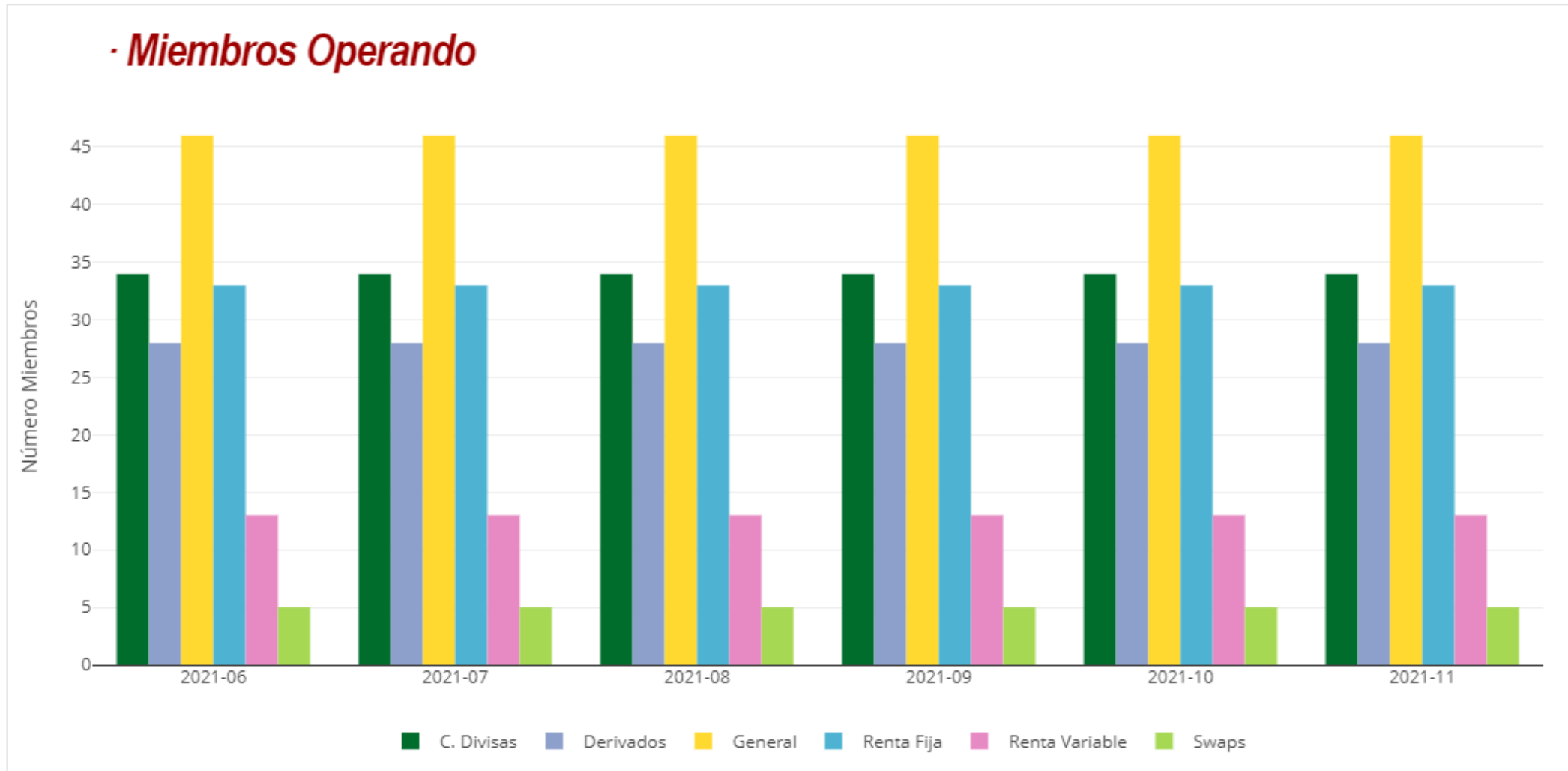




Evolución de Mercado

Noviembre 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%	\$15,508,561	\$14,390,002	\$287,800,034	\$13,598,950	\$1,672,670,823
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	38.83%	\$6,022,284	\$5,631,720	\$112,634,399	\$4,931,890	\$606,622,457
Renta Fija	TES	Simultaneas	34.22%	\$5,307,455	\$5,024,467	\$100,489,335	\$5,444,956	\$669,729,631
Derivados	TRM	NDF FX FWD	13.91%	\$2,158,014	\$2,055,657	\$41,113,142	\$1,709,263	\$210,239,305
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.75%	\$737,064	\$857,170	\$17,143,392	\$762,819	\$93,826,770
Derivados	OIS	OIS IBR	3.17%	\$491,298	\$180,528	\$3,610,568	\$141,914	\$17,455,397
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	2.41%	\$373,975	\$109,763	\$2,195,255	\$97,003	\$11,931,308
Derivados	TRM	F. TRM	1.34%	\$208,465	\$237,797	\$4,755,945	\$214,049	\$26,328,088
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.60%	\$92,601	\$92,593	\$1,851,865	\$92,454	\$11,371,851

Informe de la Administración

- Volumen Operado

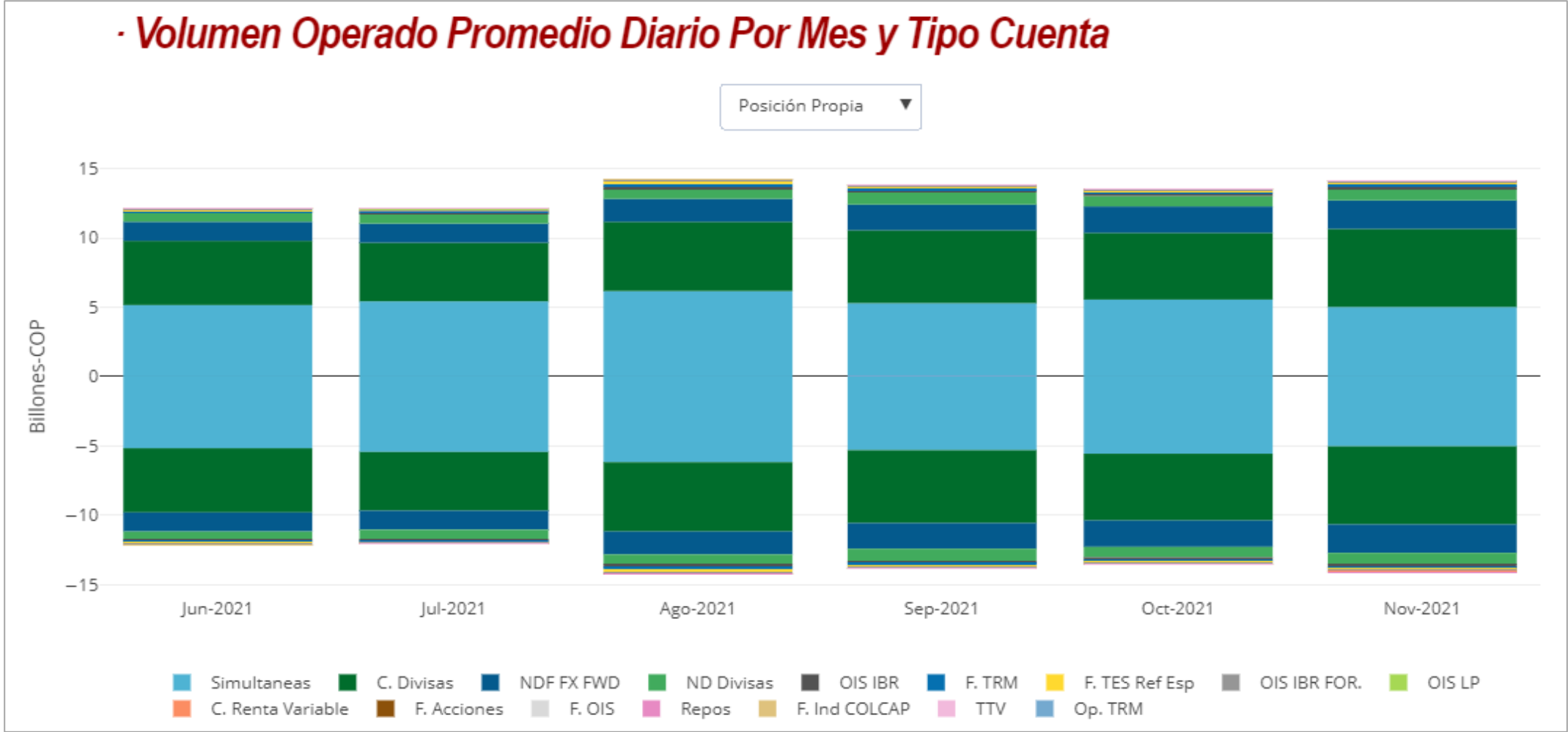
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.39%	\$60,312	\$156,410	\$3,128,208	\$151,304	\$18,610,426
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.19%	\$30,000	\$16,350	\$327,000	\$20,882	\$2,568,500
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.06%	\$8,934	\$1,816	\$36,314	\$4,069	\$500,444
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.06%	\$8,656	\$16,981	\$339,627	\$14,130	\$1,738,040
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.02%	\$3,669	\$978	\$19,558	\$1,767	\$217,374
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.02%	\$3,638	\$335	\$6,694	\$807	\$99,244
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$2,194	\$6,600	\$131,997	\$6,669	\$820,307
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$18	\$2,174
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$417	\$8,340	\$928	\$114,139

Informe de la Administración

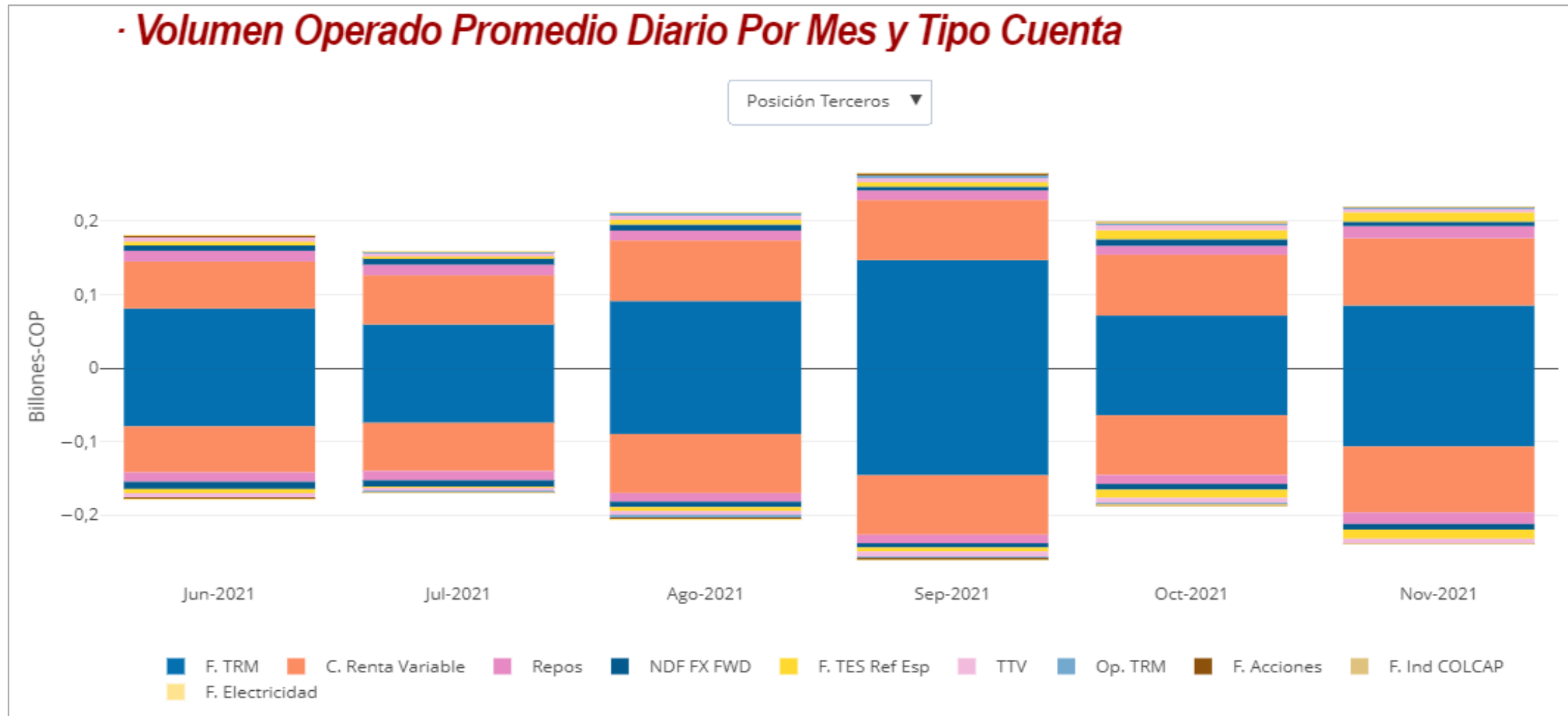
- Volumen Operado

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	\$272	\$5,431	\$2,002	\$246,240
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$148	\$2,964	\$1,598	\$196,545
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$428	\$52,583

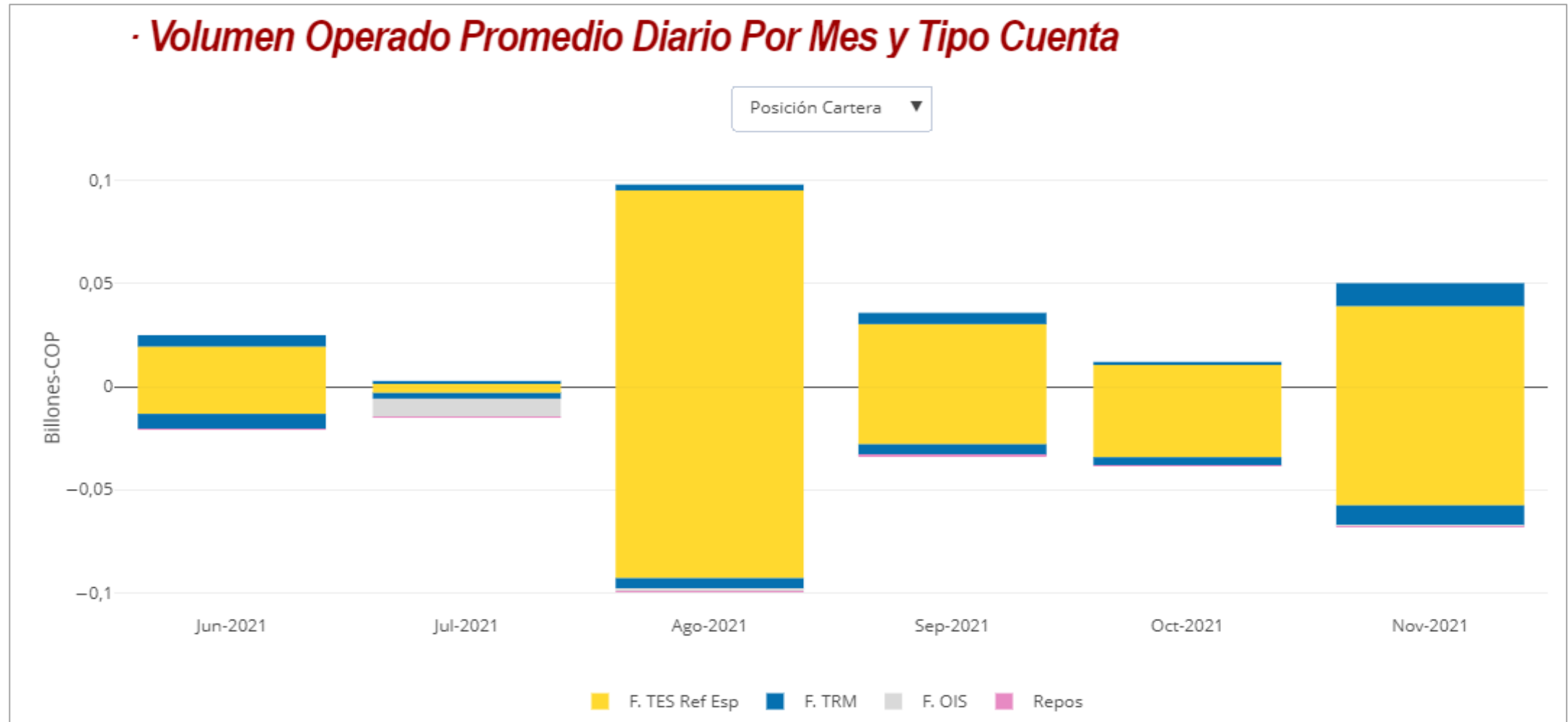
Informe de la Administración



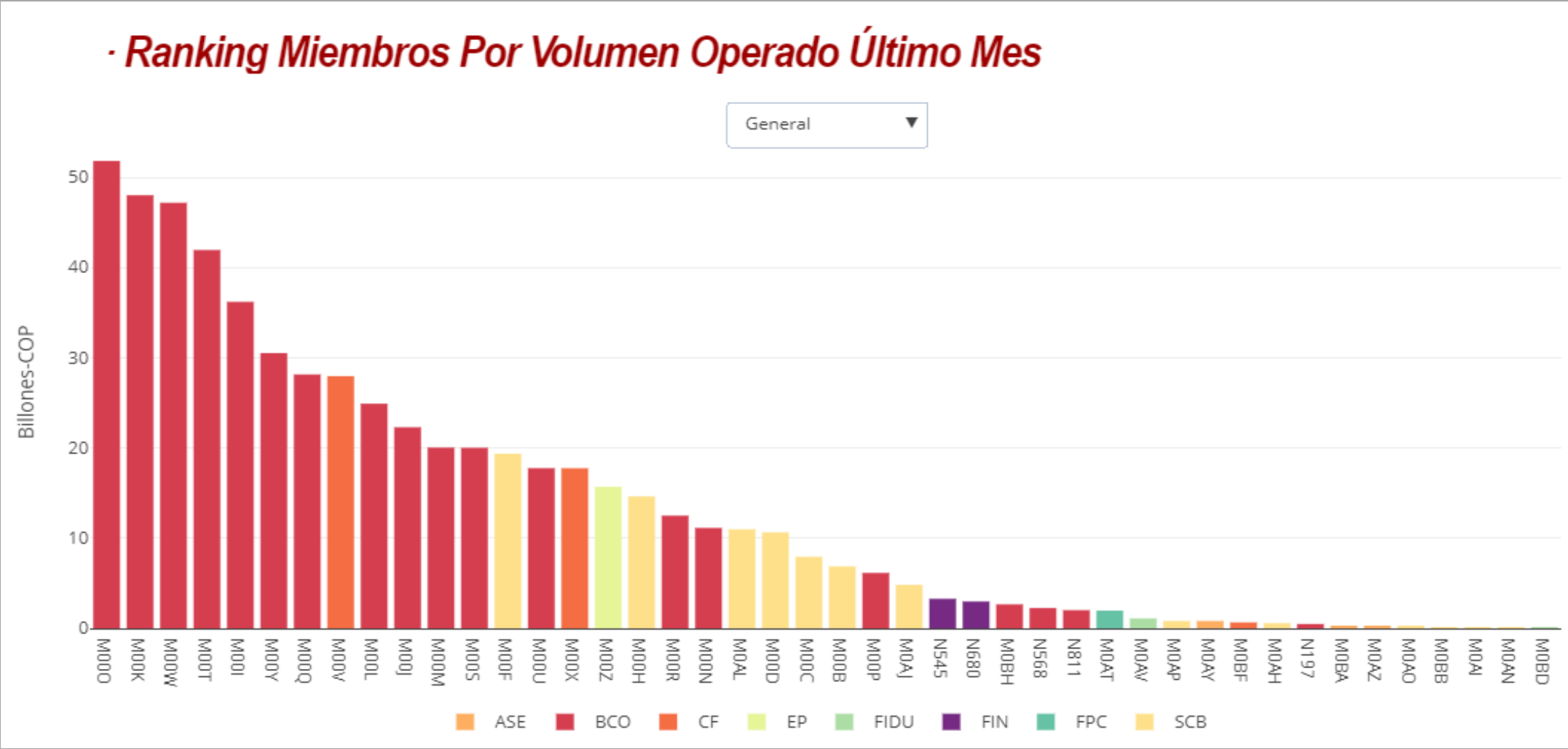
Informe de la Administración



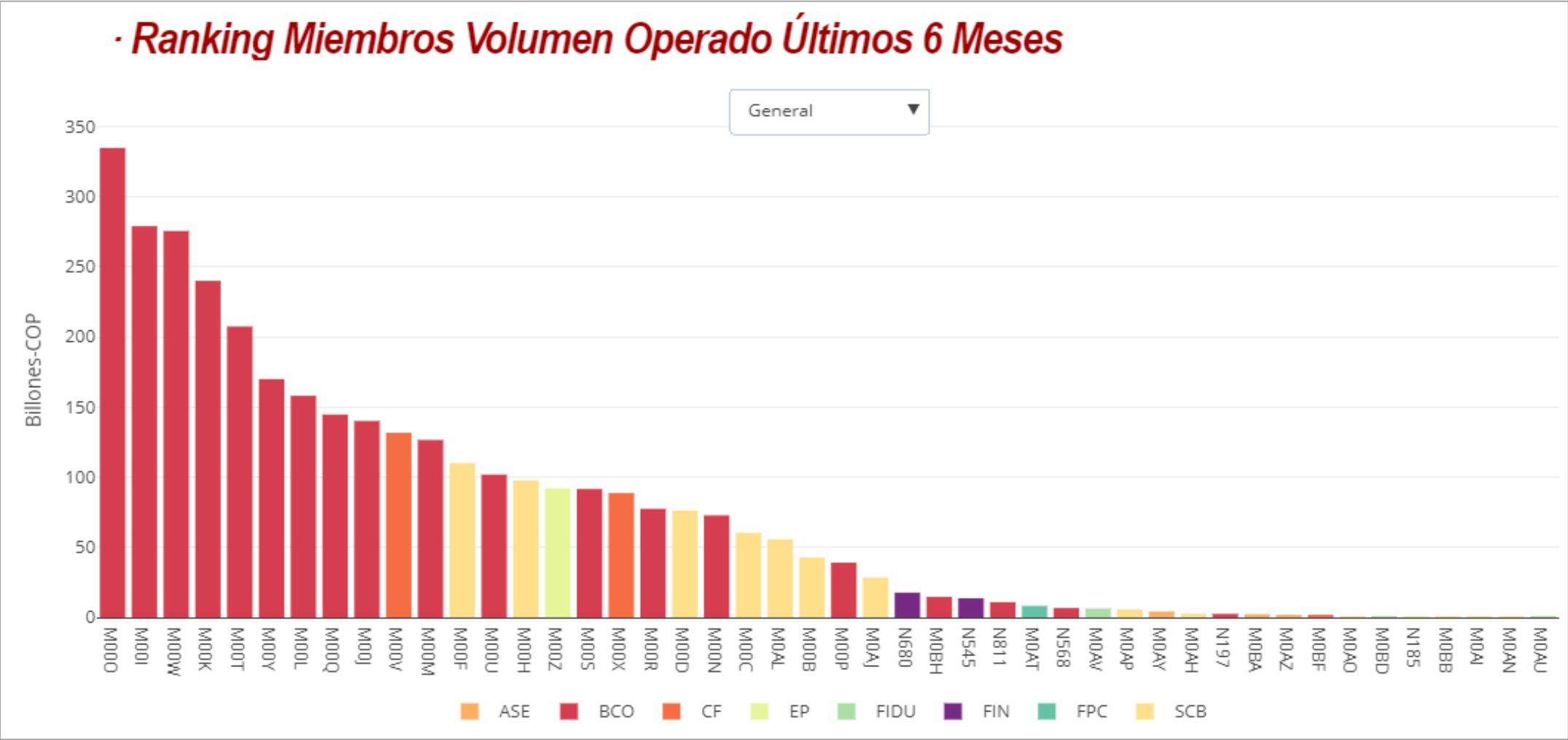
Informe de la Administración



Informe de la Administración



Informe de la Administración



Informe de la Administración

- Posición Abierta

Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Consolidado	Consolidado	Consolidado	\$94,033,217	\$94,033,209	\$86,291,021	\$86,291,020	\$75,066,838	\$75,066,838
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$43,293,194	\$43,293,194	\$41,444,421	\$41,444,421	\$33,712,241	\$33,712,241
Derivados	OIS	OIS IBR	\$18,914,979	\$18,914,979	\$18,574,803	\$18,574,803	\$13,298,519	\$13,298,519
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$12,914,630	\$12,914,630	\$8,131,486	\$8,131,486	\$10,415,524	\$10,415,524
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$6,319,000	\$6,319,000	\$6,114,900	\$6,114,900	\$5,134,927	\$5,134,927
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	\$4,740,806	\$4,740,806	\$4,759,886	\$4,759,886	\$4,719,985	\$4,719,985
Derivados	TRM	F. TRM	\$2,578,271	\$2,578,271	\$2,283,942	\$2,283,942	\$2,221,166	\$2,221,166
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	\$2,032,918	\$2,032,918	\$1,915,086	\$1,915,086	\$2,631,391	\$2,631,391
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,230,035	\$1,230,035	\$1,306,631	\$1,306,631	\$1,402,996	\$1,402,996

Informe de la Administración

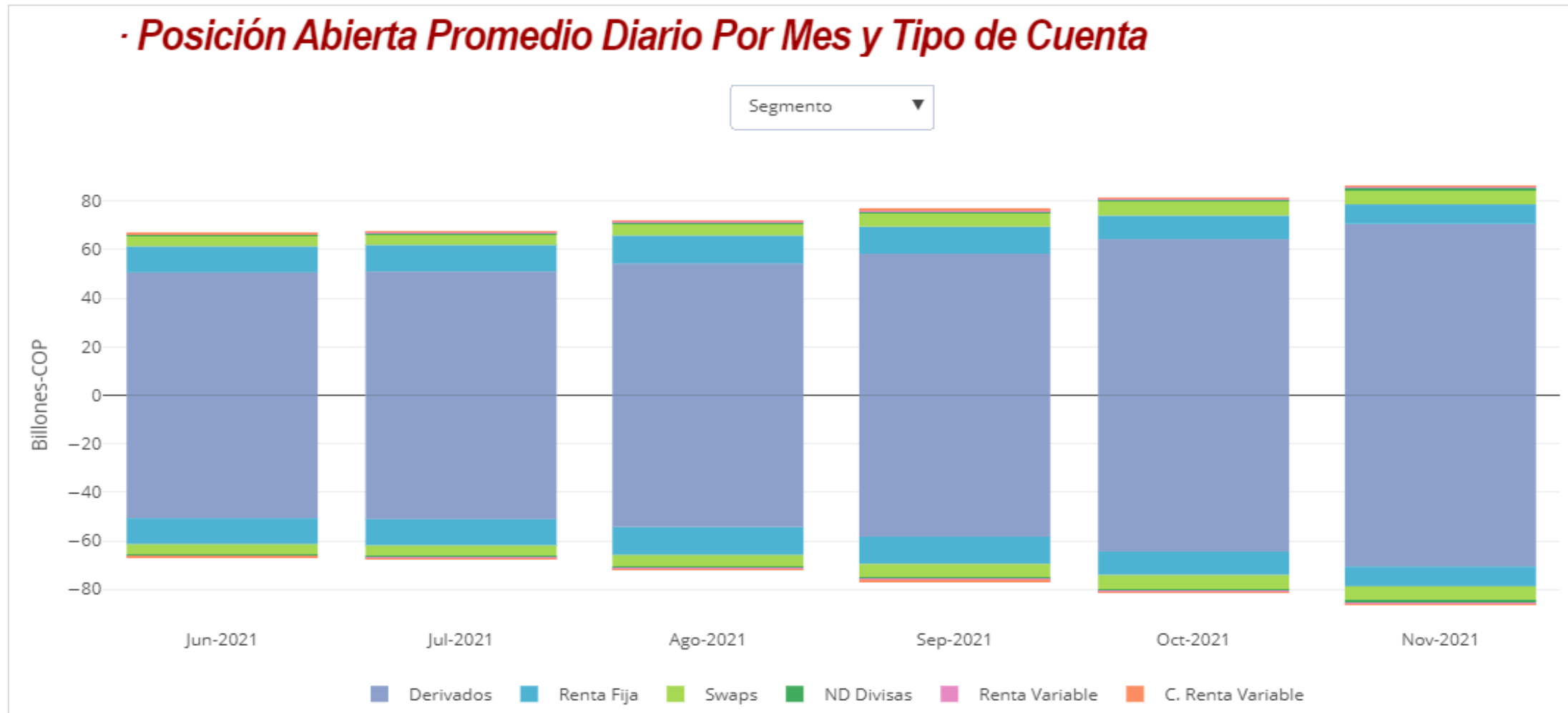
- Posición Abierta								
Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	\$695,946	\$695,946	\$750,590	\$750,590	\$675,446	\$675,446
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$551,838	\$551,838	\$531,013	\$531,013	\$489,067	\$489,067
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$451,305	\$451,297	\$172,979	\$172,978	\$160,437	\$160,437
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$213,468	\$213,468	\$209,069	\$209,069	\$106,598	\$106,598
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$33,082	\$33,082	\$33,544	\$33,544	\$31,510	\$31,510
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$21,679	\$21,679	\$23,823	\$23,823	\$21,714	\$21,714
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$18,968	\$18,968	\$17,832	\$17,832	\$18,788	\$18,788
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$12,037	\$12,037	\$17,022	\$17,022	\$19,290	\$19,290
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	\$8,934	\$8,934	\$1,816	\$1,816	\$3,883	\$3,883

Informe de la Administración

- *Posición Abierta*

Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,126	\$2,126	\$2,178	\$2,178	\$2,929	\$2,929
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	\$0	\$0	\$0	\$0	\$428	\$428

Informe de la Administración



Informe de la Administración

<i>- Posición Abierta Swaps Por Rango de Años</i>			
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	\$1,167,000	\$1,167,000	\$861,691
1Y-2Y	\$1,858,500	\$1,696,900	\$1,475,431
2Y-5Y	\$2,496,000	\$2,481,350	\$2,099,589
5Y-10Y	\$797,500	\$769,650	\$698,215
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM