

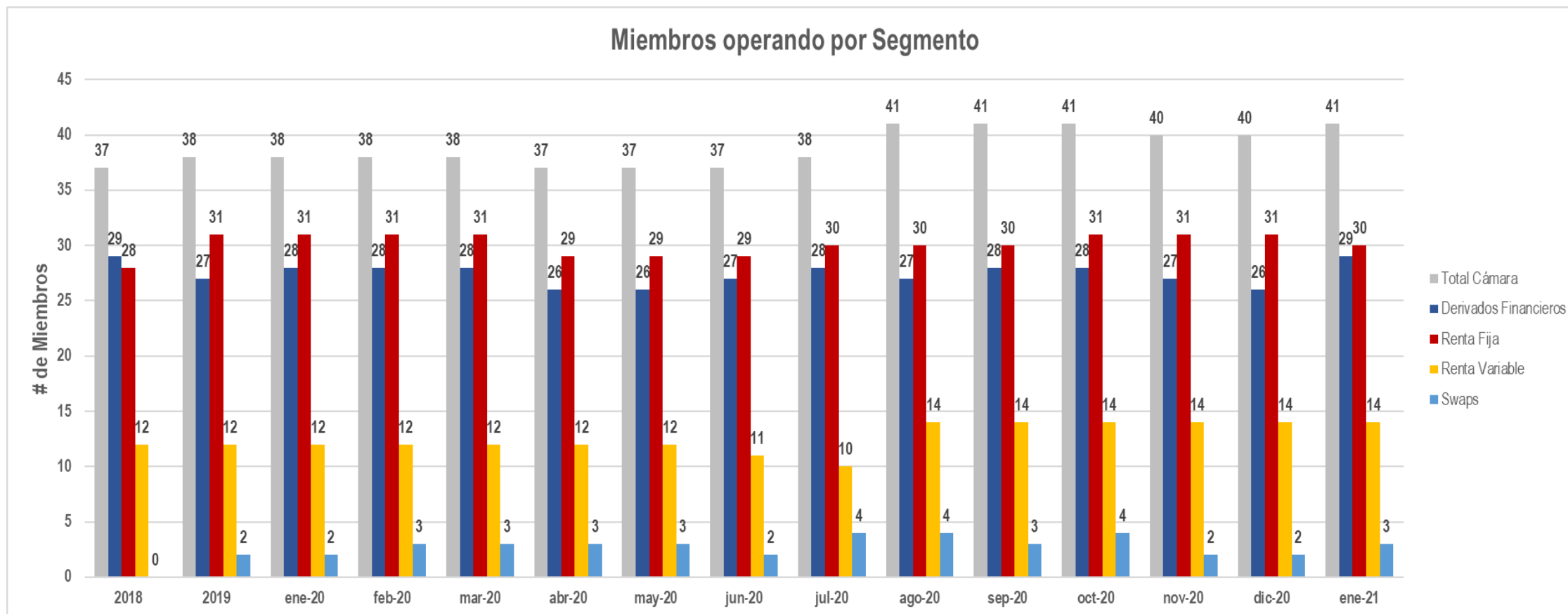


Evolución de Mercado Enero

Enero 2021

Informe de la Administración

- *Gestión de Operaciones*
 - Evolución Número de Miembros

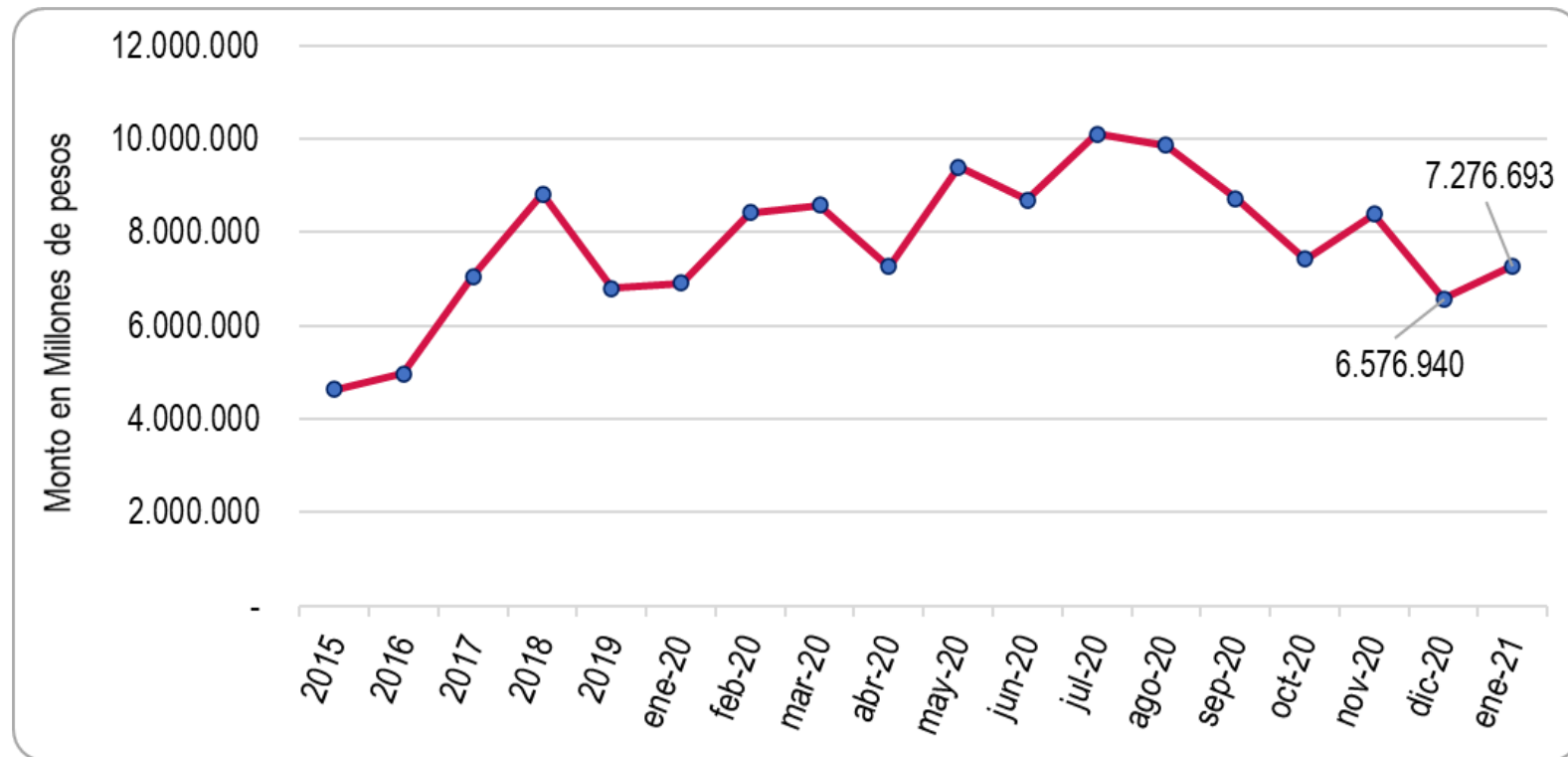
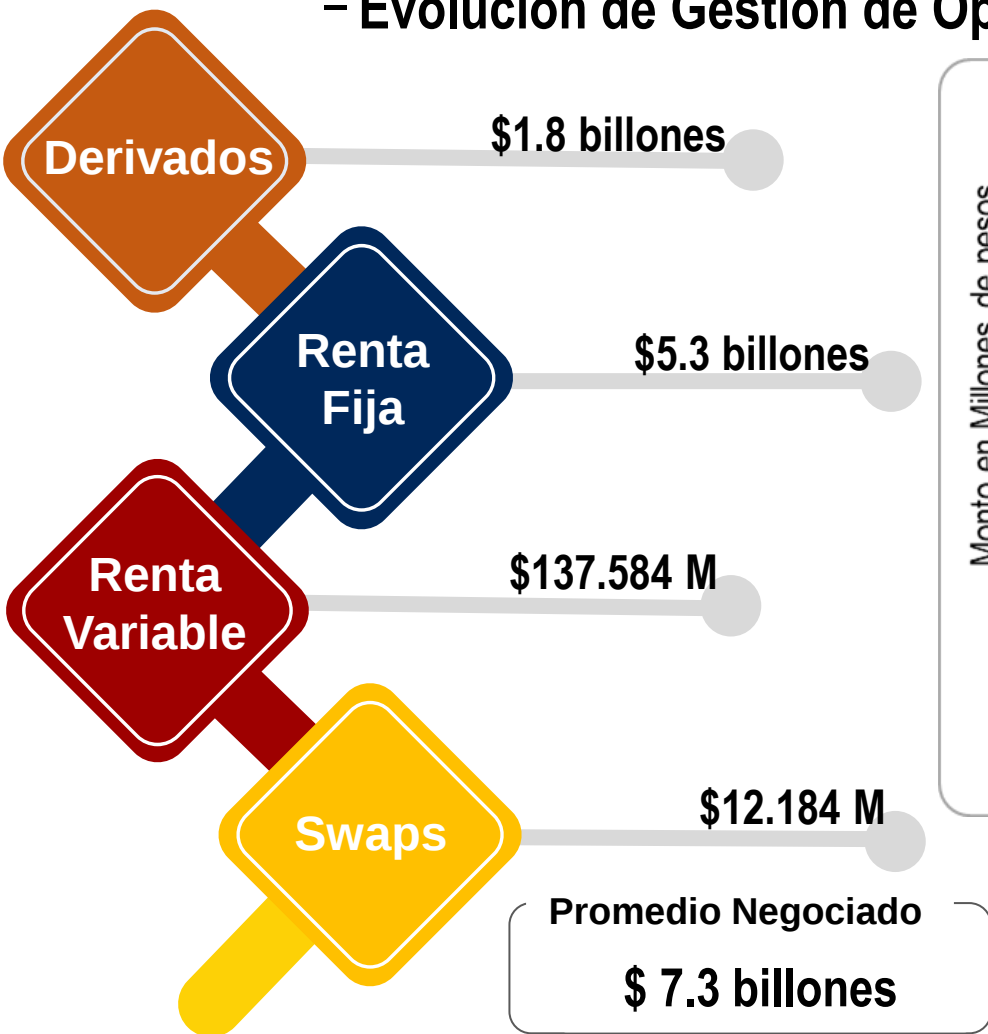


Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones**



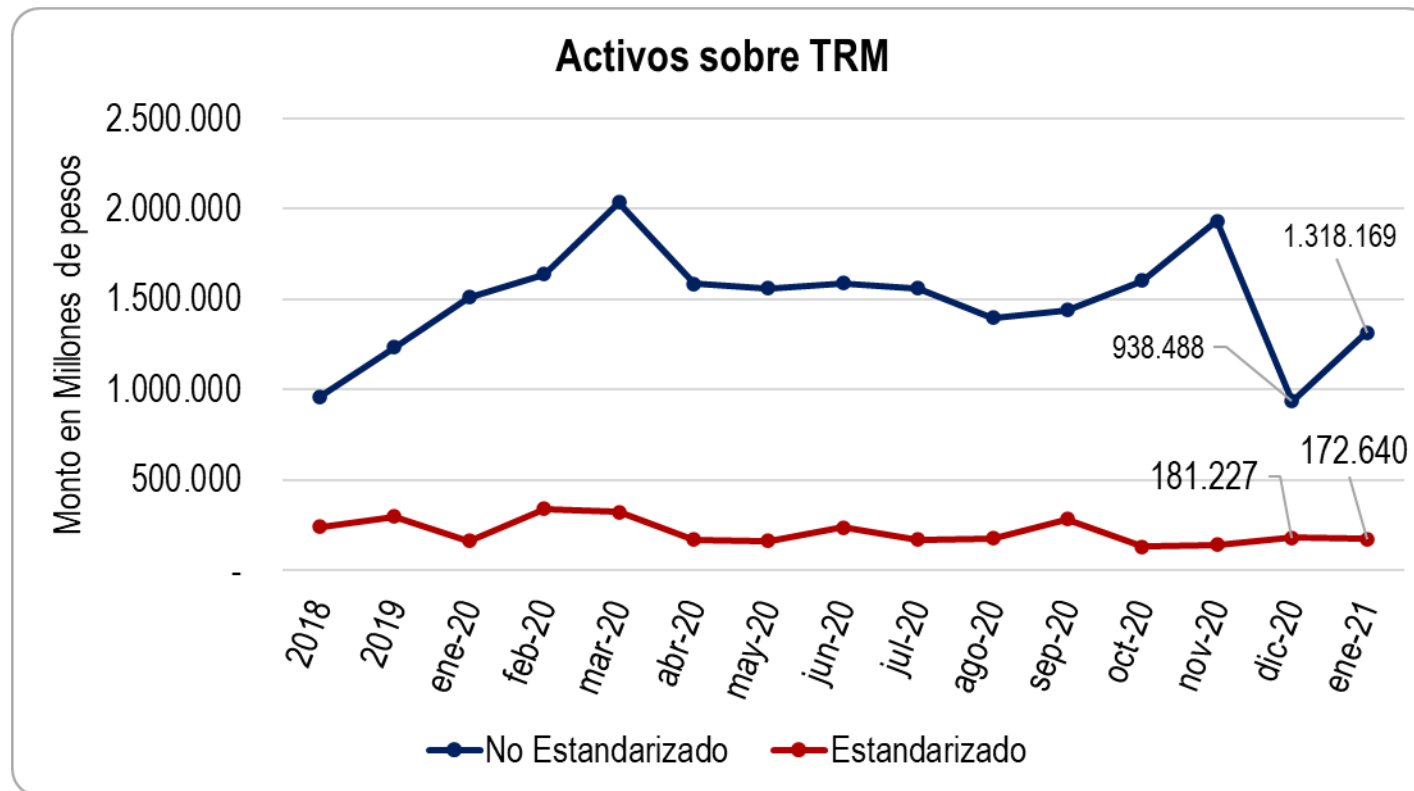
% Crecimiento Anual: 5%



Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Derivados Financieros

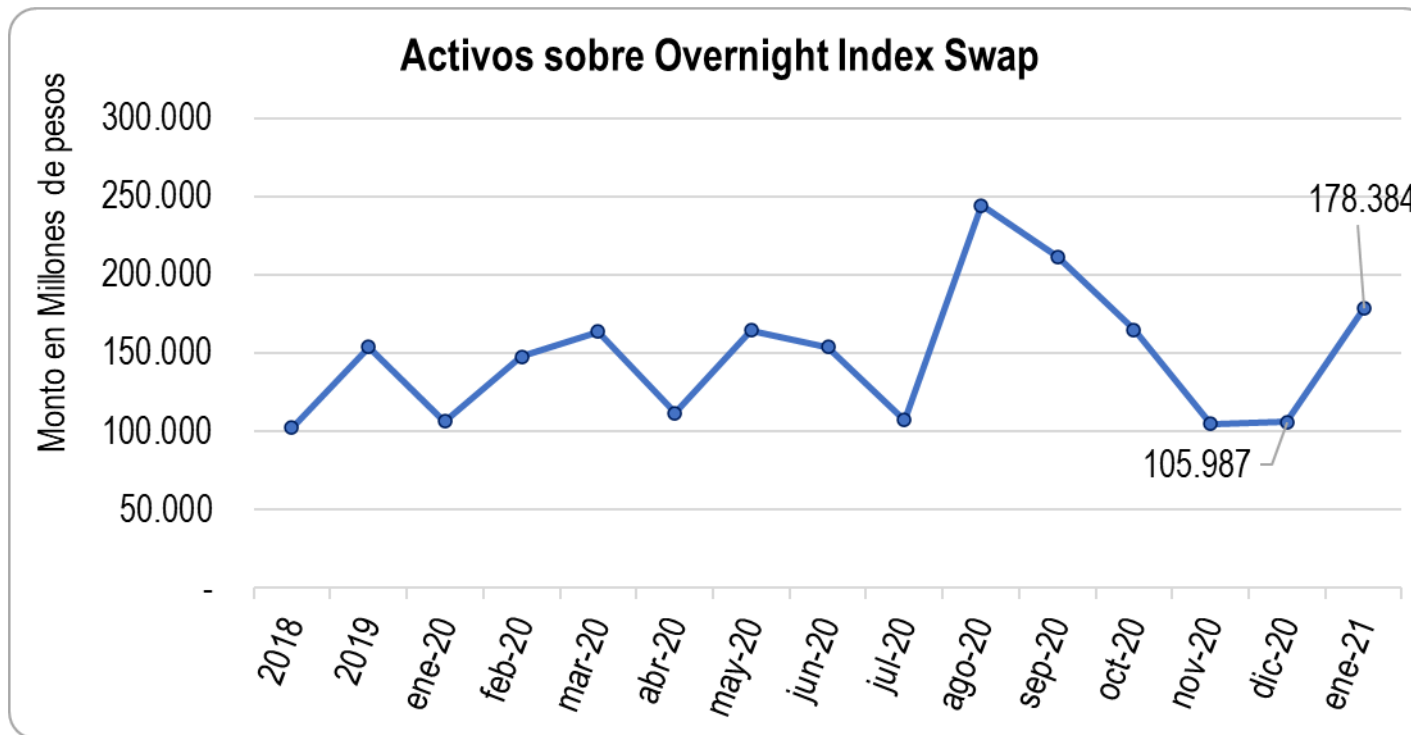


% Crecimiento Anual: -11%

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Derivados Financieros



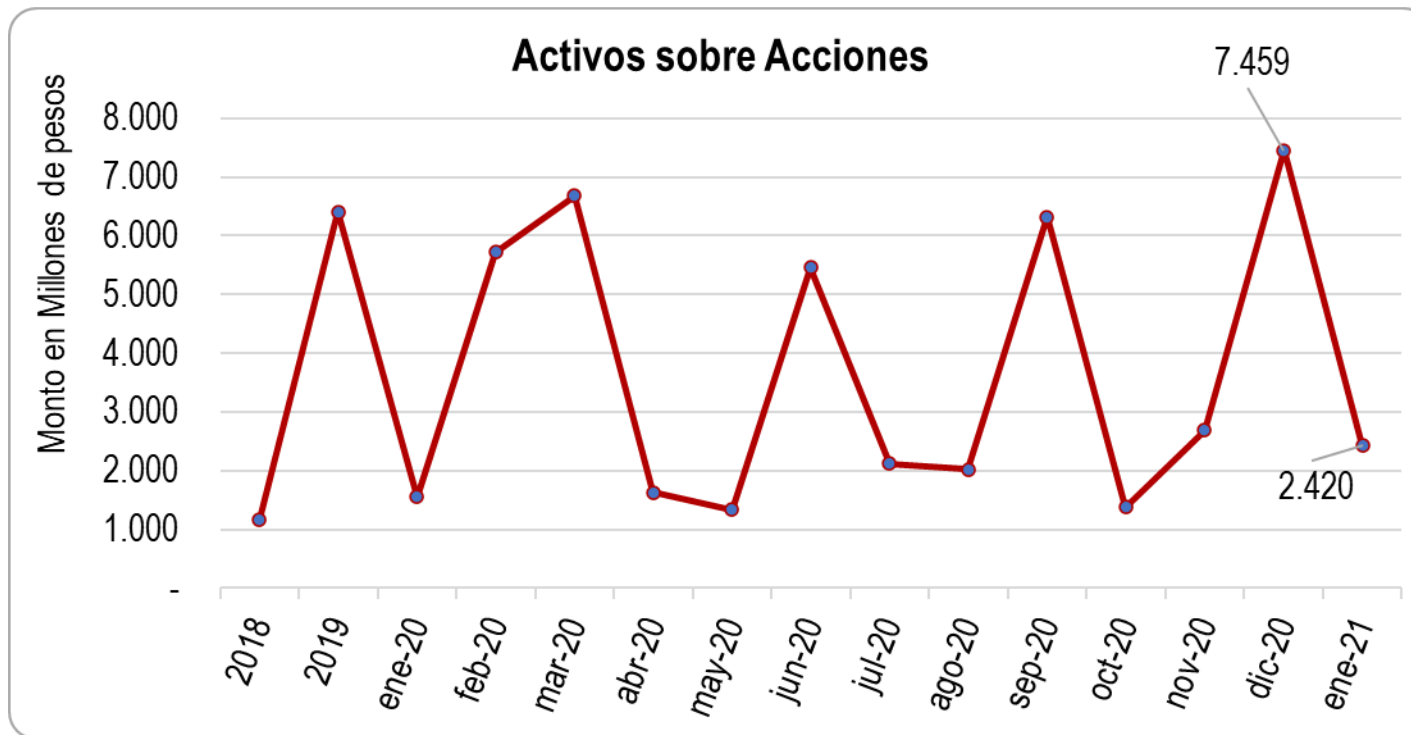
% Crecimiento Anual: 68%

Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Derivados Financieros



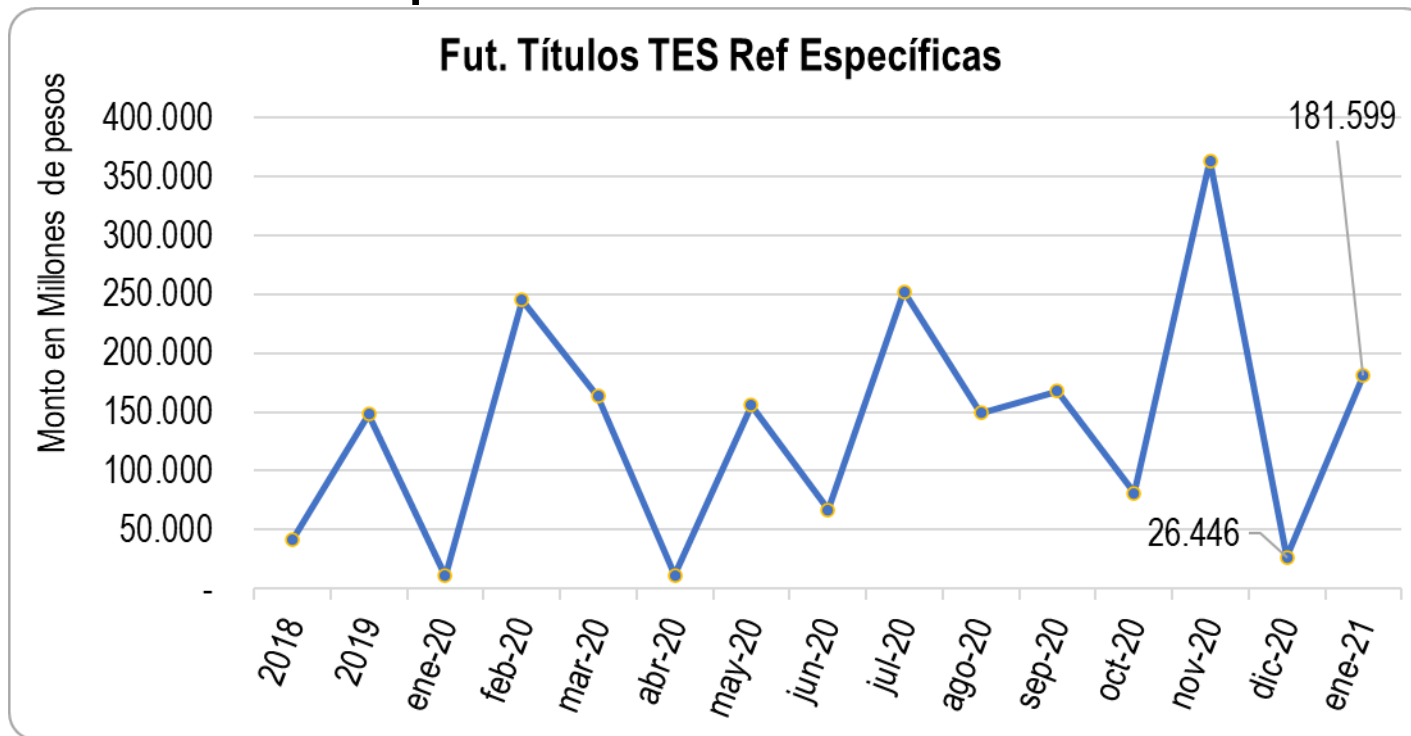
% Crecimiento Anual: 56 %

Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Derivados Financieros



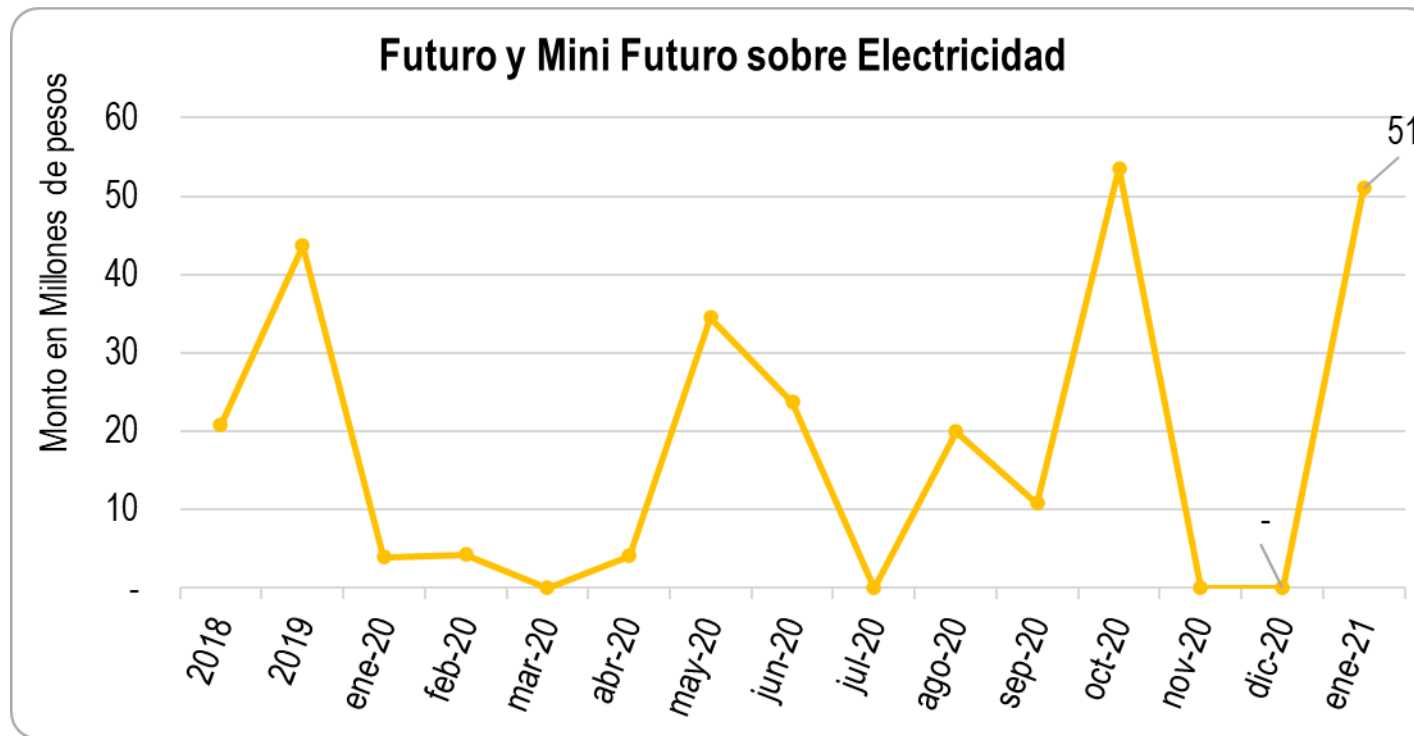
% Crecimiento Anual: 100 %

Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Derivados Financieros



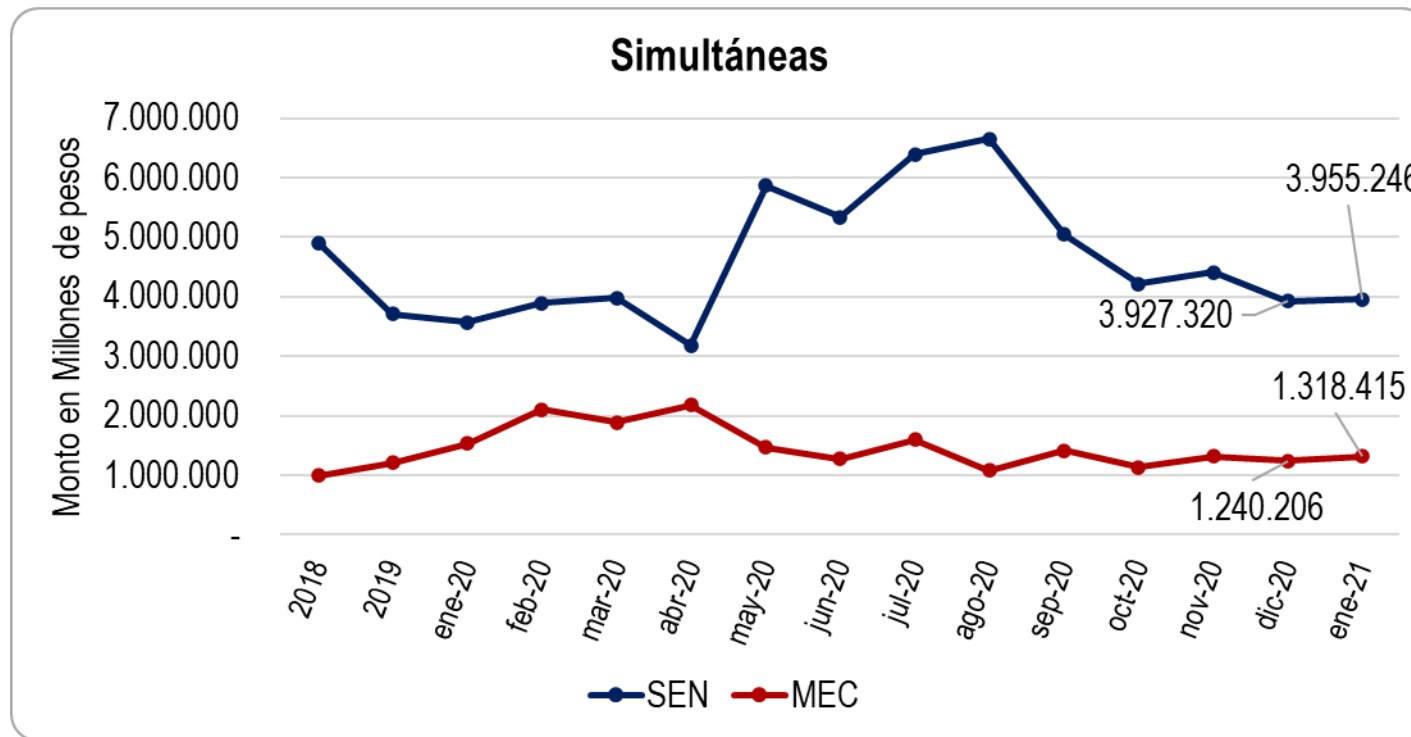
% Crecimiento Anual: 100 %

Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Renta Fija

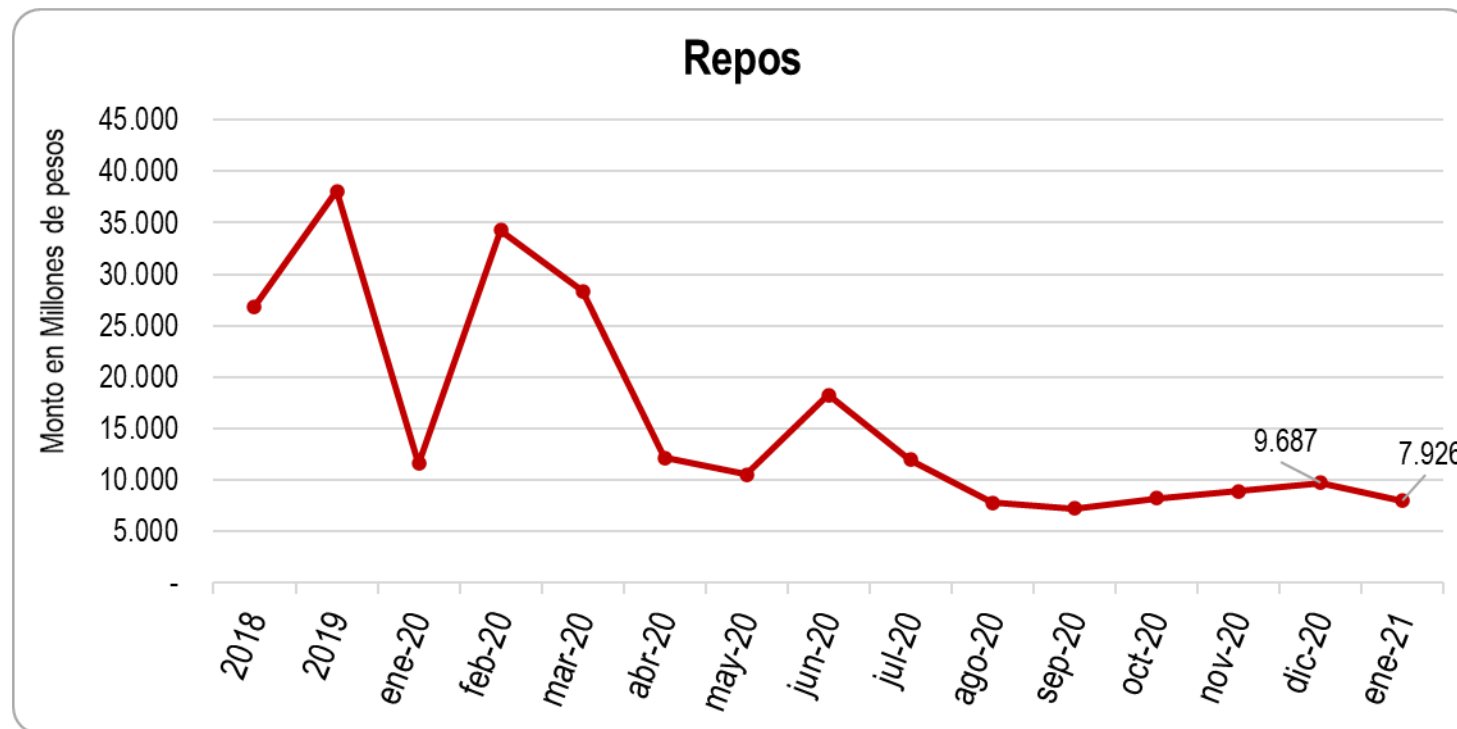


% Crecimiento Anual: 3%

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Renta Variable



Una sola punta



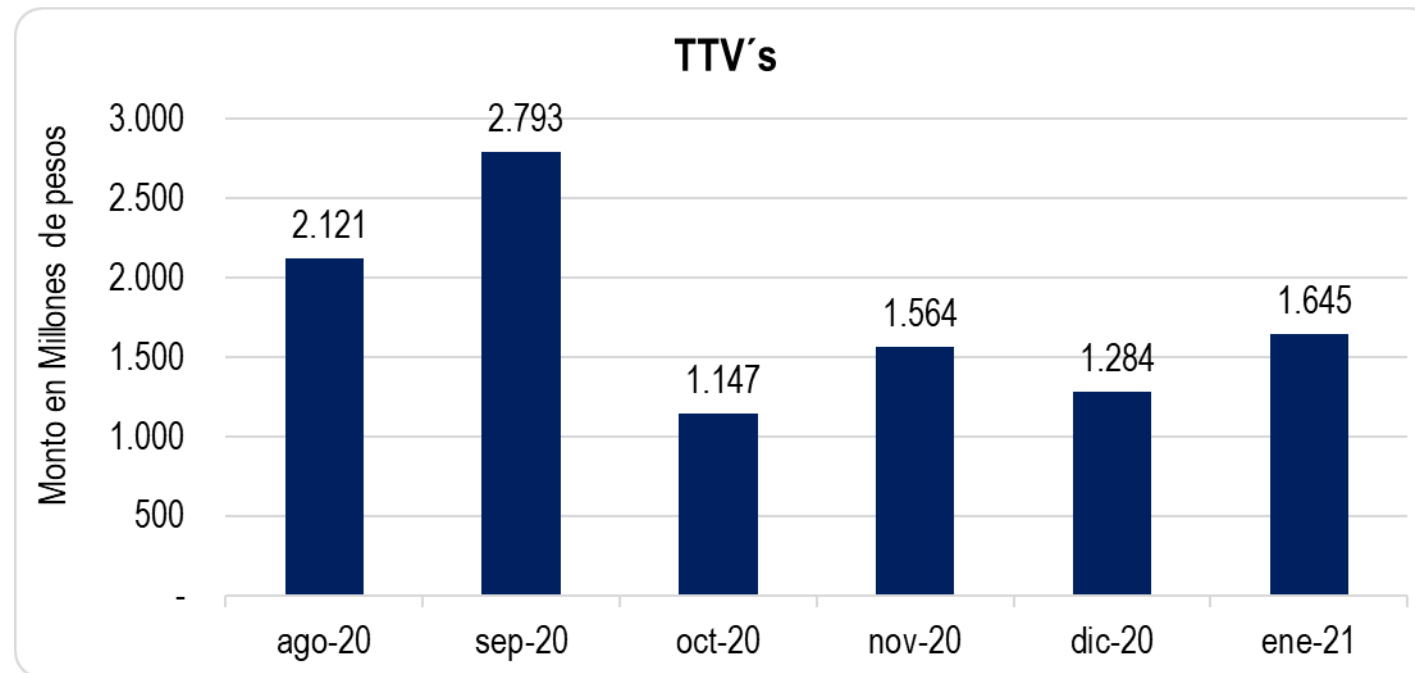
% Crecimiento Anual: -31 %

Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución de Gestión de Operaciones Renta Variable

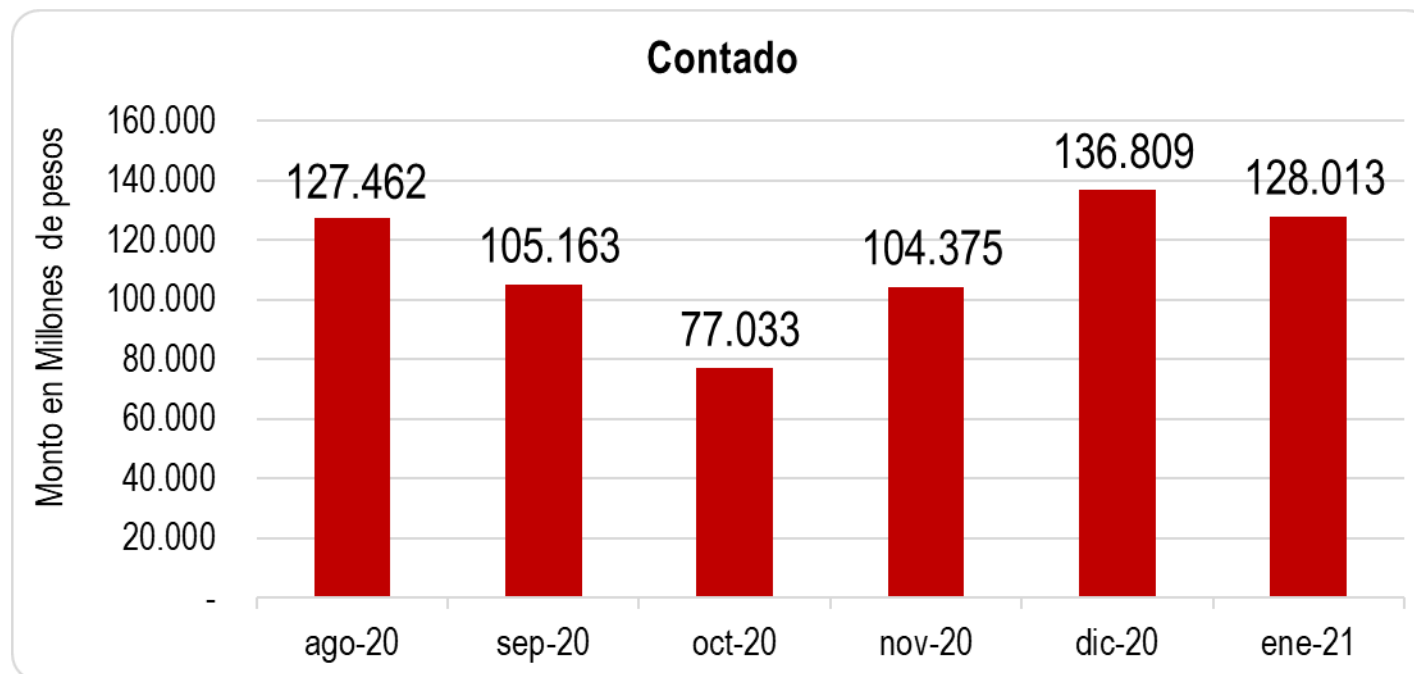


Una sola punta

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

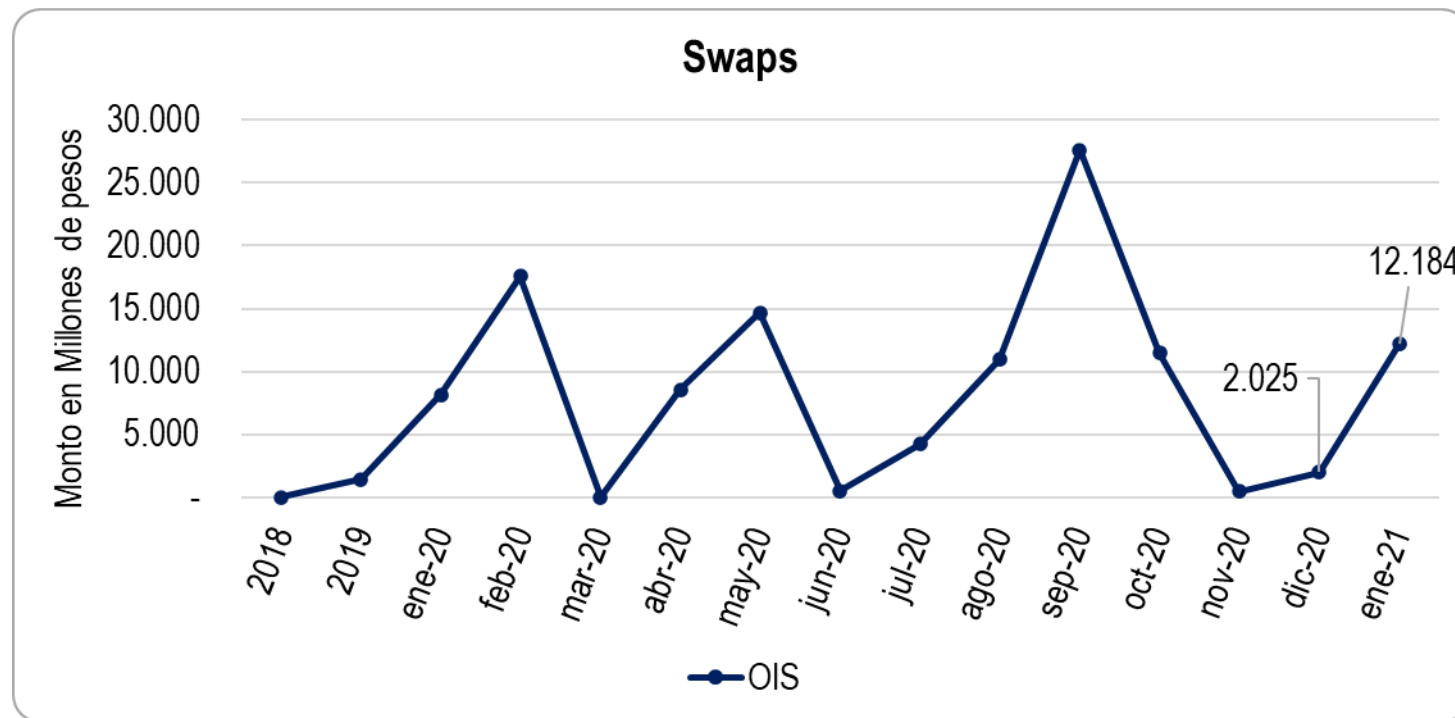
- Evolución de Gestión de Operaciones Renta Variable



Una sola punta

Informe de la Administración

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



% Crecimiento Anual: 13 %

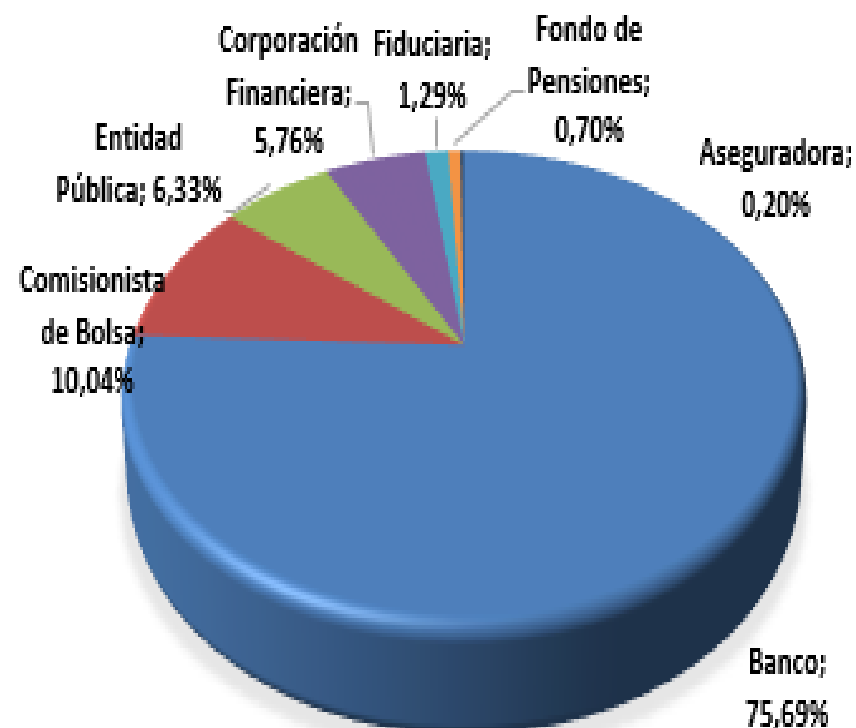
Hasta el 29 de Enero de 2021

Informe de la Administración

- **Volumen Operado**

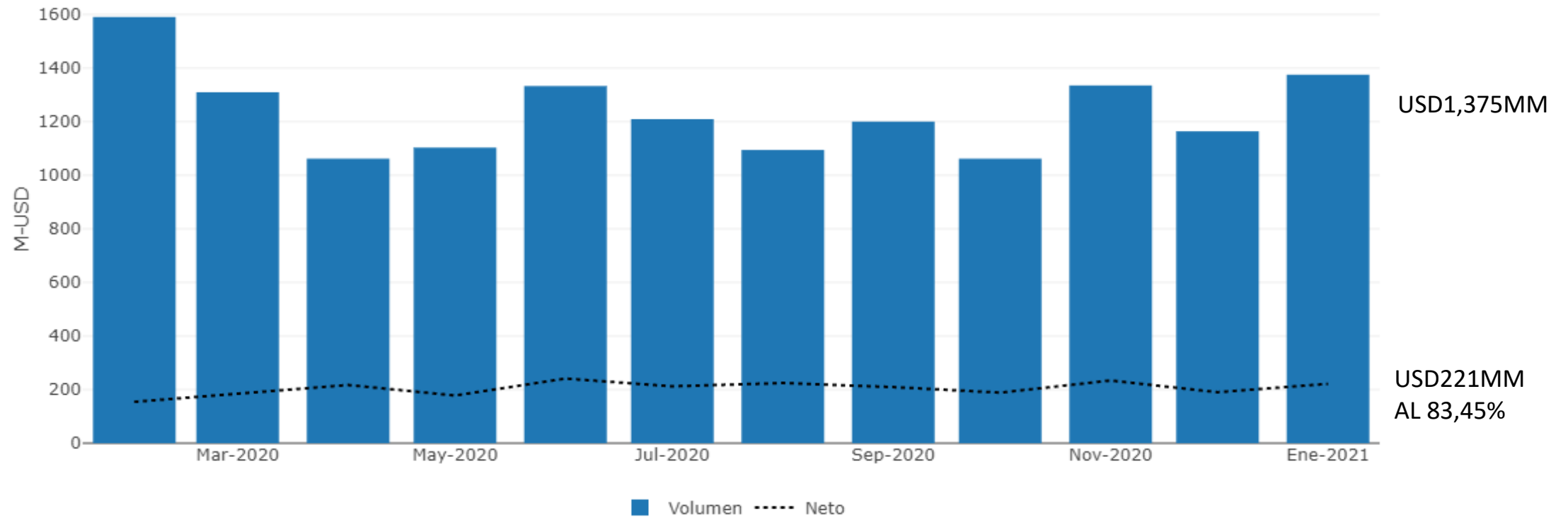
- Ranking: Estandarizados y No Estandarizados año 2021– (Con Simultáneas, Repos, Contado y TTV's)

No	Entidad	Total
1	Banco GNB Sudameris	13,05%
2	Banco BBVA	11,06%
3	Banco Scotiabank Colpatría	10,64%
4	Citibank	6,84%
5	Ministerio de Hacienda y Crédito Público	6,33%
6	Banco Davivienda	6,22%
7	Jpmorgan	5,54%
8	Bancolombia	4,89%
9	Banco Santander	4,83%
10	Banco Avvillas	4,59%
11	Banco Agrario	4,56%
12	BTG Pactual	3,37%
13	Credicorp Capital	2,30%
14	Banco de Bogotá	2,27%
15	Banco de Occidente	1,90%
16	Bancoldex	1,70%
17	Banco Popular	1,63%
18	Corredores Davivienda	1,46%
19	Corficolombiana	1,29%
20	Alianza Valores	1,25%



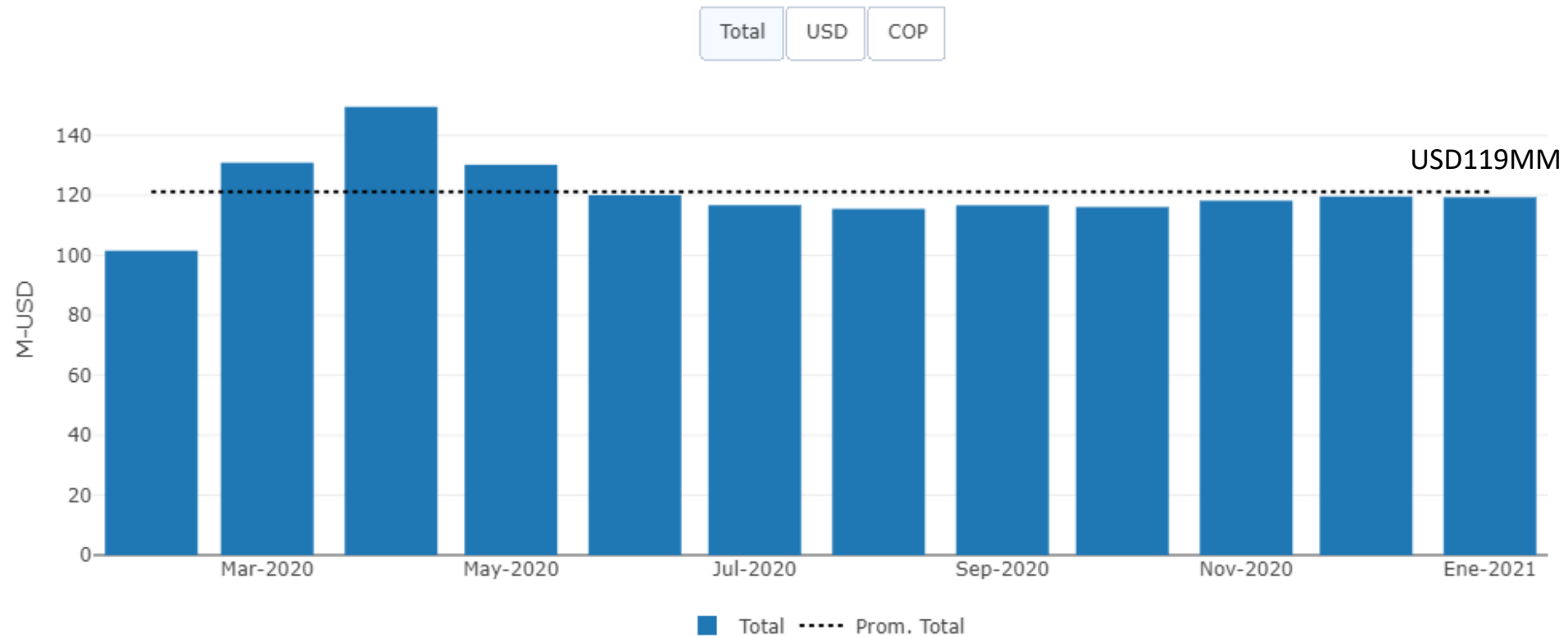
Informe de la Administración

- **Compensación y Liquidación de Divisas: Ahorro de Liquidez**
 - Promedio diario mercado T+0



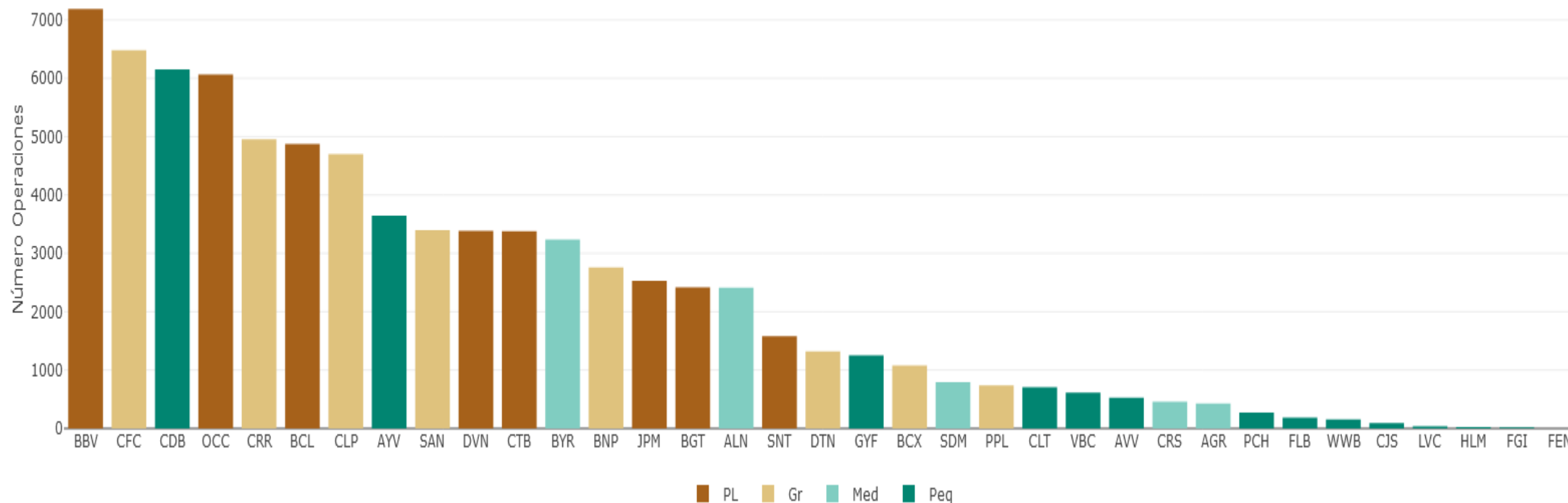
Informe de la Administración

- **Compensación y Liquidación de Divisas: Garantías Recibidas**
 - Promedio diario mercado T+0



Informe de la Administración

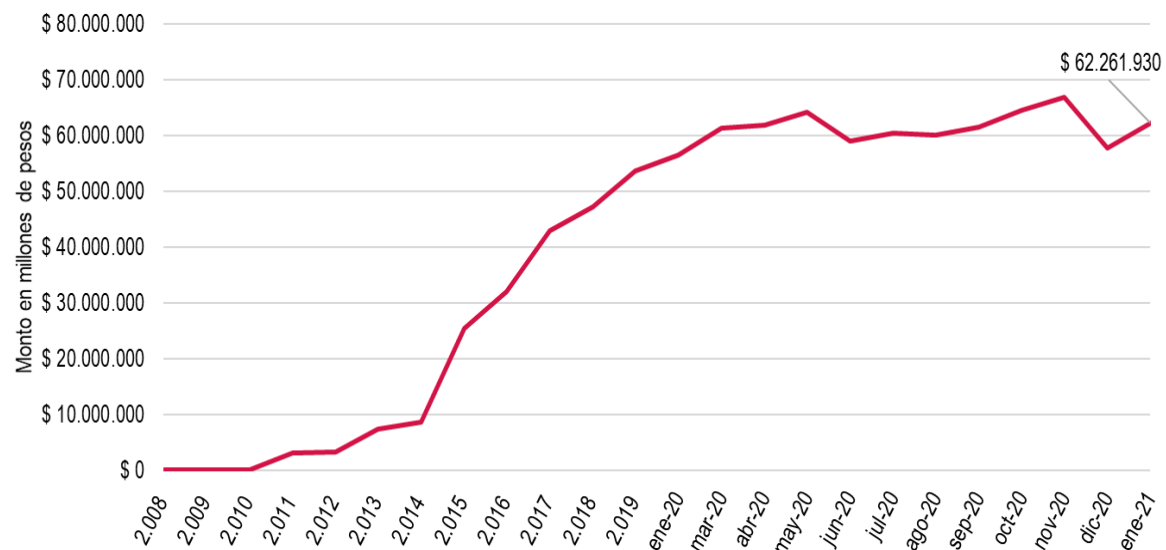
- **Compensación y Liquidación de Divisas: Operaciones compensadas por entidad**
 - Numero total de operaciones



Informe de la Administración

- Posición Abierta**

— Evolución Posición abierta



% Crecimiento anual respecto a enero - 20
10,3%

Segmento	Producto	Posición Abierta Valorada	% Participación	Valor garantías exigidas por fluctuación	% Participación Garantías exigidas	(B / A*2)
Derivados financieros	Forward NDF (USD/COP)	24.038.054	38,61%	909.529	53,01%	1,75%
	Futuro y Mini Futuro de Tasa de Cambio Dólar/Peso	1.880.609	3,02%			
	Opción sobre la TRM	178	0,00%			
	Subtotal Activos sobre TRM	25.918.841	41,63%	909.529	53,01%	1,75%
	OIS IBR	9.667.860	15,53%	14.125	0,82%	0,07%
	OIS IBR FORMACIÓN	4.543.362	7,30%	3.805	0,22%	0,04%
	Futuro OIS	1.354.077	2,17%	4.115	0,24%	0,15%
	Subtotal Activos sobre Overnight Index Swap	15.565.300	25,00%	22.046	1,28%	0,07%
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por diferencias	15.978	0,03%	3.467	0,20%	10,85%
	Futuros sobre Acciones del Índice COLCAP con Liquidación por Entrega	23.882	0,04%	11.061	0,64%	23,16%
	Futuros y Mini Futuro del Índice Accionario COLCAP	13.099	0,02%	3.519	0,21%	13,43%
	Subtotal Activos sobre Acciones	52.960	0,09%	18.047	1,05%	17,04%
	Futuros sobre Títulos TES de Referencias Específicas	2.602.959	4,18%	102.909	6,00%	1,98%
	Futuro y Mini Futuro sobre Electricidad Mensual	1.833	0,00%	583	0,03%	15,90%
	Total Derivados	44.141.893	70,90%	1.053.114	61,37%	1,19%
Renta Variable	Repos	245.786	0,39%	39.650	2,31%	8,07%
	TTV's	1.063	0,00%	1.414	0,08%	66,48%
	Contado	420.154	0,67%	75.553	4,40%	8,99%
	Total Renta Variable	667.003	1,07%	116.617	6,80%	8,74%
Swaps	IRS	0	0,00%	0	0,00%	0,00%
	OIS	2.983.000	4,79%	8.238	0,48%	0,14%
	Total Swaps	2.983.000	4,79%	8.238	0,48%	0,14%
Renta Fija	Simultáneas	14.470.035	23,24%	537.955	31,35%	1,86%
Total		62.261.930	100%	1.715.924	100%	1,38%

Hasta el 29 de Enero de 2021



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM