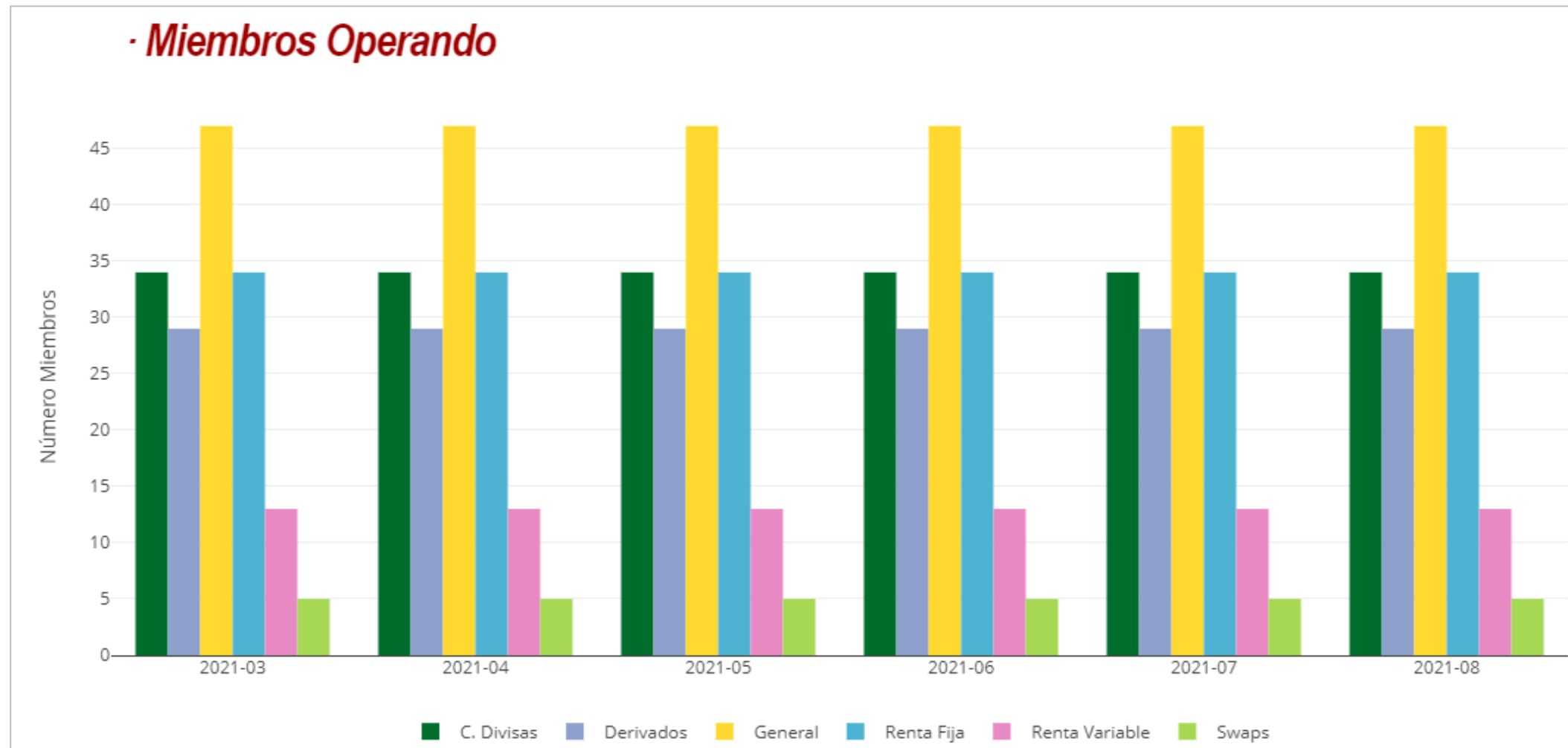




Evolución de Mercado

Agosto 2021

Informe de la Administración



Informe de la Administración

- Volumen Operado

Segmento	Tipo Producto	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%	\$13,308,669	\$14,576,620	\$306,109,023	\$13,276,290	\$1,632,983,710
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	41.89%	\$5,575,637	\$4,993,020	\$104,853,412	\$4,559,916	\$560,869,630
Renta Fija	TES	Simultaneas	27.76%	\$3,694,924	\$6,171,464	\$129,600,746	\$5,696,502	\$700,669,738
Derivados	TRM	NDF FX FWD	16.37%	\$2,178,231	\$1,659,642	\$34,852,475	\$1,606,202	\$197,562,794
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	5.45%	\$724,663	\$746,842	\$15,683,686	\$669,725	\$82,376,128
Derivados	OIS	OIS IBR	2.91%	\$387,138	\$190,285	\$3,995,979	\$71,272	\$8,766,445
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	1.38%	\$184,171	\$334,016	\$7,014,334	\$195,161	\$24,004,785
Derivados	TRM	F. TRM	1.34%	\$178,534	\$215,624	\$4,528,095	\$238,281	\$29,308,527
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	1.28%	\$170,009	\$102,198	\$2,146,154	\$100,416	\$12,351,172

Informe de la Administración

- Volumen Operado

Segmento	Tipo Producto	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
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.73%	\$97,000	\$35,500	\$745,500	\$16,370	\$2,013,500
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.69%	\$92,401	\$92,398	\$1,940,361	\$92,368	\$11,361,308
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.06%	\$8,425	\$13,301	\$279,323	\$13,160	\$1,618,660
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.06%	\$7,383	\$8,672	\$182,111	\$4,421	\$543,830
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.04%	\$5,472	\$6,898	\$144,867	\$4,665	\$573,856
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.03%	\$3,355	\$1,476	\$30,989	\$1,637	\$201,333
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.01%	\$1,325	\$547	\$11,478	\$758	\$93,226
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$50	\$1,058	\$27	\$3,303
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$311	\$6,535	\$1,067	\$131,262

Informe de la Administración

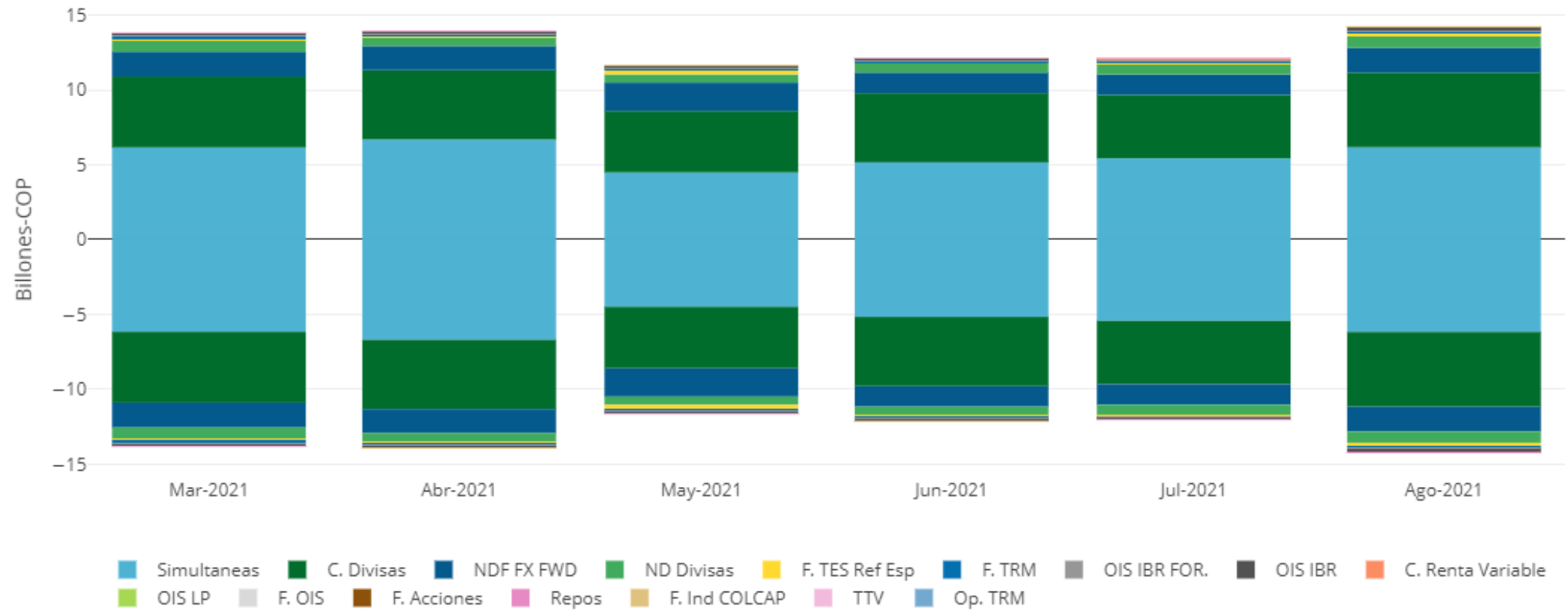
- Volumen Operado

Segmento	Tipo Producto	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	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$1,277	\$26,812	\$3,003	\$369,374
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$3,100	\$65,107	\$917	\$112,825
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$423	\$52,014

Informe de la Administración

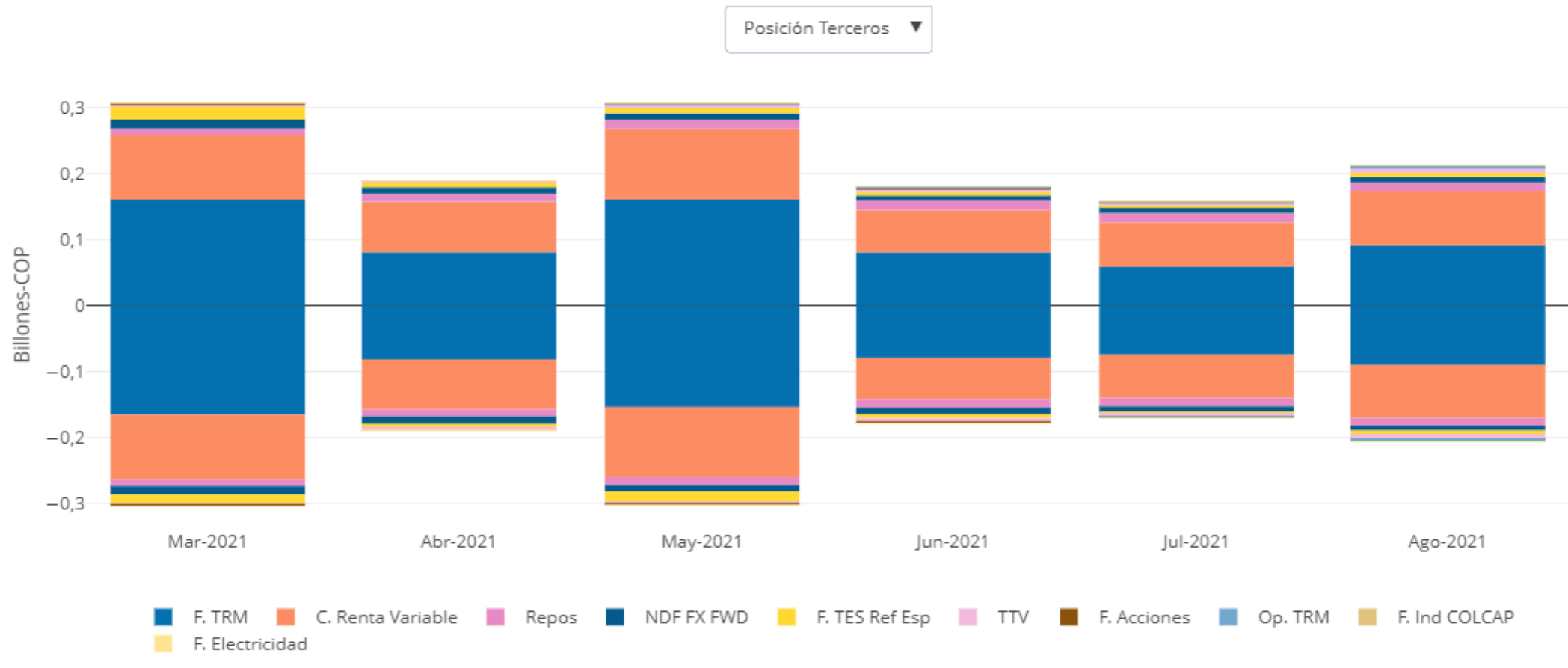
- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

Posición Propia ▼

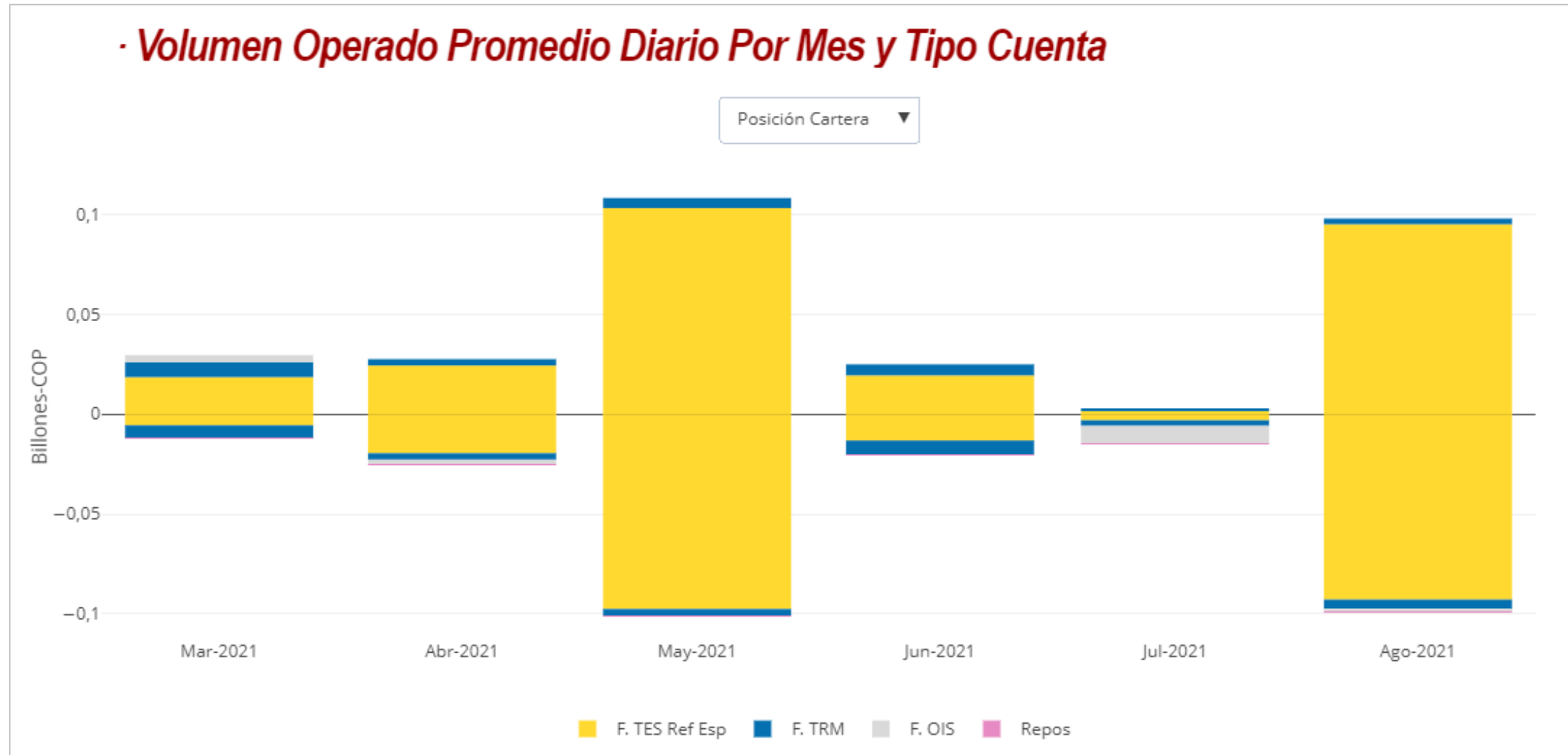


Informe de la Administración

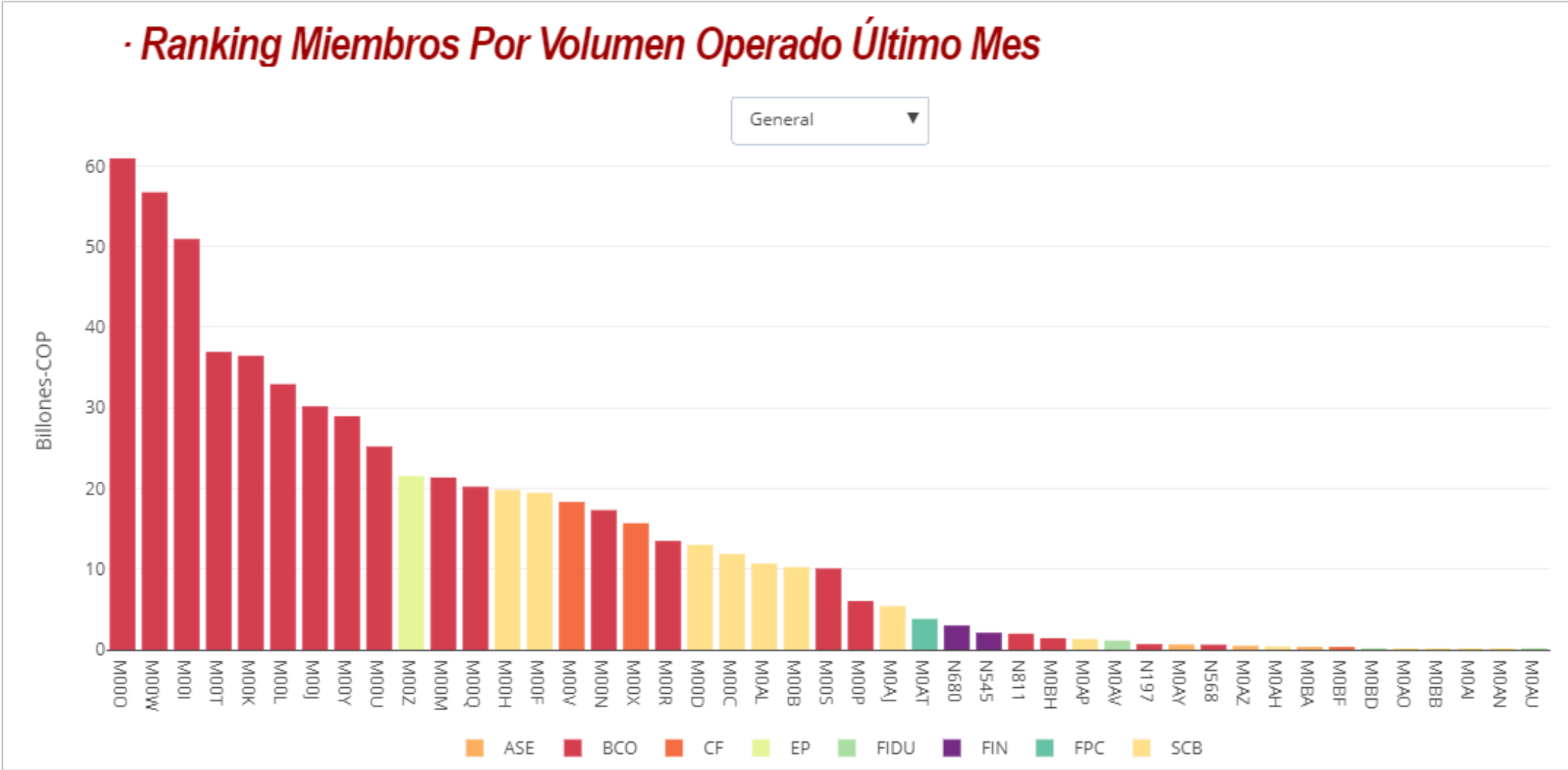
- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta



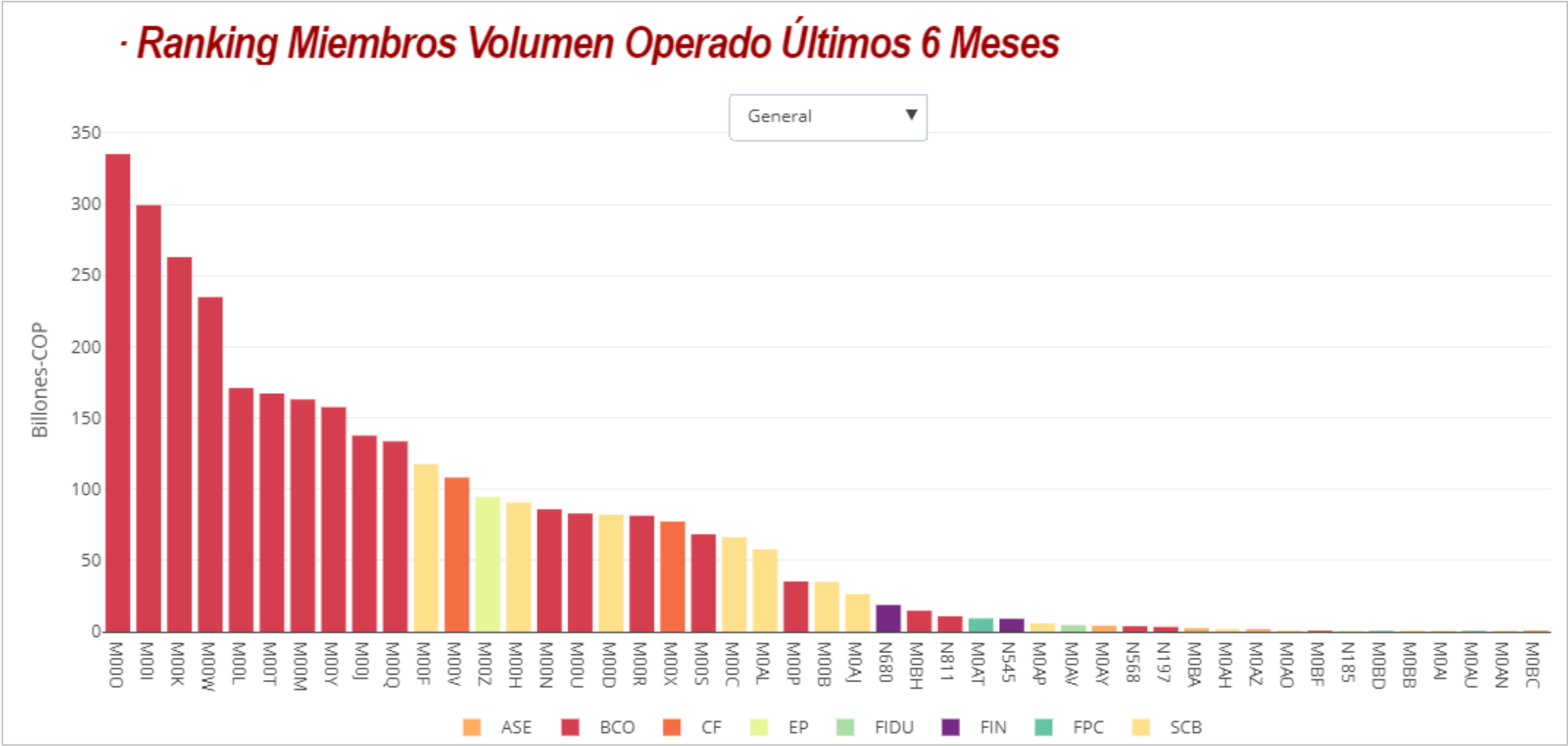
Informe de la Administración



Informe de la Administración



Informe de la Administración



Informe de la Administración

- Posición Abierta

Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	100.00%	\$77,042,865	\$71,956,666	\$65,955,809
Derivados	TRM	NDF FX FWD	40.12%	\$30,906,680	\$30,986,056	\$28,818,621
Renta Fija	TES	Simultaneas	19.72%	\$15,194,122	\$11,539,995	\$10,719,582
Derivados	OIS	OIS IBR	16.71%	\$12,871,629	\$11,869,048	\$10,225,531
Swaps	OIS LP	OIS LP	6.73%	\$5,184,000	\$4,753,952	\$4,025,443
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	6.14%	\$4,730,891	\$4,675,626	\$4,624,116
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	3.87%	\$2,981,589	\$2,773,891	\$2,655,481
Derivados	TRM	F. TRM	2.96%	\$2,277,472	\$2,338,131	\$2,127,998
Derivados	OIS	F. OIS	1.85%	\$1,425,357	\$1,510,417	\$1,480,020

Informe de la Administración

- Posición Abierta

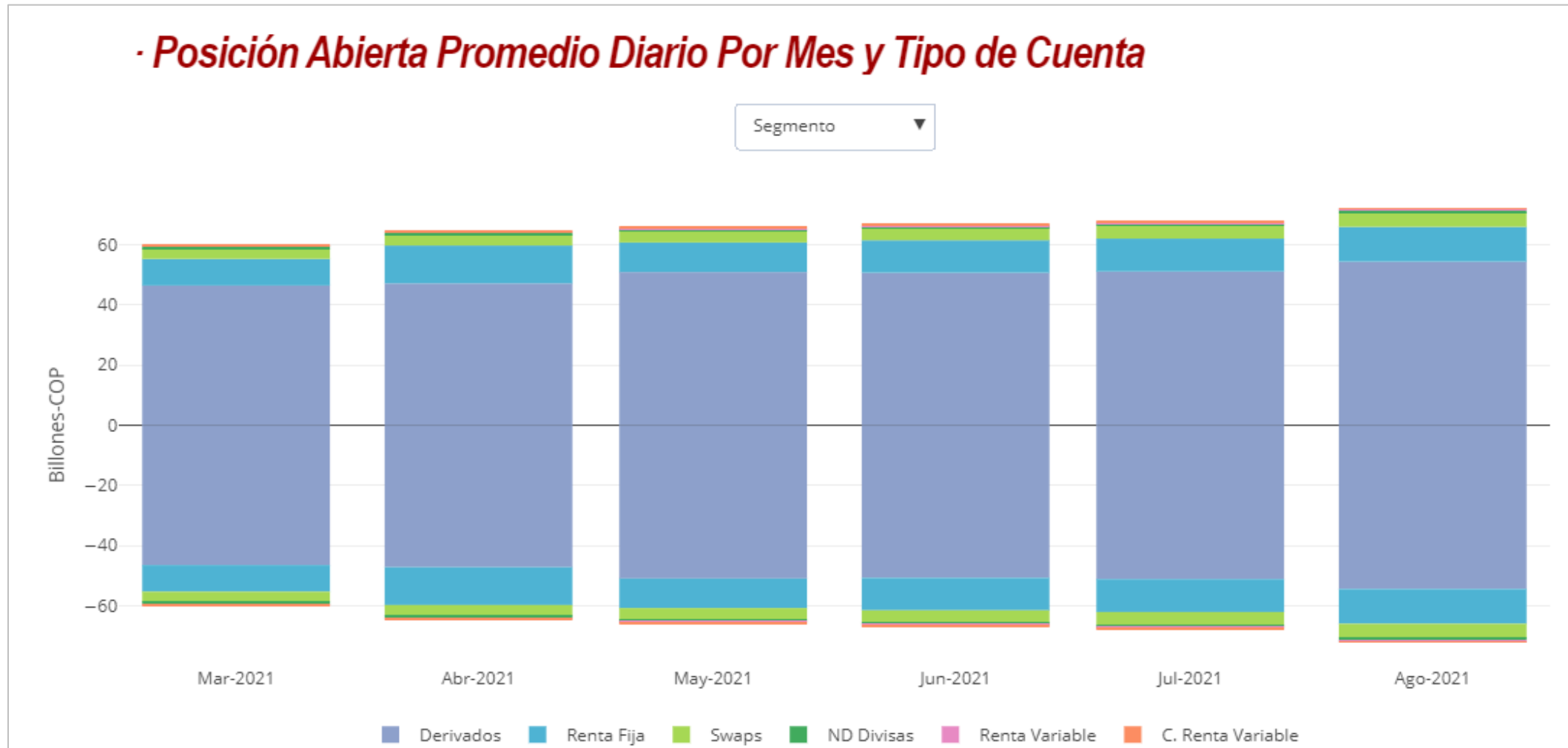
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	0.79%	\$606,762	\$672,132	\$607,945
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.64%	\$494,029	\$485,548	\$393,850
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.23%	\$173,984	\$165,488	\$170,949
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.14%	\$107,383	\$83,187	\$19,564
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.04%	\$29,148	\$32,581	\$28,543
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.03%	\$22,098	\$23,340	\$18,232
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.03%	\$19,885	\$19,885	\$17,925
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$7,936	\$15,549	\$14,030
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.01%	\$7,383	\$8,490	\$4,113

Informe de la Administración

- Posición Abierta						
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$2,517	\$3,350	\$3,445
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$423

Informe de la Administración

- Posición Abierta Promedio Diario Por Mes y Tipo de Cuenta



Informe de la Administración

- Posición Abierta Swaps Por Rango de Años

Rango Años	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
0Y-1Y	\$779,000	\$718,333	\$619,821
1Y-2Y	\$1,440,500	\$1,368,905	\$1,154,472
2Y-5Y	\$2,270,000	\$1,981,119	\$1,622,183
5Y-10Y	\$694,500	\$685,595	\$628,967
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM