



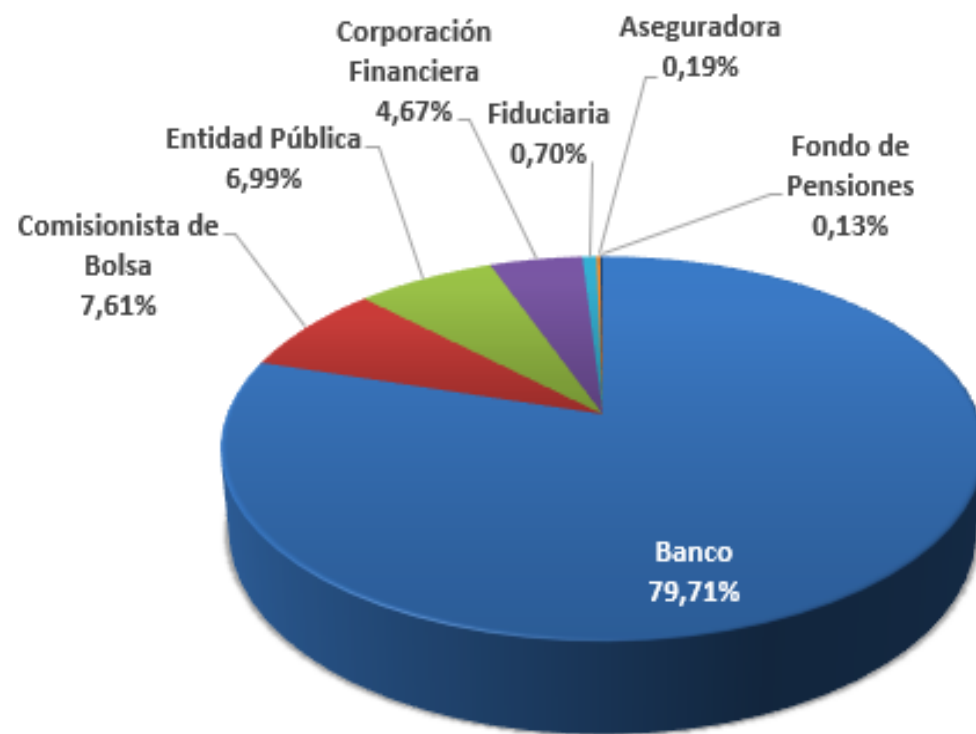
Evolución de Mercado

Octubre 2020

Informe de la Administración

- **Volumen Operado**
 - Ranking: Estandarizados y No Estandarizados octubre 2020– (Con Simultáneas, Repos, Contado y TTV's)

No	Entidad	Total
1	Banco GNB Sudameris	16,83%
2	Banco Agrario	15,36%
3	Banco BBVA	9,45%
4	Bancolombia	7,64%
5	Ministerio de Hacienda y Crédito Público	6,99%
6	Banco Scotiabank Colpatría	5,89%
7	Banco Av Villas	4,43%
8	Jpmorgan	4,23%
9	Banco Davivienda	3,41%
10	Banco de Bogotá	2,95%
11	Citibank	2,90%
12	Banco Santander	2,81%
13	Credicorp Capital	2,44%
14	Banco de Occidente	2,01%
15	Alianza Valores	1,95%
16	Banco Itaú CorpBanca	1,91%
17	Banco Popular	1,62%
18	Bancoldex	1,51%
19	BTG Pactual	1,09%
20	Corredores Davivienda	0,80%

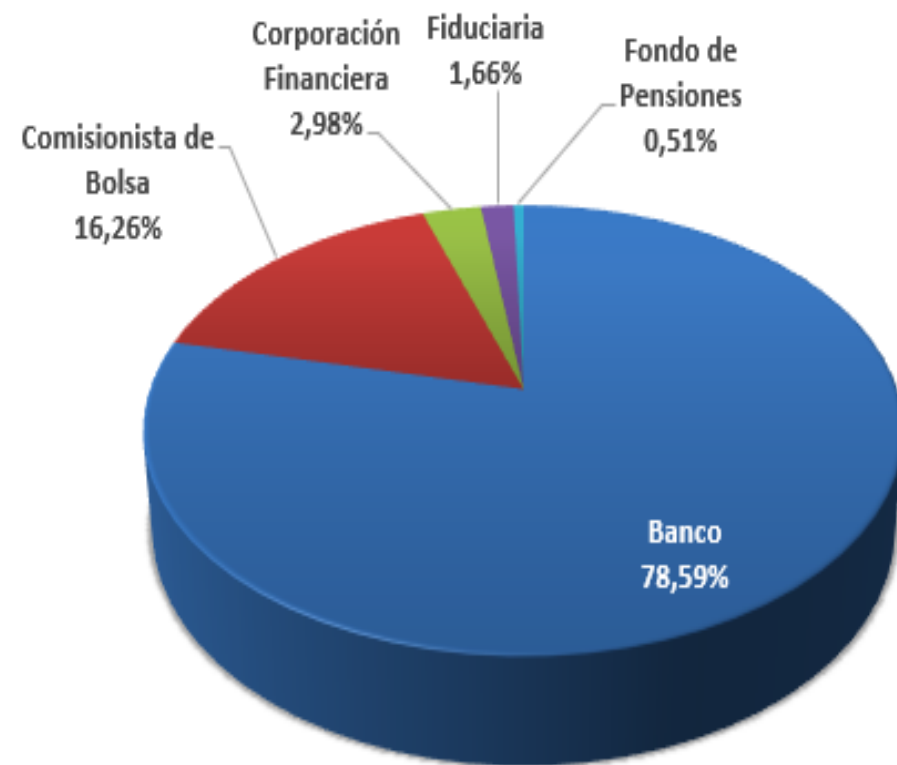


Informe de la Administración

- **Volumen Operado**

– Ranking: Estandarizados y No Estandarizados octubre 2020- (Sin Simultáneas, Repos, Contado y TTV`s)

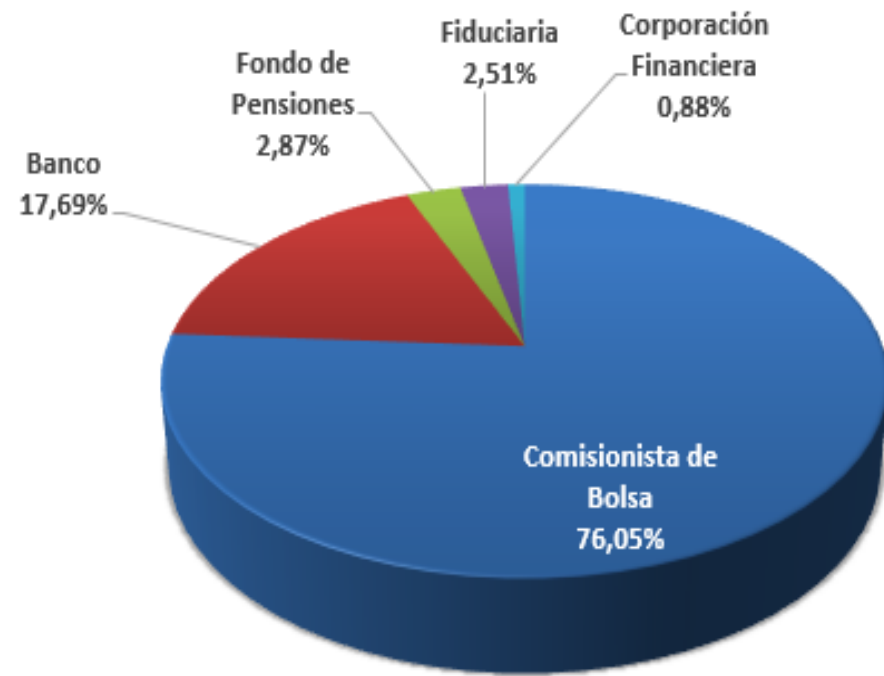
No	Entidad	Total
1	Bancolombia	16,17%
2	Banco BBVA	15,18%
3	Banco Davivienda	8,25%
4	Banco de Bogotá	7,97%
5	Alianza Valores	7,32%
6	Banco de Occidente	6,26%
7	Banco Scotiabank Colpatría	5,05%
8	Banco Santander	4,72%
9	Bancoldex	3,97%
10	Credicorp Capital	3,41%
11	Banco de la República	3,13%
12	Jpmorgan	2,83%
13	Banco Itaú CorpBanca	2,76%
14	BTG Pactual	2,59%
15	Banco Popular	2,14%
16	Banco GNB Sudameris	1,97%
17	Corficolombiana	1,63%
18	Valores Bancolombia	1,00%
19	Corredores Davivienda	0,98%
20	Acciones y Valores	0,82%
21	Banco Agrario	0,52%
22	Protección	0,51%
23	Citibank	0,36%



Informe de la Administración

- **Volumen Operado**
 - Ranking: Estandarizados octubre 2020

No	Entidad	Total
1	Alianza Valores	31,95%
2	Credicorp Capital	14,05%
3	BTG Pactual	13,71%
4	Banco Itaú CorpBanca	5,90%
5	Valores Bancolombia	5,63%
6	Corredores Davivienda	5,50%
7	Banco Davivienda	5,49%
8	Acciones y Valores	4,45%
9	Protección	2,87%
10	Bancolombia	2,75%
11	Corficolombiana	2,39%
12	Banco BBVA	2,28%
13	Fiduciaria Bogotá	0,84%
14	Itau Comisionista Bolsa	0,68%
15	Banco Agrario	0,64%
16	Banco de Bogotá	0,31%
17	Banco Scotiabank Colpatria	0,28%
18	Fiduciaria Bancolombia	0,12%
19	Casa de Bolsa	0,07%

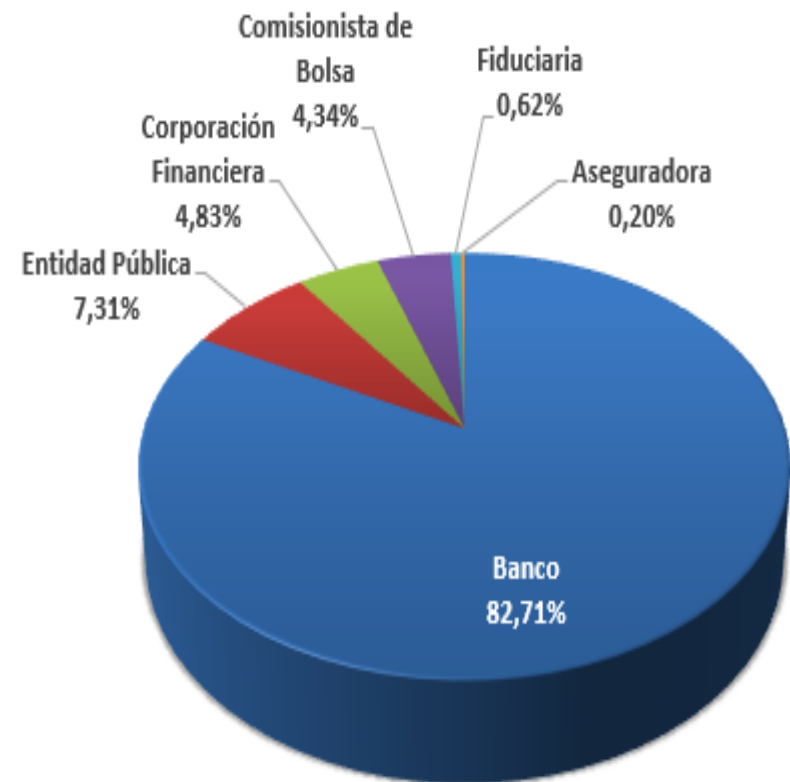


Informe de la Administración

- **Volumen Operado**

- Ranking: No Estandarizados octubre 2020 – (Con Simultáneas, Repos, Contado y TTV`s)

No	Entidad	Total
1	Banco GNB Sudameris	17,59%
2	Banco Agrario	16,03%
3	Banco BBVA	9,84%
4	Bancolombia	7,93%
5	Ministerio de Hacienda y Crédito Público	7,31%
6	Banco Scotiabank Colpatría	6,15%
7	Banco Avvillas	4,63%
8	Jpmorgan	4,42%
9	Banco Davivienda	3,40%
10	Banco de Bogotá	3,07%
11	Citibank	3,03%
12	Banco Santander	2,94%
13	Banco de Occidente	2,10%
14	Credicorp Capital	1,88%
15	Banco Itaú CorpBanca	1,72%
16	Banco Popular	1,70%
17	Bancoldex	1,58%
18	Banco de la República	0,84%
19	Corficolombiana	0,62%
20	Corredores Davivienda	0,57%

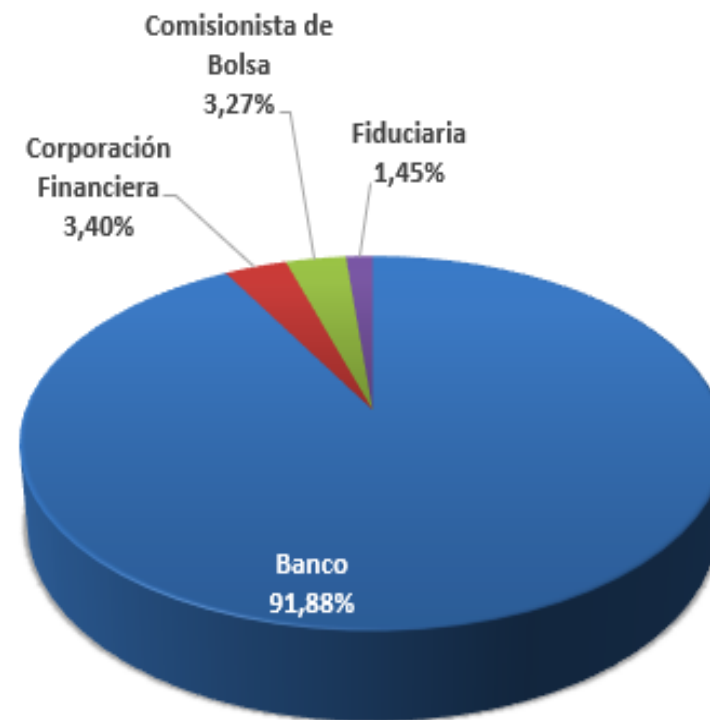


Informe de la Administración

- **Volumen Operado**

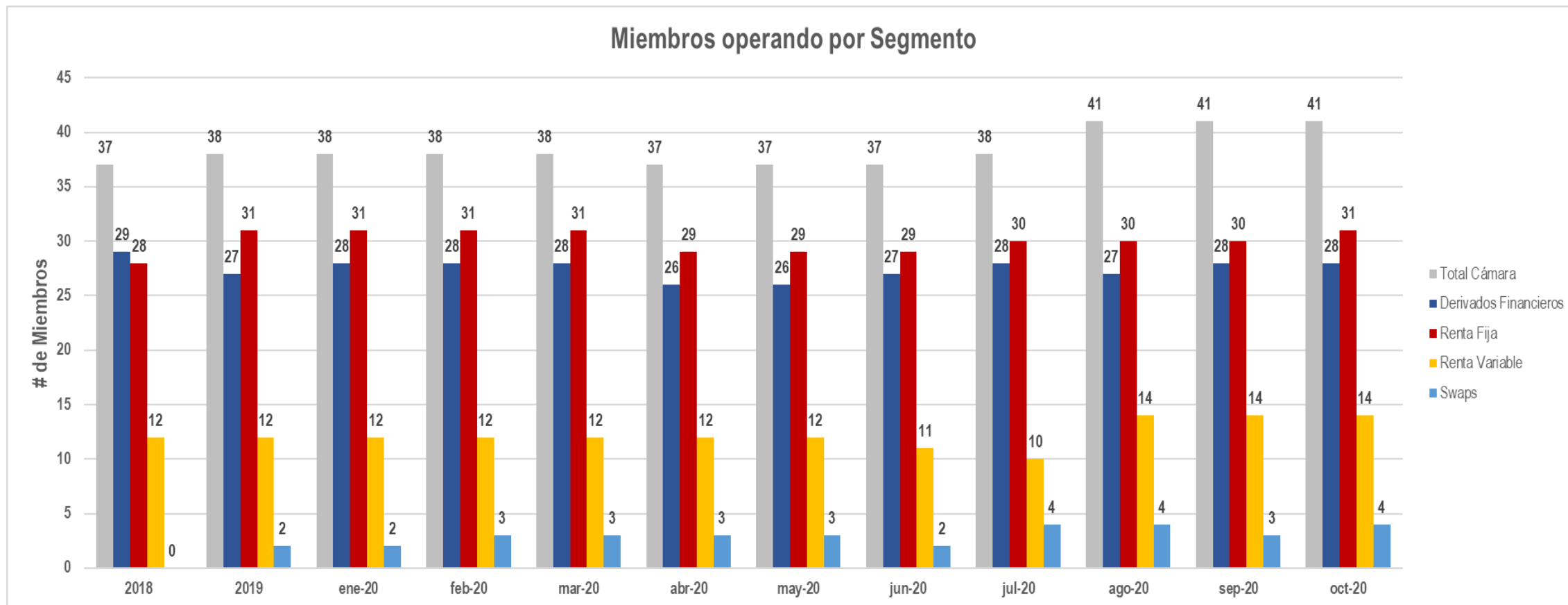
– Ranking: No Estandarizados octubre 2020 – (Sin Simultáneas, Repos, Contado y TTV`s)

No	Entidad	Total
1	Bancolombia	19,19%
2	Banco BBVA	18,09%
3	Banco de Bogotá	9,52%
4	Banco Davivienda	9,18%
5	Banco de Occidente	7,52%
6	Banco Scotiabank Colpatría	6,07%
7	Banco Santander	5,68%
8	Bancoldex	4,78%
9	Banco de la República	3,76%
10	Jpmorgan	3,40%
11	Banco Popular	2,57%
12	Banco GNB Sudameris	2,37%
13	Banco Itaú CorpBanca	2,05%
14	Alianza Valores	1,97%
15	Corficolombiana	1,45%
16	Credicorp Capital	1,09%
17	Banco Agrario	0,49%
18	Citibank	0,42%
19	BTG Pactual	0,18%
20	FDN	0,18%



Informe de la Administración

- *Gestión de Operaciones*
 - Evolución Número de Miembros

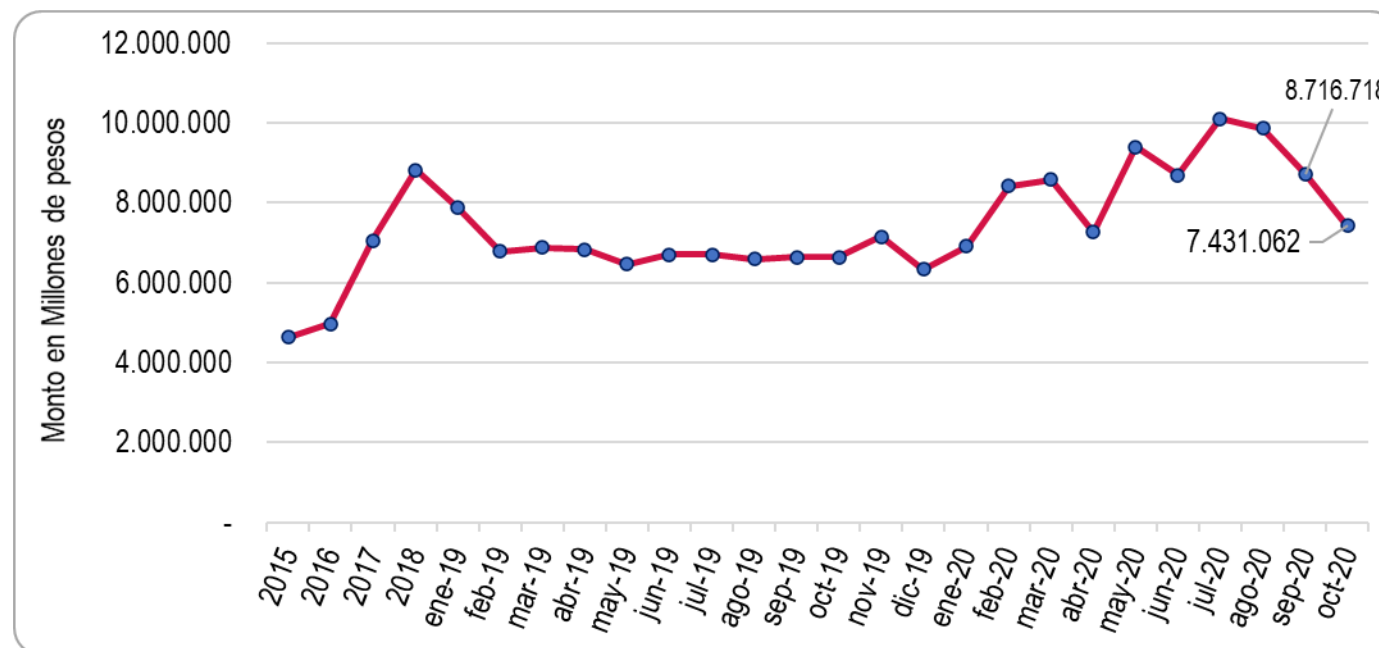
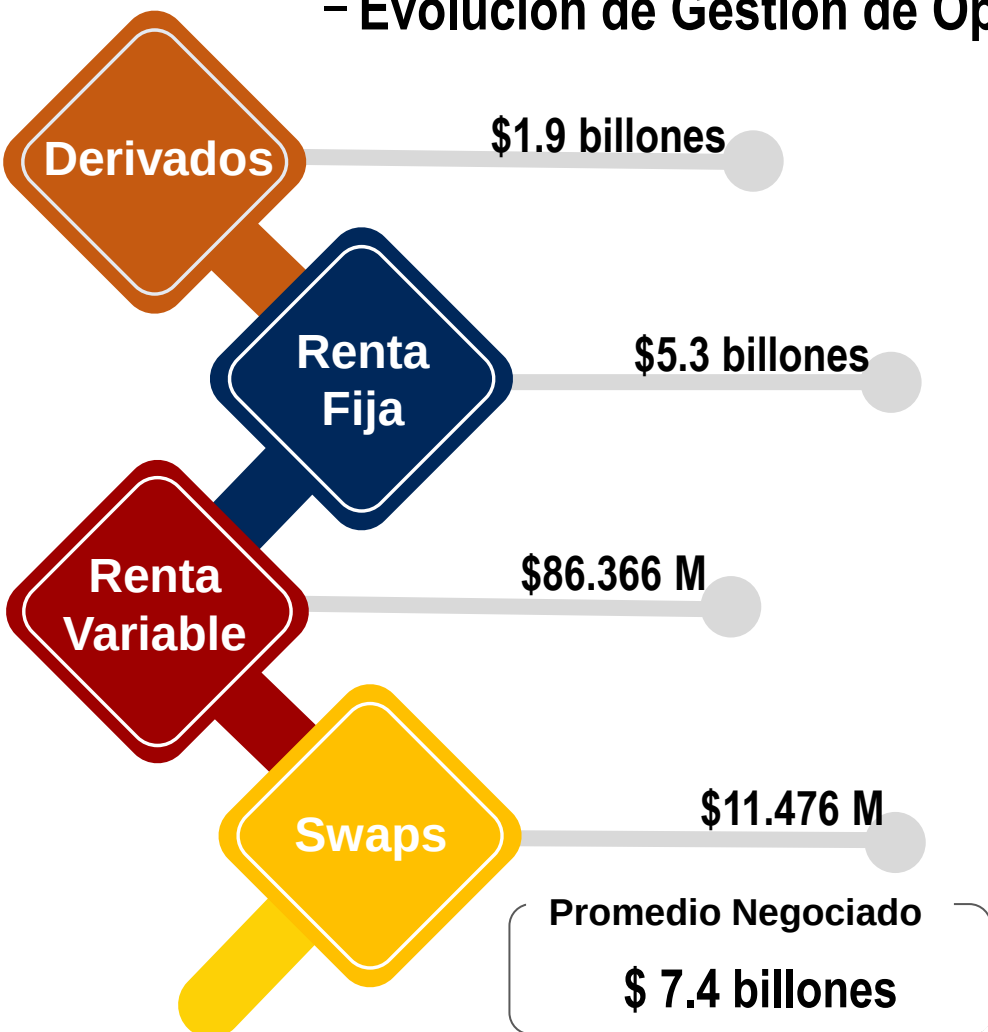


Hasta el 30 de Octubre de 2020

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones



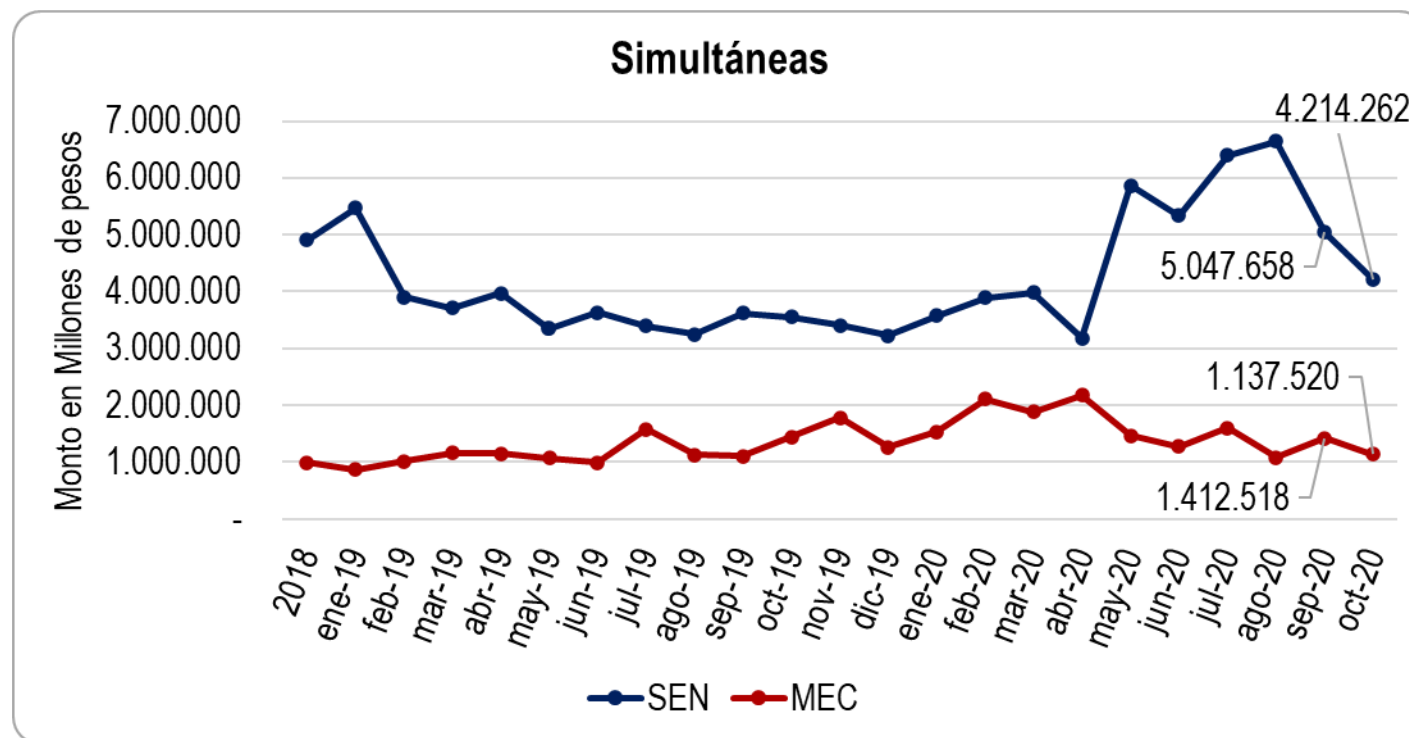
% Crecimiento Anual: 12%



Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

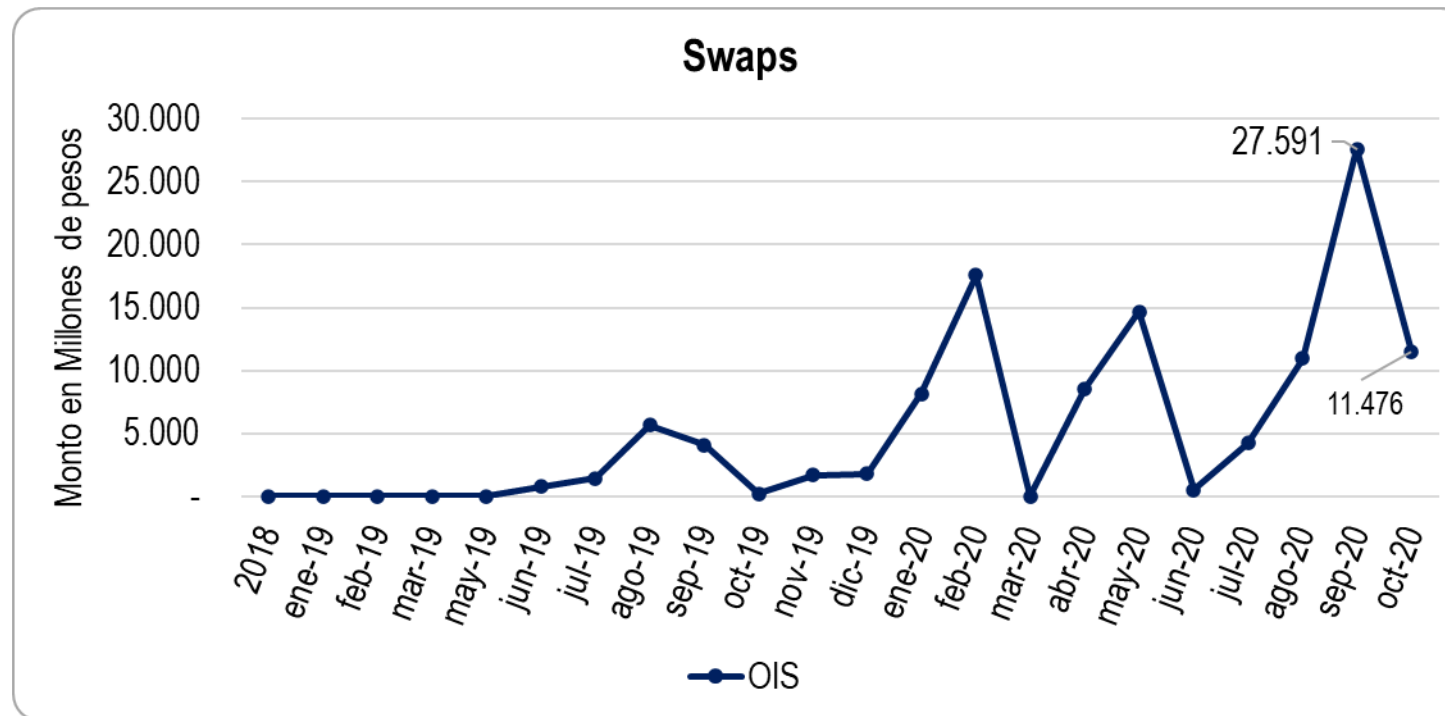
- Evolución de Gestión de Operaciones Renta Fija



% Crecimiento Anual: 7%

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**
 - Evolución de Gestión de Operaciones Swaps



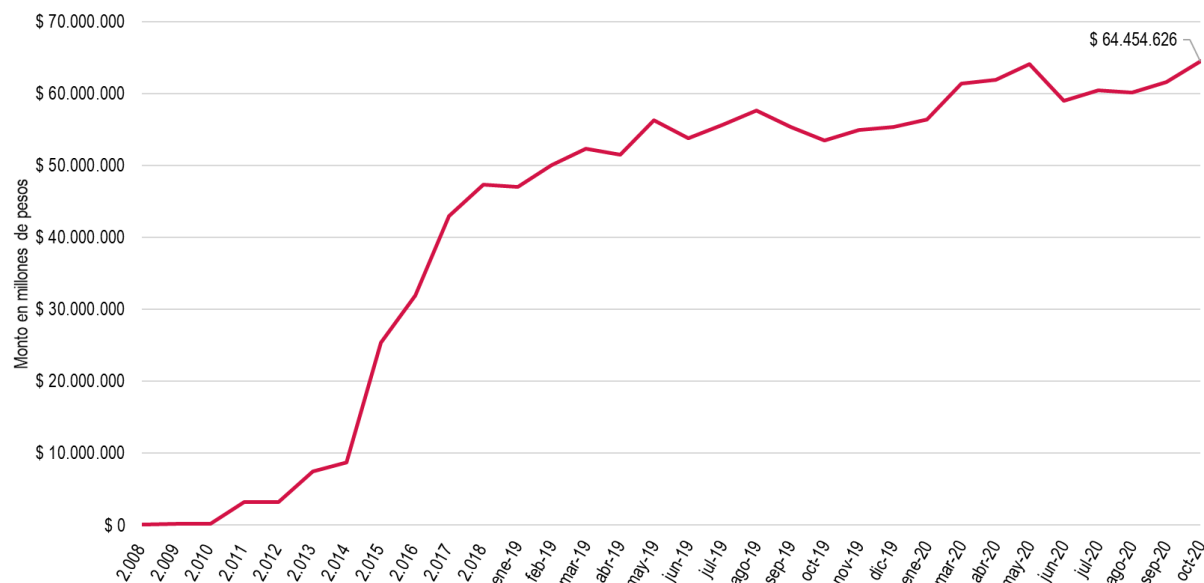
% Crecimiento Anual: 4950 %

Hasta el 30 de Octubre de 2020

Informe de la Administración

- Posición Abierta**

— Evolución Posición abierta



% Crecimiento anual respecto a octubre - 19

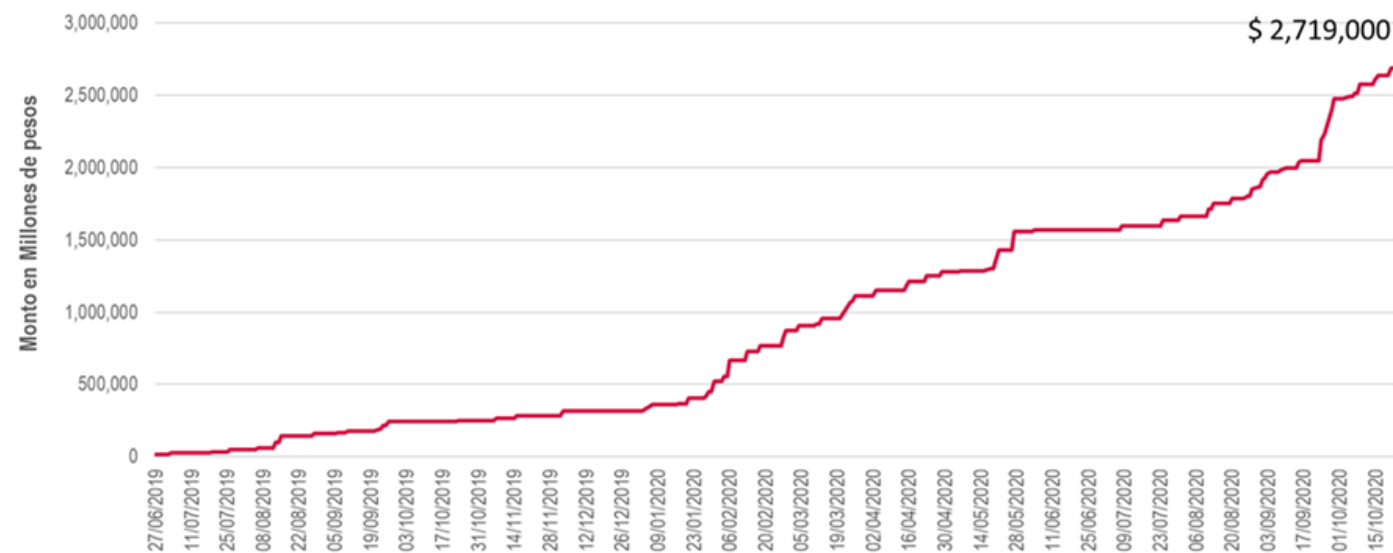
17,3%

Segmento	Producto	Posición Abierta Valorada	% Participación	Valor garantías exigidas por fluctuación	% Participación Garantías exigidas	(B / A*2)
Derivados financieros	Forward NDF (USD/COP)	27.778.026	43,10%	1.105.786	58,30%	1,85%
	Futuro y Mini Futuro de Tasa de Cambio Dólar/Peso	2.103.085	3,26%			
	Opción sobre la TRM	6.376	0,01%			
	Subtotal Activos sobre TRM	29.887.487	46,37%	1.105.786	58,30%	1,85%
	OIS IBR	10.844.501	16,83%	16.552	0,87%	0,08%
	OIS IBR FORMACIÓN	4.689.993	7,28%	2.595	0,14%	0,03%
	Futuro OIS	1.514.161	2,35%	6.274	0,33%	0,21%
	Subtotal Activos sobre Overnight Index Swap	17.048.655	26,45%	25.421	1,34%	0,07%
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por diferencias	10.817	0,02%	3.938	0,21%	18,20%
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por Entrega	22.579	0,04%	9.073	0,48%	20,09%
	Futuros y Mini Futuro del Índice Accionario COLCAP	13.085	0,02%	3.690	0,19%	14,10%
	Subtotal Activos sobre Acciones	46.481	0,07%	16.701	0,88%	17,97%
	Futuros sobre Títulos TES de Referencias Específicas	2.119.207	3,29%	109.187	5,76%	2,58%
	Futuro y Mini Futuro sobre Electricidad Mensual	4.158	0,01%	1.809	0,10%	21,76%
	Total Derivados	49.105.988	76,19%	1.258.905	66,38%	1,28%
Renta Variable	Repos	265.980	0,41%	44.199	2,33%	8,31%
	TTV's	1.653	0,00%	2.269	0,12%	68,63%
	Contado	289.452	0,45%	65.202	3,44%	11,26%
	Total Renta Variable	557.085	0,86%	111.670	5,89%	10,02%
Swaps	IRS	0	0,00%	0	0,00%	0,00%
	OIS	2.719.000	4,22%	12.155	0,64%	0,22%
	Total Swaps	2.719.000	4,22%	12.155	0,64%	0,22%
Renta Fija	Simultáneas	12.072.553	18,73%	513.891	27,10%	2,13%
Total		64.454.626	100%	1.896.622	100%	1,47%

Hasta el 30 de Octubre de 2020

Informe de la Administración

- *Posición Abierta Swaps*
– Evolución Posición abierta



Plazo al Vencimiento	Volumen Octubre	Posición Abierta	Garantía Exigida
0 - 1 Año	-	6,000	12,155
1 - 2 Años	59,000	1,167,000	
2 - 5 Años	123,000	1,105,500	
5 - 10 Años	59,000	440,500	
10 - 15 Años	-	-	
Total	241,000	2,719,000	

* Valor en Millones COP

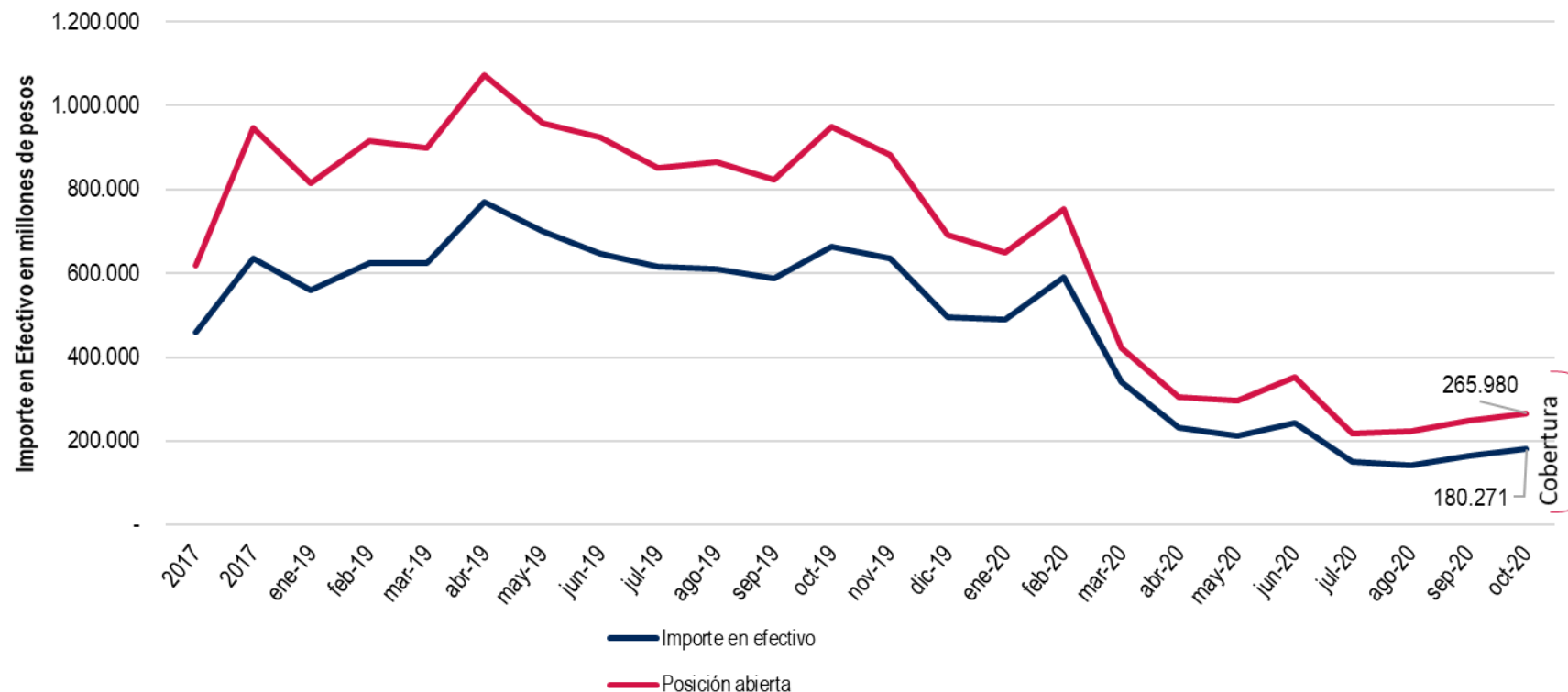
*Valor en Millones COP

Hasta el 30 de Octubre de 2020

Informe de la Administración

- **Posición Abierta Renta Variable**

- Evolución Posición Abierta vs Importe en efectivo - Repos





CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM