



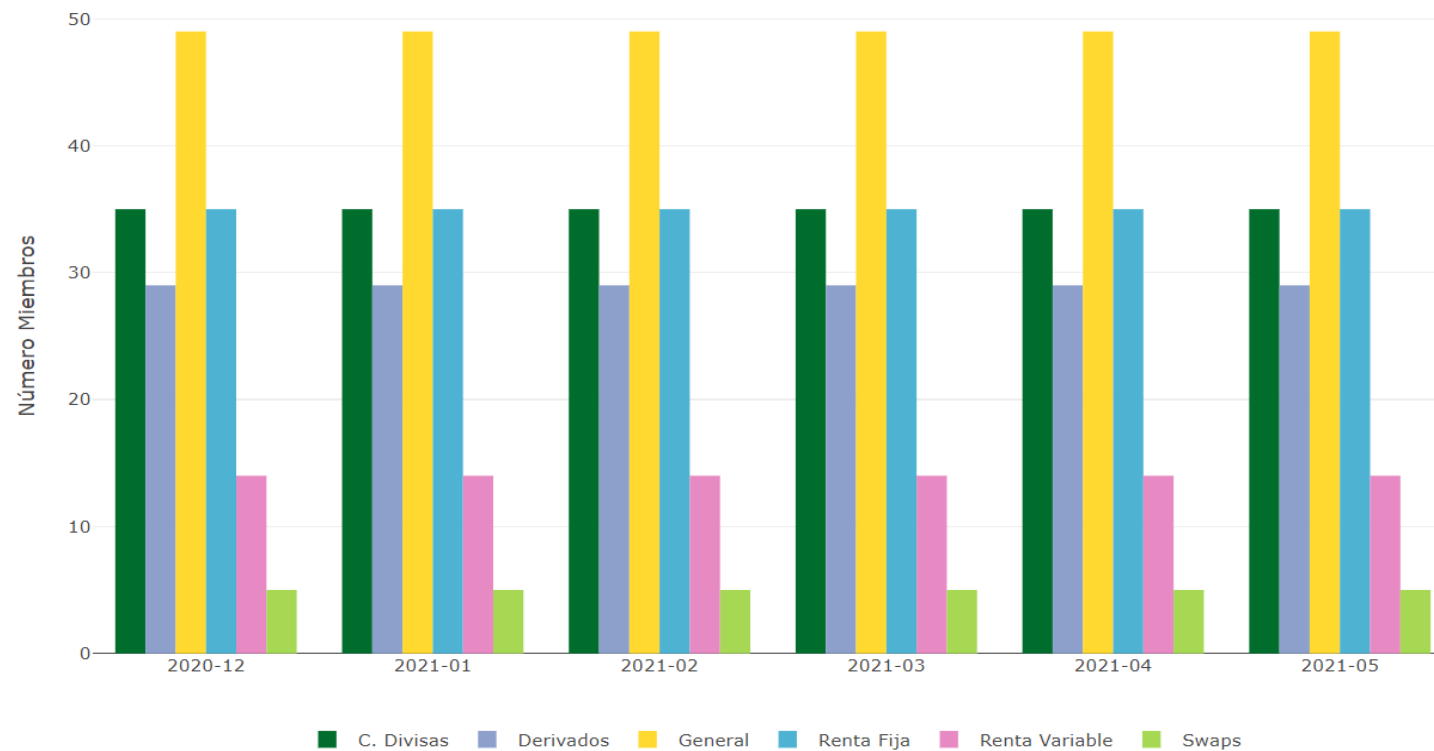
Evolución de Mercado

Junio 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**

- Evolución Número de Miembros



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**
 - Volumen Operado

	Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Diario M-COP	Volumen Promedio M-COP	Volumen Acumulado M-COP
	Renta Fija	TES	Simultaneas	68.90%	\$3,978,542	\$4,488,546	\$89,770,914
	ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	20.69%	\$1,194,838	\$548,585	\$10,971,699
	Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	5.03%	\$290,234	\$385,068	\$7,701,369
	Derivados	TRM	NDF FX FWD	2.32%	\$133,842	\$1,903,189	\$38,063,784
	Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	1.60%	\$92,365	\$92,366	\$1,847,320
	C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.64%	\$36,690	\$127,735	\$2,554,706
	Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.43%	\$25,005	\$4,440	\$88,809
	Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.30%	\$17,384	\$13,981	\$279,623

Registros del 1 al 8 de un total de 19

Anterior

1

2

3

Siguiente

Hasta el 31 de Mayo de 2021

3

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**
 - Volumen Operado

	Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Diario M-COP	Volumen Promedio M-COP	Volumen Acumulado M-COP
	Derivados	TRM	F. TRM	0.07%	\$4,268	\$334,329	\$6,686,575
	ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.01%	\$757	\$4,300	\$85,991
	Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$104	\$574	\$11,484
	C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	0.00%	\$0	\$4,106,200	\$82,124,009
	Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$0	\$953	\$19,065
	Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$0	\$0
	Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$714	\$14,276
	Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$0	\$0

Registros del 9 al 16 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiente

Hasta el 31 de Mayo de 2021

4

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**
 - Volumen Operado

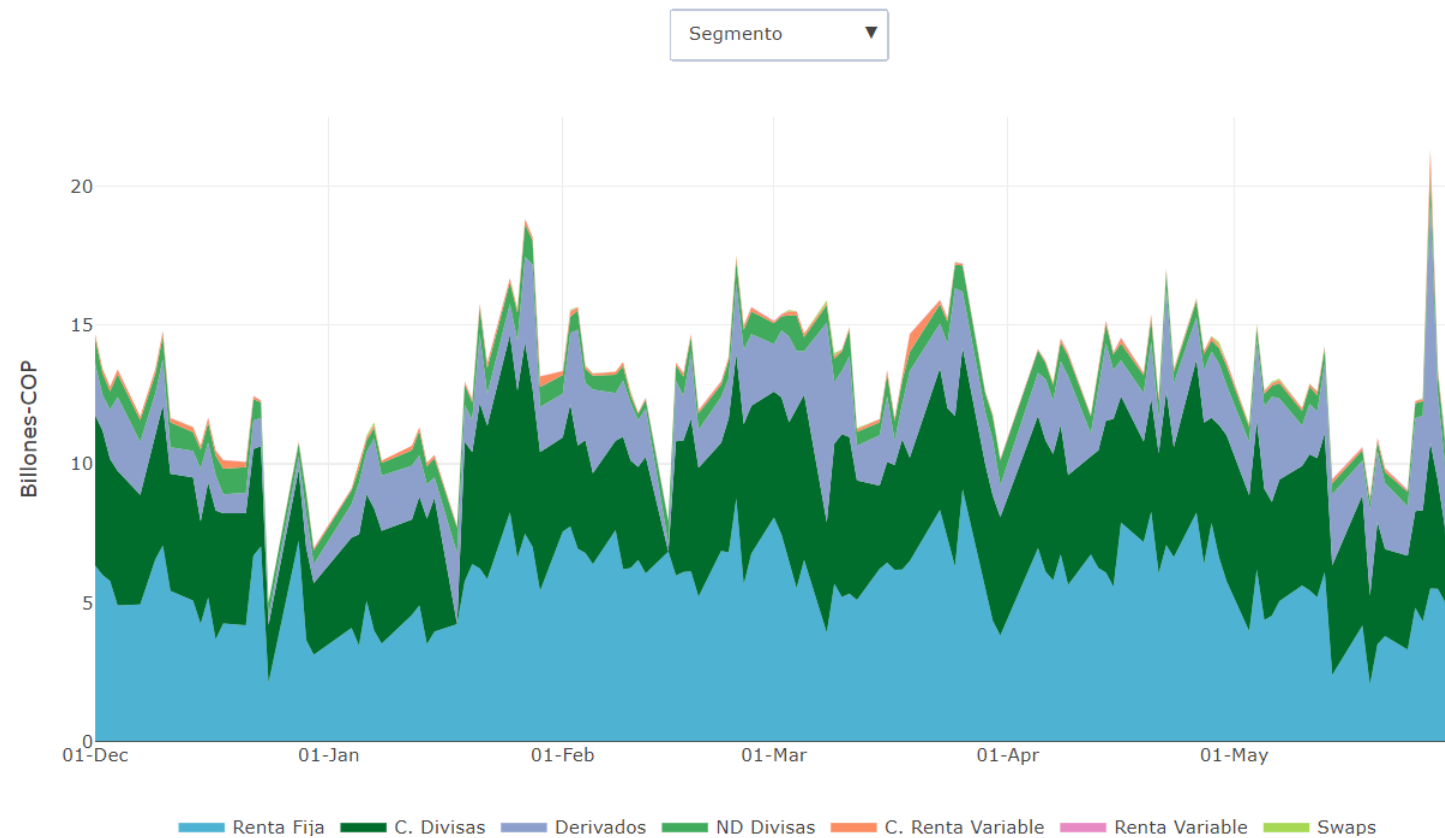
	Segmento ▾	Tipo Producto ▾	Producto ▾	% ▾	Volumen Diario M-COP ▾	Volumen Promedio M-COP ▾	Volumen Acumulado M-COP ▾
	Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$16,353	\$327,058
	Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$76	\$1,530
	Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$10,900	\$218,000

Registros del 17 al 19 de un total de 19

Anterior 1 2 3 Siguiente

Informe de la Administración

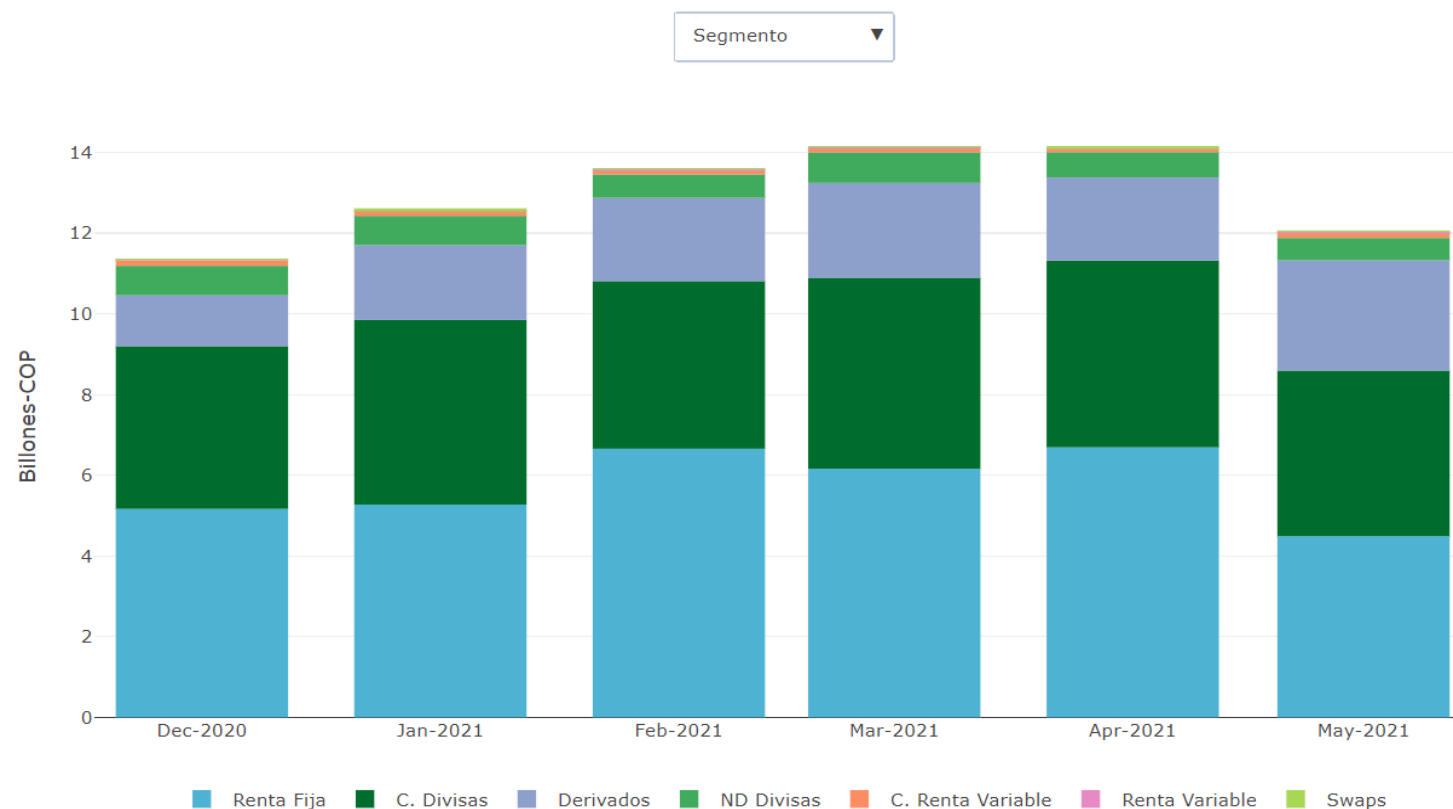
- **Gestión de Operaciones**
 - Volumen Operado



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

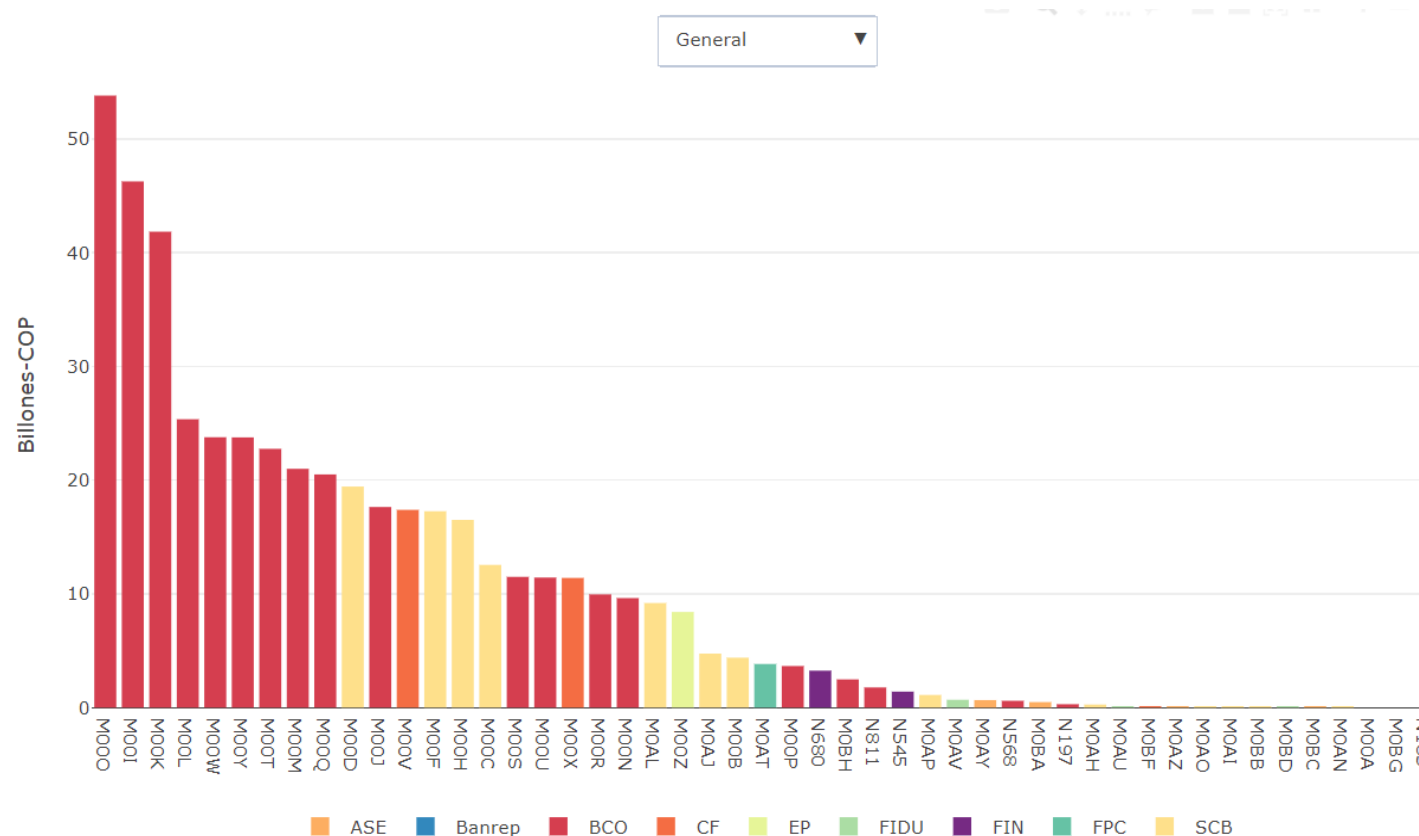
- **Gestión de Operaciones**
 - Volumen Operado diario promedio mensual



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

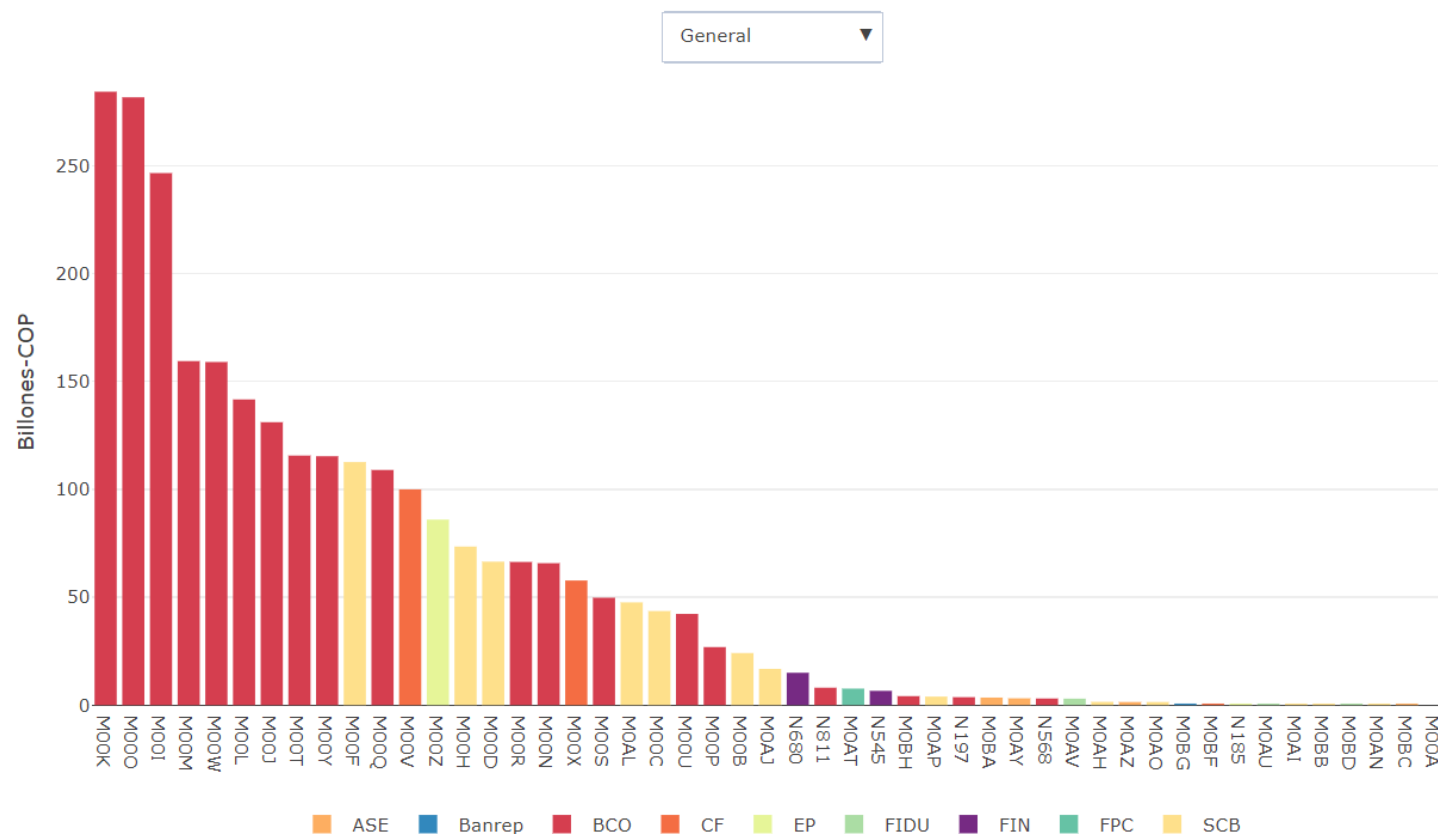
- **Gestión de Operaciones**
 - Ranking Volumen Operado mes



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

- **Gestión de Operaciones**
 - Ranking Volumen Operado año



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

- **Posición Abierta**

- Posición Abierta por Producto

	Segmento ▴ ▾	Tipo Producto ▴ ▾	Producto ▴ ▾	% ▴ ▾	Posición Abierta Diaria M-COP ▴ ▾	Posición Abierta Promedio M-COP ▴ ▾
	Derivados	TRM	NDF FX FWD	44.94%	\$32,879,018	\$30,051,447
	Renta Fija	TES	Simultaneas	19.11%	\$13,979,836	\$9,823,048
	Derivados	OIS	OIS IBR	13.41%	\$9,812,349	\$9,973,523
	Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	6.43%	\$4,705,246	\$4,642,241
	Swaps	OIS LP	OIS LP	5.51%	\$4,032,500	\$3,984,700
	Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	3.92%	\$2,864,997	\$2,607,049
	Derivados	TRM	F. TRM	2.79%	\$2,040,076	\$2,079,007
	Derivados	OIS	F. OIS	1.90%	\$1,388,316	\$1,421,275

Registros del 1 al 8 de un total de 18

Anterior

1

2

3

Siguiente

Hasta el 31 de Mayo de 2021

10

Informe de la Administración

- **Posición Abierta**

- Posición Abierta por Producto

	Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Diaria M-COP	Posición Abierta Promedio M-COP
	ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	1.13%	\$826,299	\$483,483
	Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.52%	\$378,650	\$345,371
	C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.20%	\$149,271	\$225,202
	Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.04%	\$32,250	\$11,201
	Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.04%	\$27,012	\$24,996
	Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.02%	\$16,964	\$15,360
	Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.02%	\$15,394	\$16,588
	Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$3,374	\$3,531

Registros del 9 al 16 de un total de 18

Anterior 1 2 3 Siguiente

Informe de la Administración

- **Posición Abierta**

- Posición Abierta por Producto

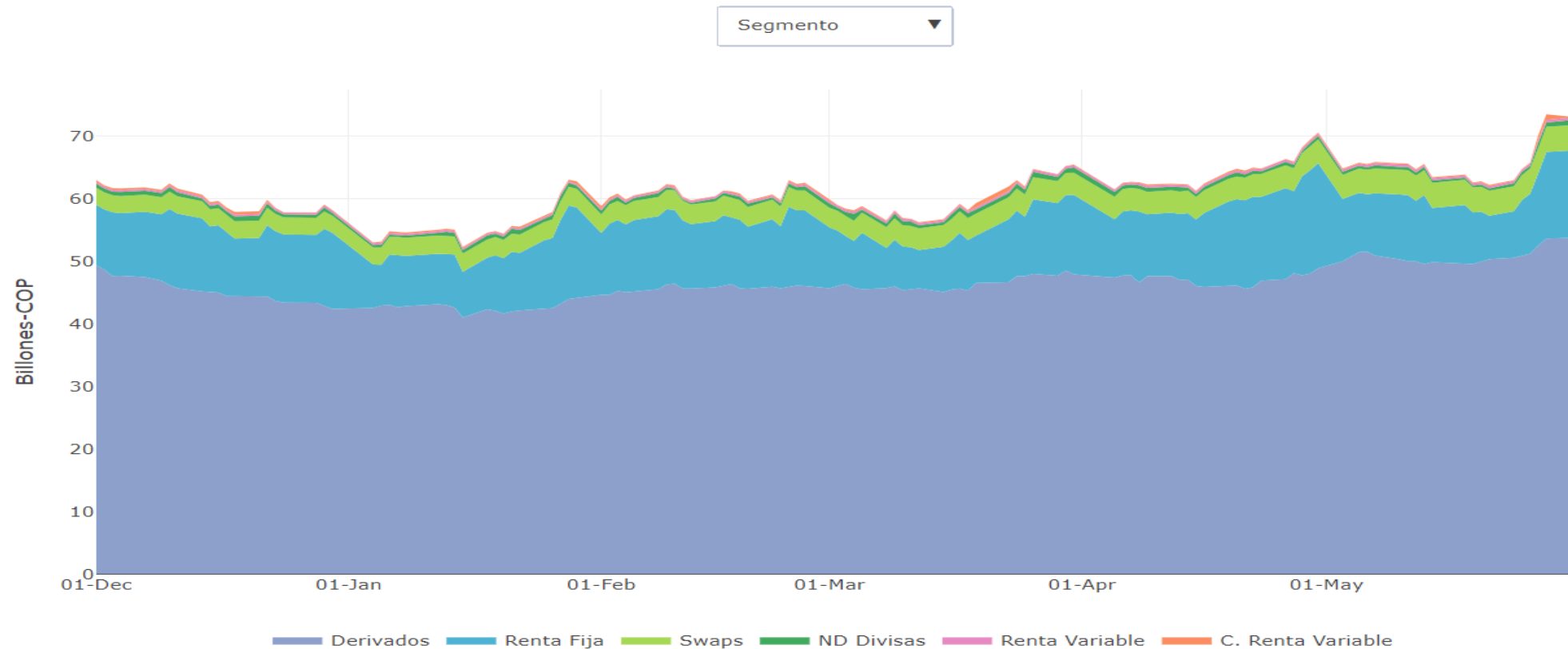
	Segmento ▴ ▾	Tipo Producto ▴ ▾	Producto ▴ ▾	% ▴ ▾	Posición Abierta Diaria M-COP ▴ ▾	Posición Abierta Promedio M-COP ▴ ▾
	Derivados	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$2,046	\$2,392
	ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$326	\$3,715

Registros del 17 al 18 de un total de 18

Anterior 1 2 3 Siguiente

Informe de la Administración

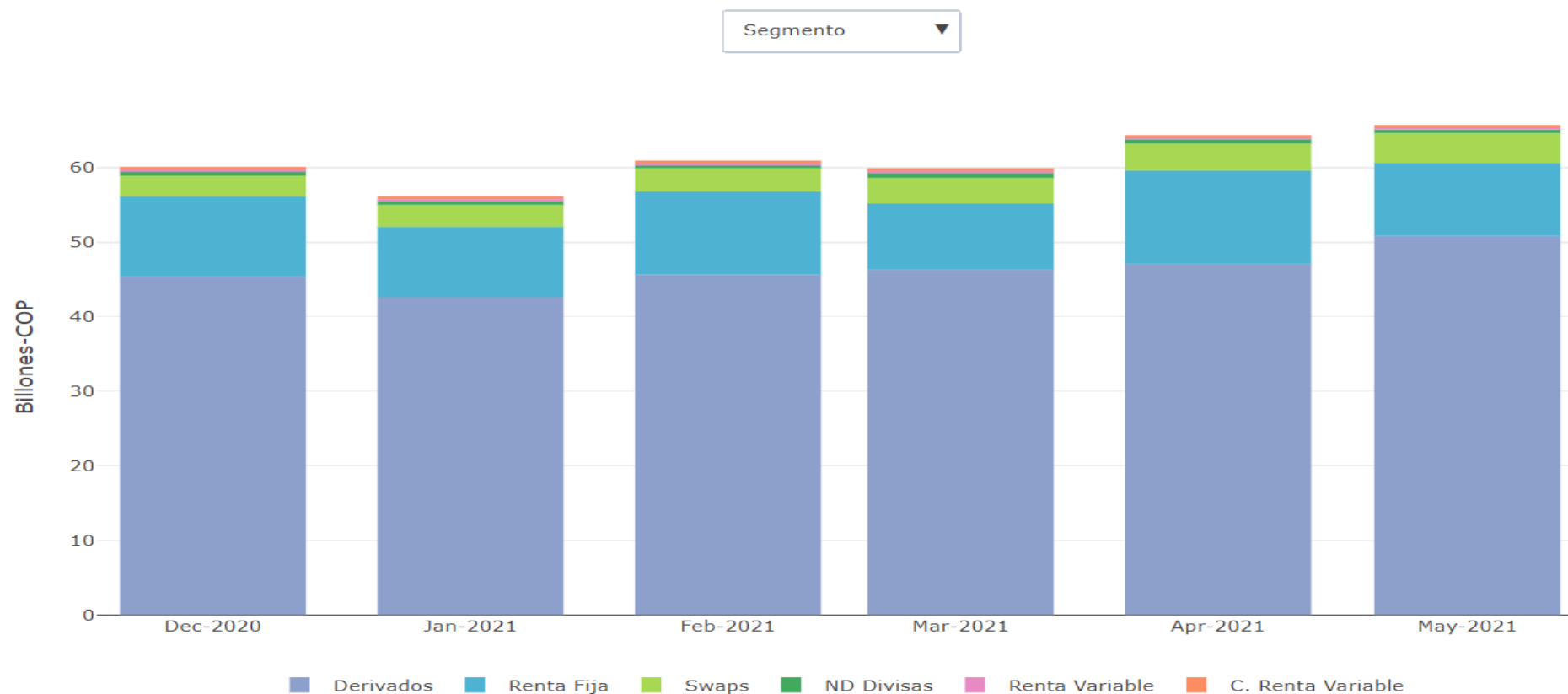
- **Posición Abierta**
 - Evolución Posición Abierta



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

- **Posición Abierta**
 - Posición Abierta diaria promedio mensual



Hasta el 31 de Mayo de 2021

Informe de la Administración

- **Posición Abierta**
 - Posición Abierta SWAPS por nodo

	Rango Años	Posición Abierta Diaria M-COP	Posición Abierta Promedio M-COP
	0Y-1Y	\$667,000	\$623,750
	1Y-2Y	\$1,121,000	\$1,071,700
	2Y-5Y	\$1,607,000	\$1,653,400
	5Y-10Y	\$637,500	\$635,850
	10Y-15Y	\$0	\$0



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM