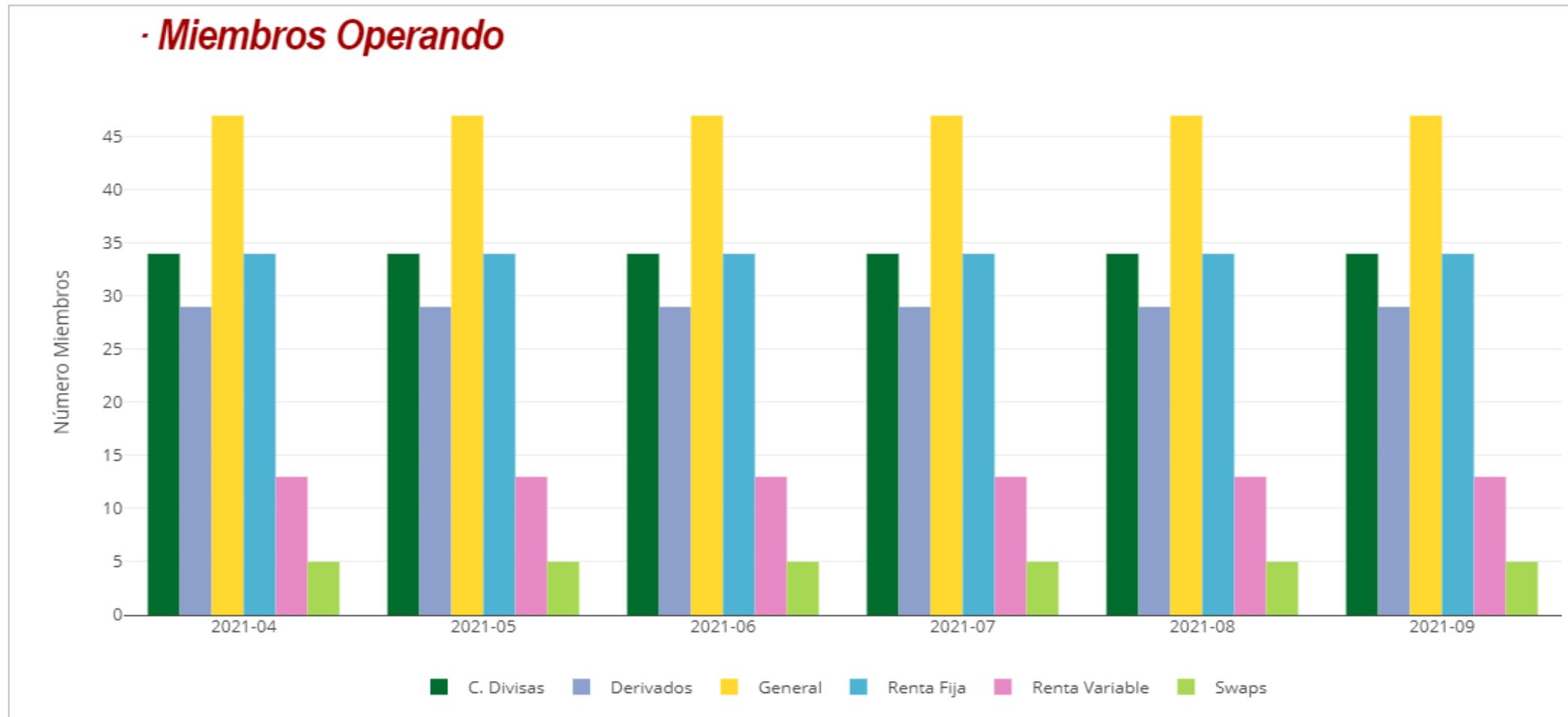




Evolución de Mercado

Septiembre 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%	\$14,142,122	\$14,140,130	\$311,082,853	\$13,274,553	\$1,632,769,999
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	46.69%	\$6,602,679	\$5,258,293	\$115,682,445	\$4,653,918	\$572,431,910
Renta Fija	TES	Simultaneas	27.03%	\$3,822,512	\$5,300,890	\$116,619,577	\$5,542,447	\$681,721,041
Derivados	TRM	NDF FX FWD	13.52%	\$1,911,848	\$1,854,101	\$40,790,226	\$1,638,053	\$201,480,496
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	6.30%	\$890,310	\$877,668	\$19,308,698	\$691,693	\$85,078,239
Derivados	OIS	OIS IBR	2.85%	\$402,459	\$148,374	\$3,264,232	\$87,665	\$10,782,745
Derivados	TRM	F. TRM	1.60%	\$226,716	\$323,980	\$7,127,570	\$232,520	\$28,599,976
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.65%	\$92,484	\$92,452	\$2,033,948	\$92,388	\$11,363,727
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.62%	\$87,165	\$103,572	\$2,278,586	\$98,042	\$12,059,109

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	0.48%	\$68,000	\$40,136	\$883,000	\$20,362	\$2,504,500
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.18%	\$25,659	\$13,052	\$287,149	\$13,639	\$1,677,602
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.05%	\$7,462	\$109,176	\$2,401,874	\$186,515	\$22,941,405
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.02%	\$2,297	\$7,602	\$167,239	\$5,451	\$670,422
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.01%	\$1,525	\$3,836	\$84,386	\$1,695	\$208,497
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.01%	\$796	\$1,783	\$39,225	\$4,323	\$531,715
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$191	\$1,720	\$37,840	\$1,218	\$149,756
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$17	\$1,807	\$39,757	\$991	\$121,851
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$1,686	\$37,101	\$800	\$98,351

Informe de la Administración

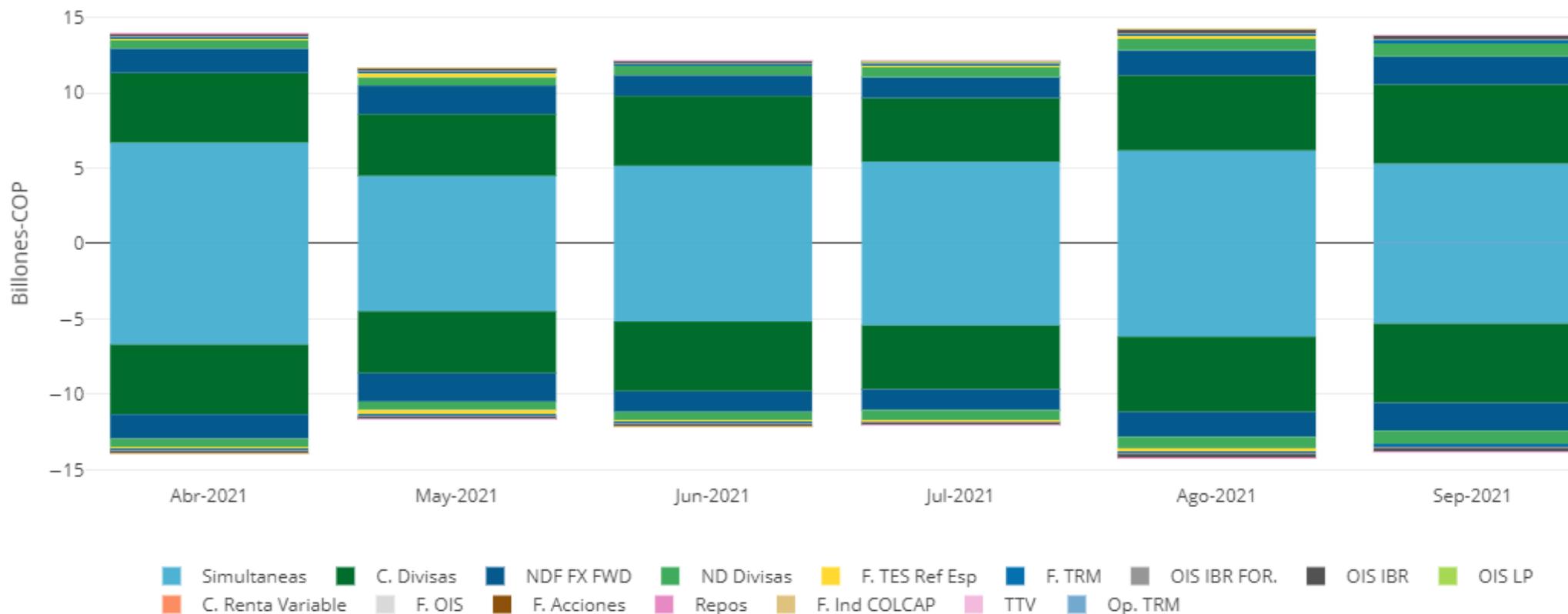
- Volumen Operado

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	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$27	\$3,303
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$2,385	\$293,341
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

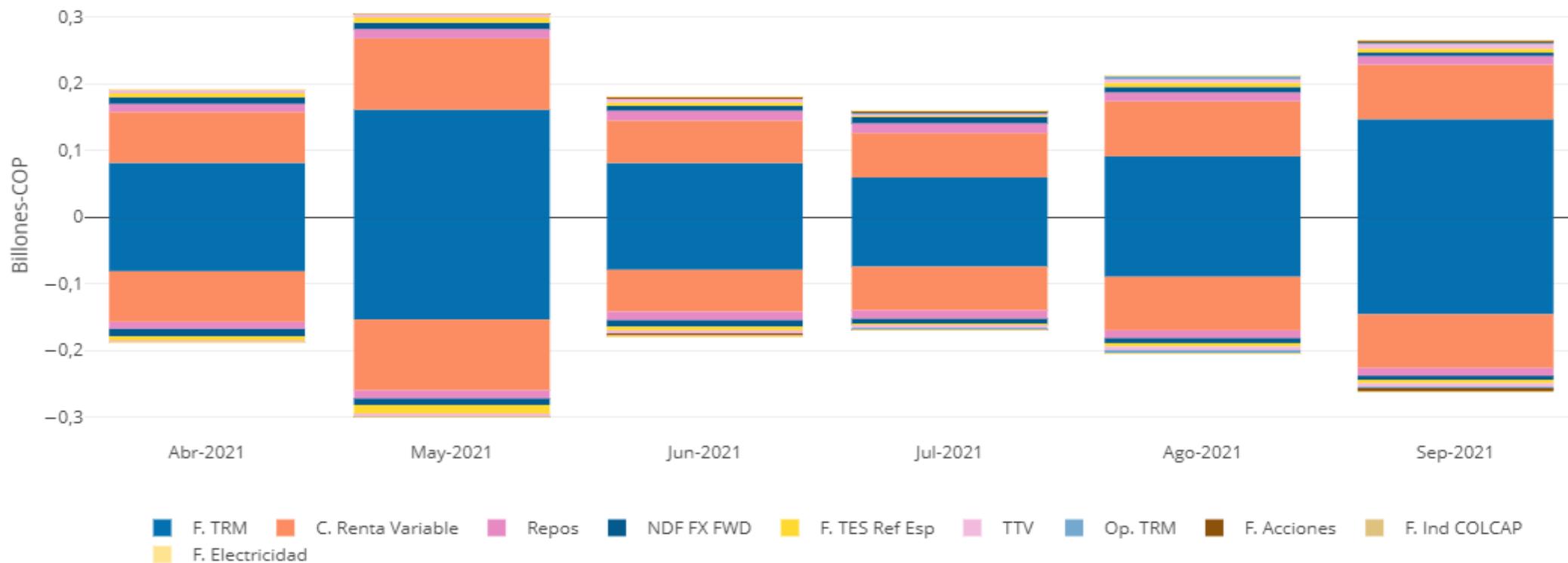
Posición Propia ▼



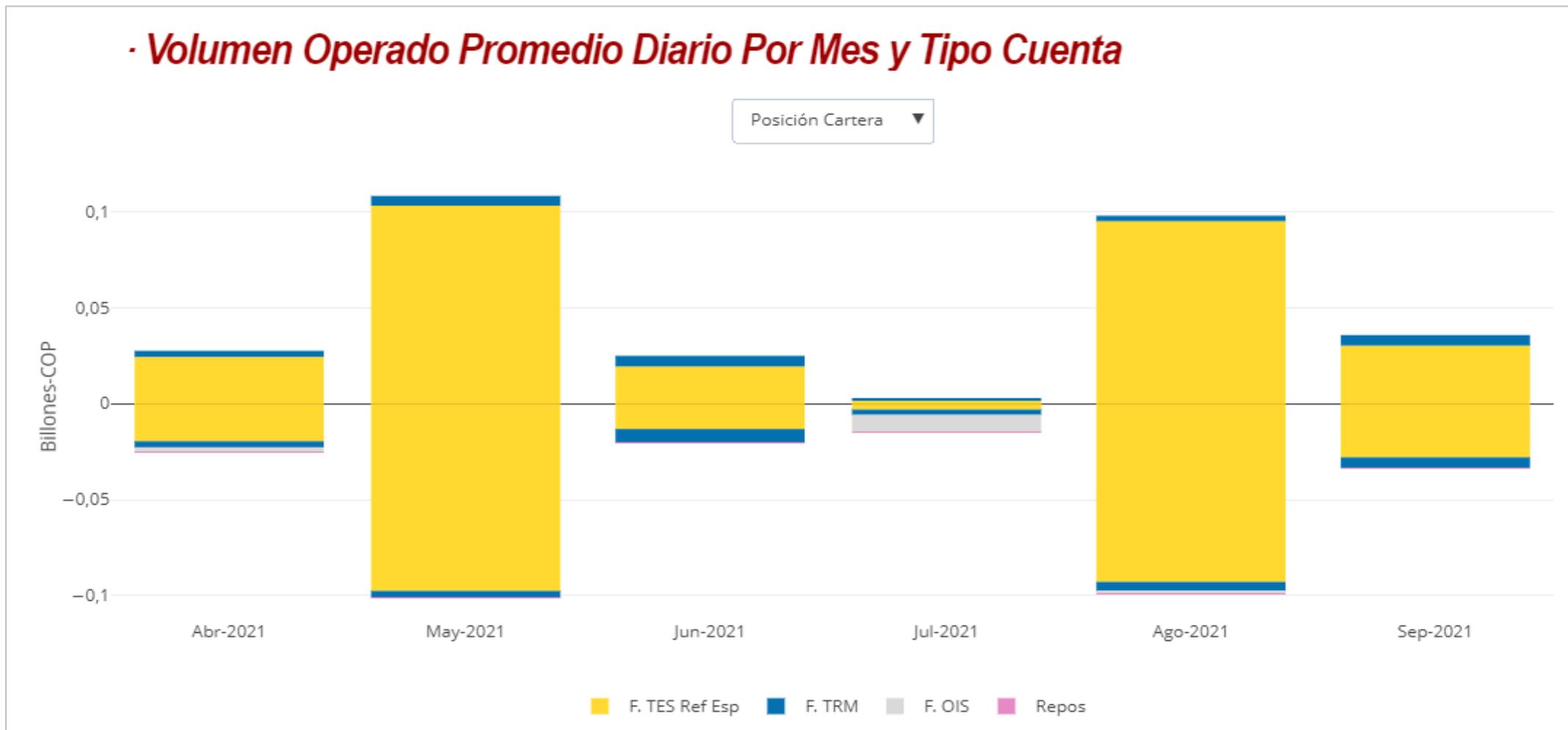
Informe de la Administración

- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

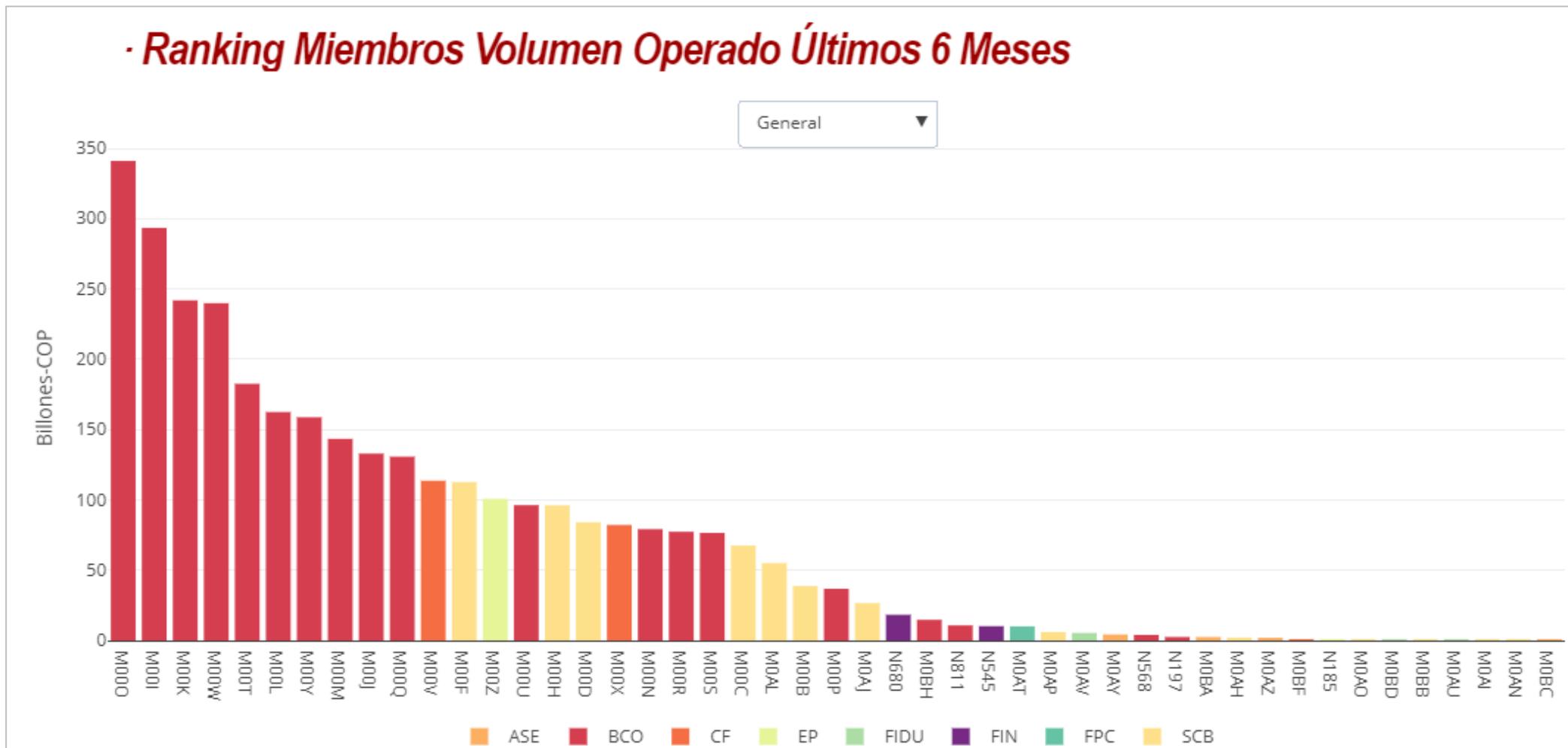
Posición Terceros ▼



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%	\$82,955,411	\$76,604,439	\$68,950,068
Derivados	TRM	NDF FX FWD	42.96%	\$35,641,161	\$32,985,478	\$30,130,249
Derivados	OIS	OIS IBR	17.14%	\$14,220,340	\$13,658,459	\$10,893,983
Renta Fija	TES	Simultaneas	16.98%	\$14,083,393	\$11,237,054	\$11,148,656
Swaps	OIS LP	OIS LP	7.07%	\$5,861,000	\$5,605,182	\$4,416,740
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	5.82%	\$4,826,156	\$4,790,724	\$4,662,862
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	3.67%	\$3,047,407	\$2,968,838	\$2,732,056
Derivados	TRM	F. TRM	2.72%	\$2,260,146	\$2,283,337	\$2,173,739
Derivados	OIS	F. OIS	1.62%	\$1,346,630	\$1,379,617	\$1,442,657

Informe de la Administración

- Posición Abierta

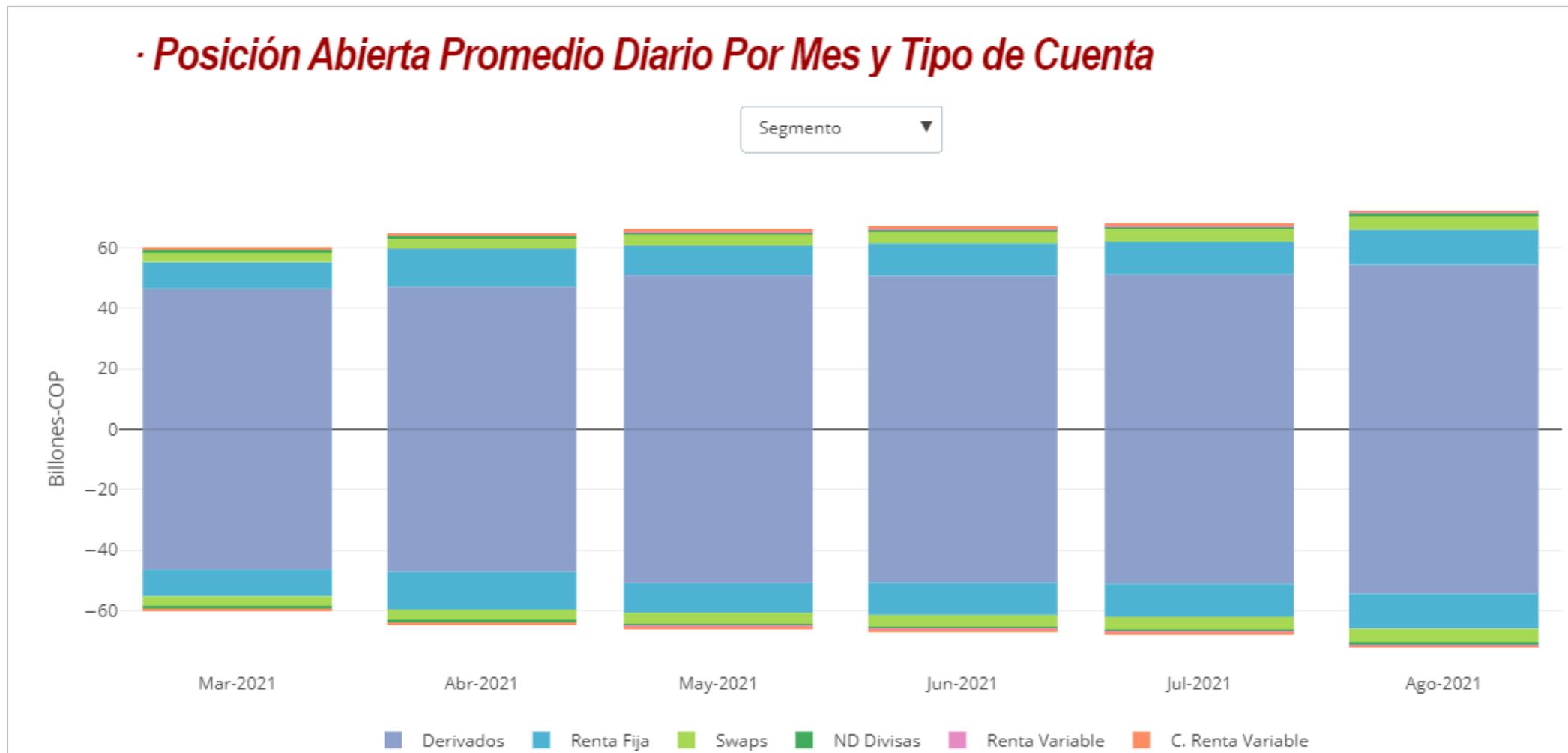
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	0.89%	\$739,132	\$772,651	\$622,473
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.62%	\$514,438	\$501,406	\$425,044
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.20%	\$161,814	\$144,891	\$45,278
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.19%	\$158,522	\$179,473	\$166,316
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.04%	\$30,640	\$30,197	\$28,987
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.03%	\$20,930	\$22,533	\$15,507
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.02%	\$20,518	\$20,820	\$19,181
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.02%	\$19,970	\$19,991	\$18,497
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$2,418	\$2,374	\$3,361

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 T2	0.00%	\$796	\$1,412	\$4,059
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$423

Informe de la Administración



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