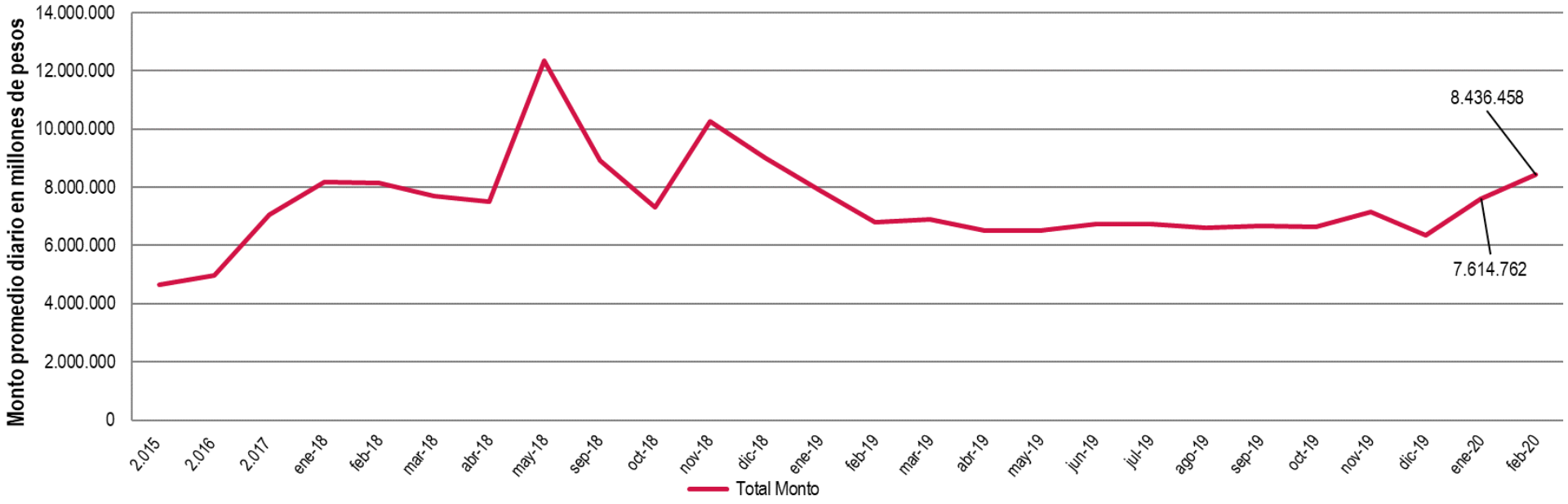
- ***Gestión de Operaciones***
  - **Evolución Número de Miembros**



CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Gestión de Operaciones***
  - **Evolución de Operaciones de Mercado y de Registro**

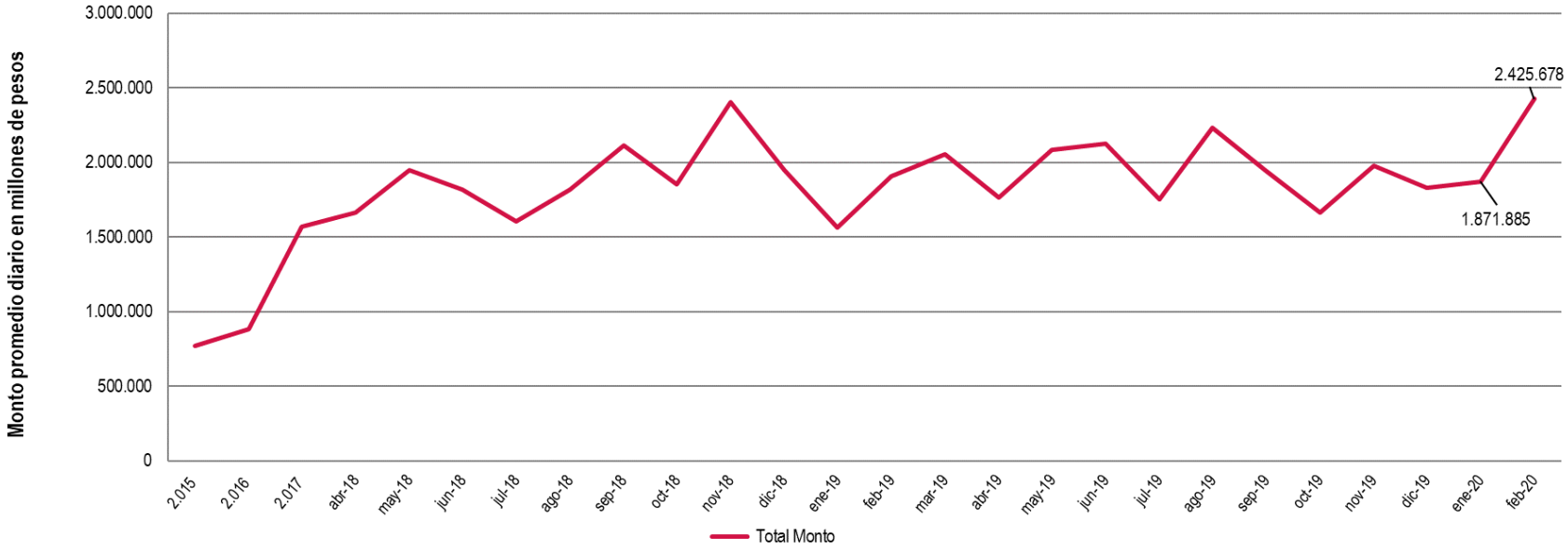


% Crecimiento Anual Respecto a febrero - 19
23,84%

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Gestión de Operaciones - Derivados***
  - **Evolución de Operaciones de Mercado y de Registro**



% Crecimiento Anual Respecto a febrero - 19
27,35%

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

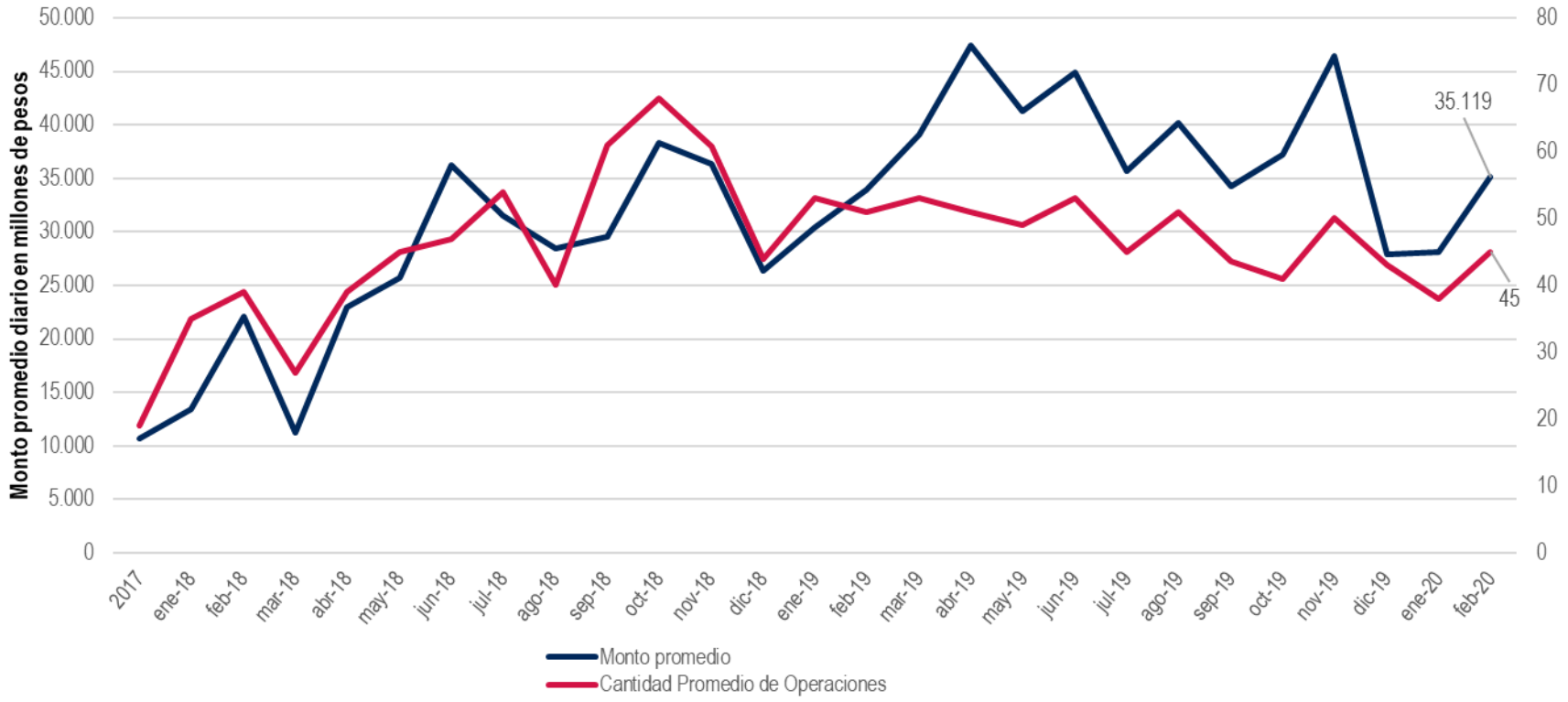
Informe de la Administración

- ***Gestión de Operaciones***
  - Operaciones Simultáneas SEN y MEC

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Gestión de Operaciones***
  - Operaciones Repo



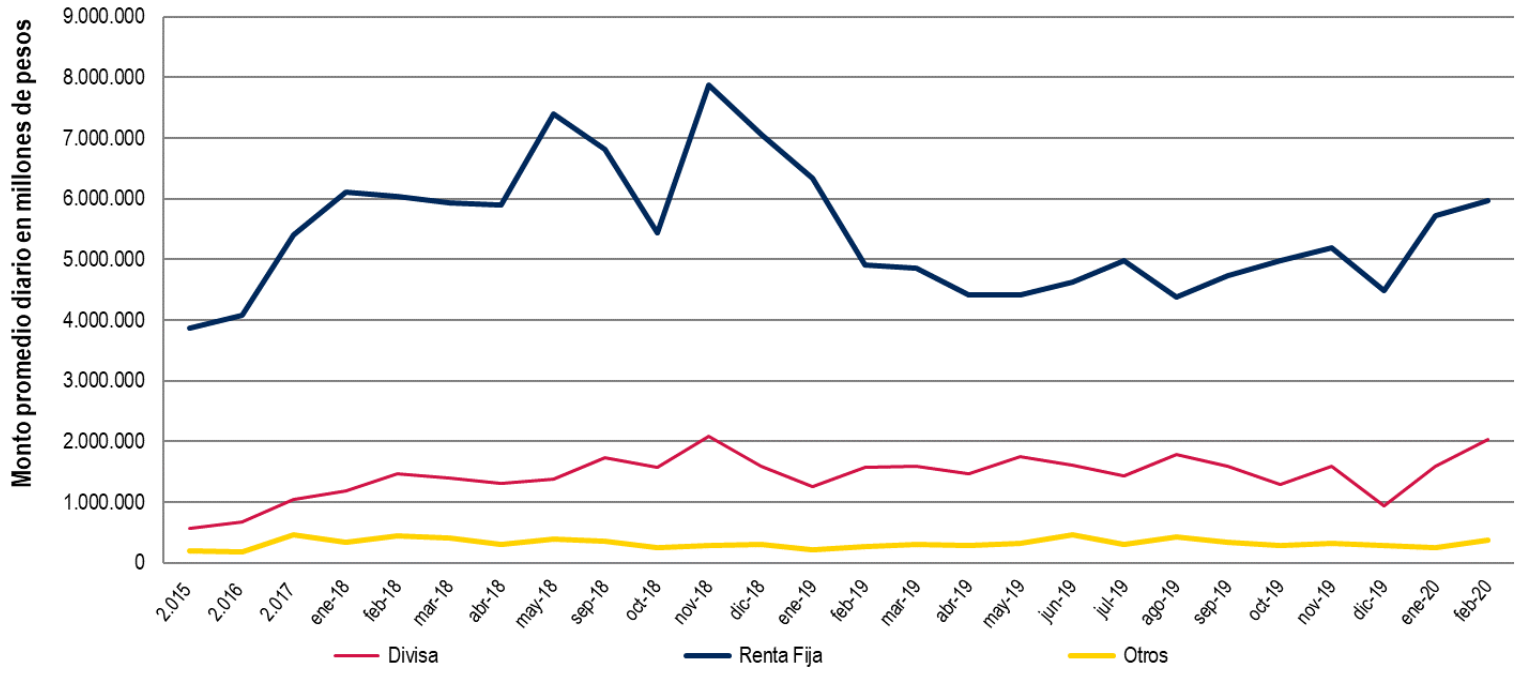
Participación de 12 SCB

Total de operaciones repo
Ene - 20: 802

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Gestión operaciones***
  - Evolución productos

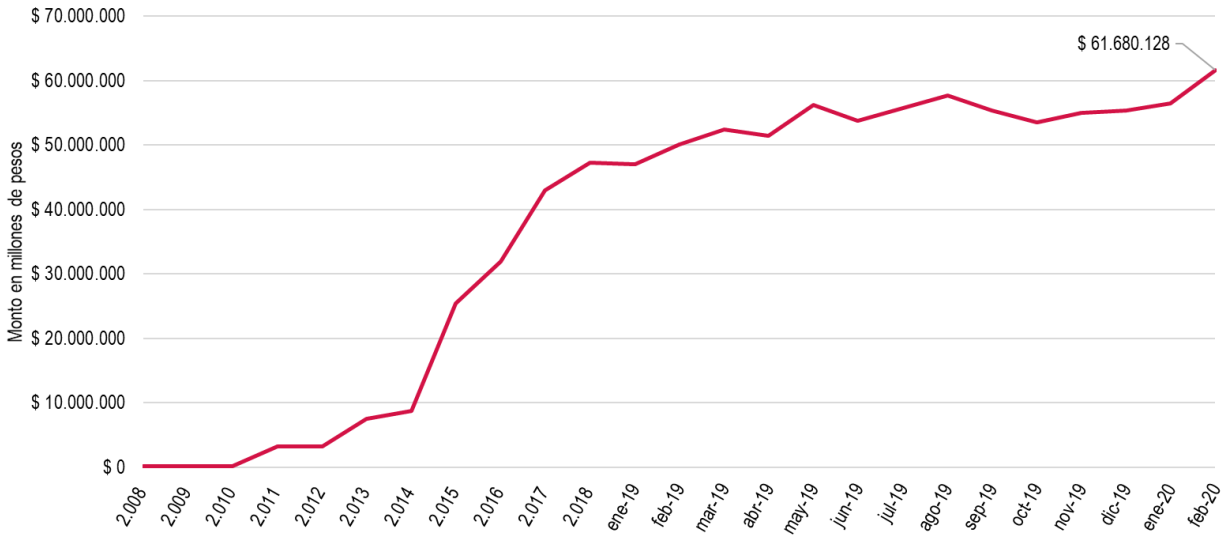


Producto	% Crecimiento Anual respecto a febrero - 19
Divisa	28,15%
Renta Fija	21,76%
Otros: Futuros Renta Fija, Futuros Renta Variable, Electricidad, OIS IBR, Futuro de OIS y Renta Variable	44,33%

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Posición Abierta***
  - Evolución Posición abierta



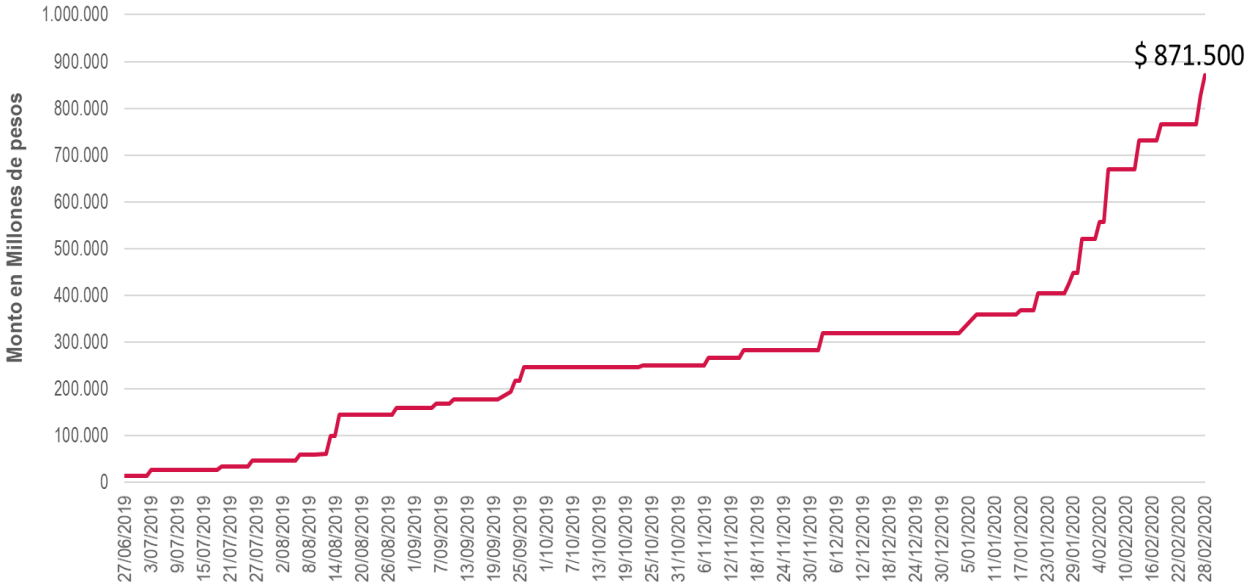
% Crecimiento anual respecto a marzo - 19
17,8%

Segmento	Producto	Posición Abierta Valorada	% Participación	Valor garantías exígidas por fluctuación	% Participación Garantías exígidas	(B / A*2)
Derivados financieros	Forward NDF (USD/COP)	28.085.519	45,53%	760.281	56,79%	1,32%
	Futuro y Mini Futuro de Tasa de Cambio Dólar/Peso	554.814	0,90%			
	Opción sobre la TRM	72.573	0,12%			
	Subtotal Activos sobre TRM	**28.712.906**	**46,55%**	**760.281**	**56,79%**	**1,32%**
	OIS IBR	10.031.123	16,26%	16.358	1,22%	0,08%
	OIS IBR FORMACIÓN	4.722.547	7,66%	4.305	0,32%	0,05%
	Futuro OIS	1.445.081	2,34%	1.152	0,09%	0,04%
	Subtotal Activos sobre Overnight Index Swap	**16.198.750**	**26,26%**	**21.814**	**1,63%**	**0,07%**
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por diferencias	59.280	0,10%	13.797	1,03%	11,64%
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por Entrega	47.953	0,08%	14.671	1,10%	15,30%
	Futuros y Mini Futro del Índice Accionario COLCAP	20.342	0,03%	2.602	0,19%	6,40%
	Subtotal Activos sobre Acciones	**127.575**	**0,21%**	**31.070**	**2,32%**	**12,18%**
	Futuros sobre Títulos TES de Referencias Específicas	2.261.019	3,67%	70.272	5,25%	1,55%
	Futuro y Mini Futuro sobre Electricidad Mensual	11.035	0,02%	4.258	0,32%	19,29%
	Total Derivados	**47.311.284**	**76,70%**	**887.696**	**66,31%**	**0,94%**
Renta Variable	Repos	754.142	1,22%	91.277	6,82%	6,05%
	TTV´s	0	0,00%	0	0,00%	0,00%
	Total Renta Variable	**754.142**	**1,22%**	**91.277**	**6,82%**	**6,05%**
Swaps	IRS	0	0,00%	0	0,00%	0,00%
	OIS	871.500	1,41%	691	0,05%	0,04%
	Total Swaps	**871.500**	**1,41%**	**691**	**0,05%**	**0,04%**
Renta Fija	**Simultáneas**	**12.743.202**	**20,66%**	**359.095**	**26,82%**	**1,41%**
Total		**61.680.128**	**100%**	**1.338.758**	**100%**	**1,09%**

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Posición Abierta Swaps***
  - Evolución Posición abierta



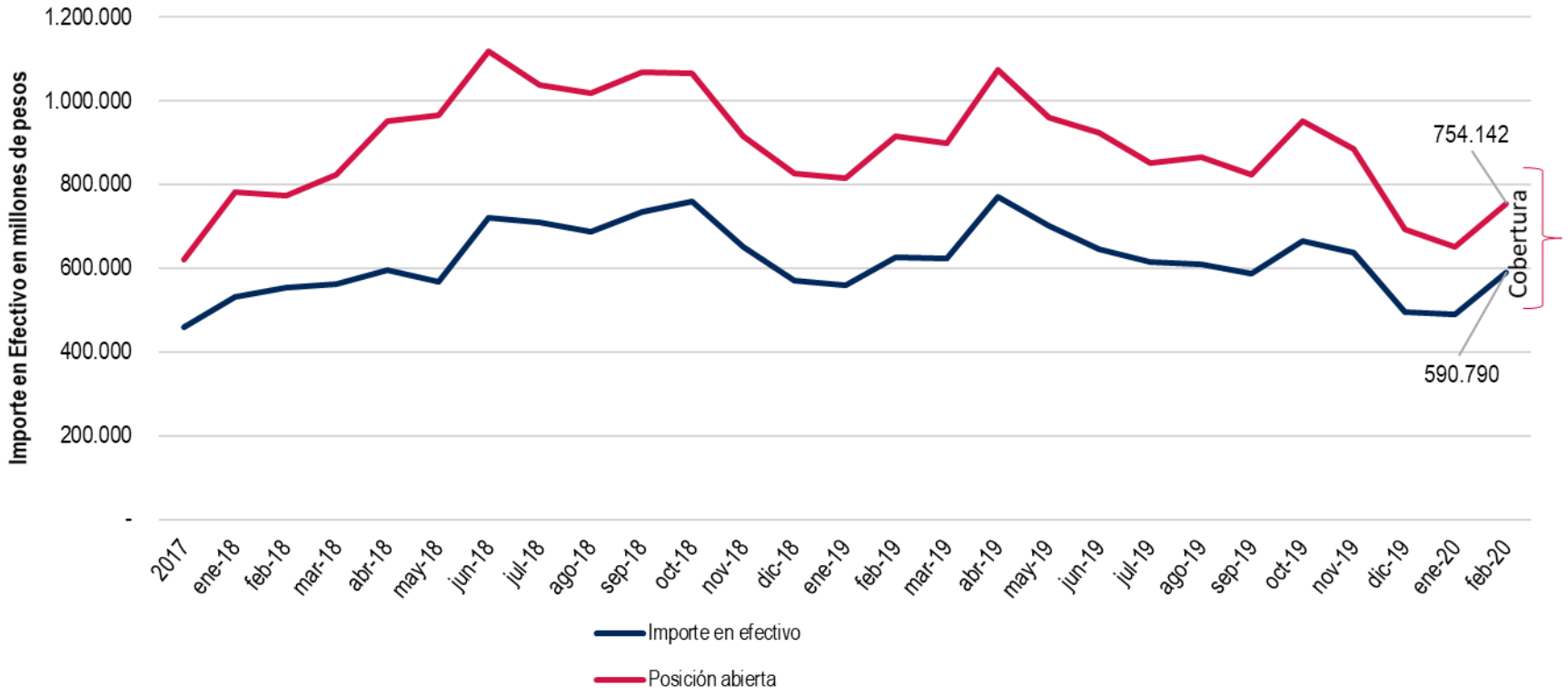
Plazo al Vencimiento	Volumen Febrero	Posición Abierta	Garantía Exigida
0 - 1 Año	-	1.000	1.826
1 - 2 Años	252.000	402.000	
2 - 5 Años	90.000	326.000	
5 - 10 Años	9.000	142.500	
10 - 15 Años	-	-	
Total	**351.000**	**871.500**	

*Valor en Millones COP

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Informe de la Administración

- ***Posición Abierta***
  - Evolución Posición Abierta vs Importe en efectivo - Repos



CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA
POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE
WWW.CAMARADERIESGO.COM