

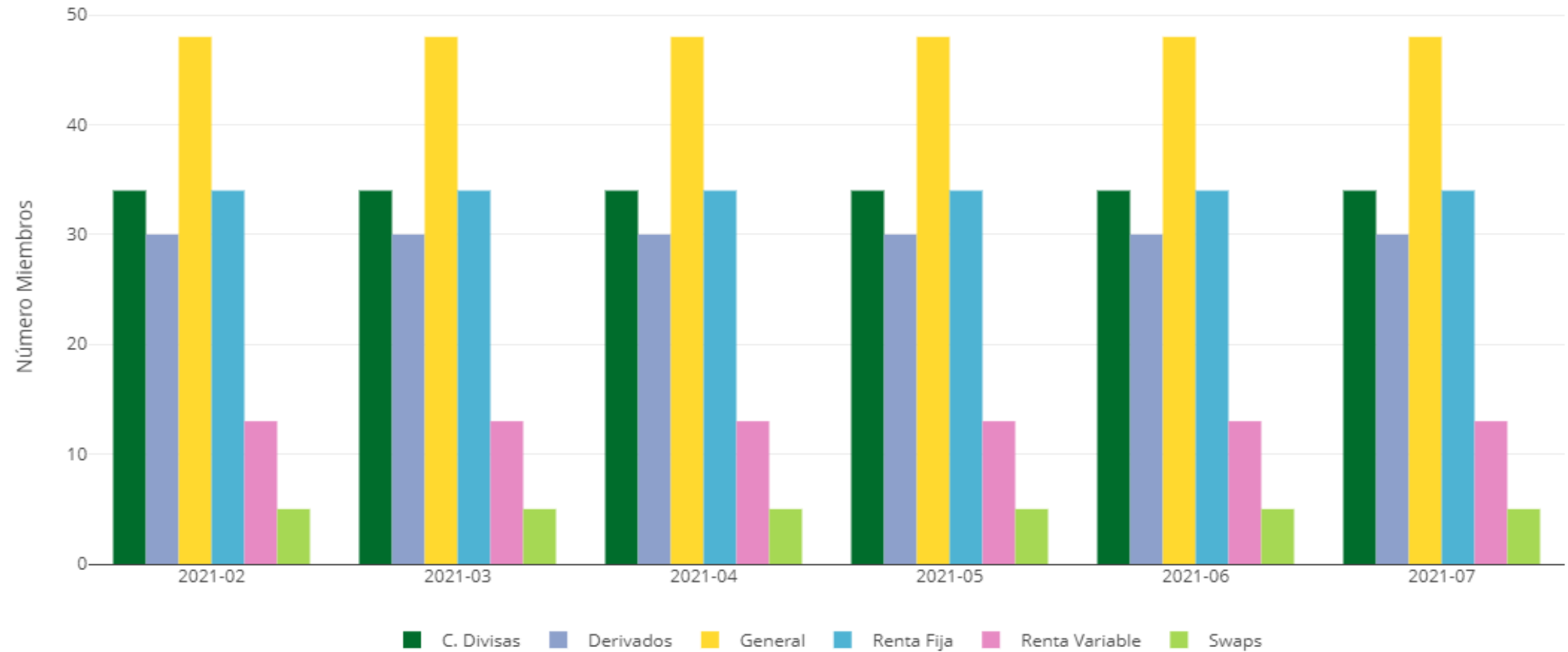


Evolución de Mercado

Julio 2021

Informe de la Administración

- Miembros Operando



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%	\$11,700,943	\$12,275,148	\$245,502,959	\$13,102,951	\$1,598,560,079
Renta Fija	TES	Simultaneas	45.39%	\$5,310,613	\$5,430,095	\$108,601,897	\$5,772,251	\$704,214,670
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	34.01%	\$3,979,209	\$4,232,795	\$84,655,895	\$4,418,777	\$539,090,833
Derivados	TRM	NDF FX FWD	7.88%	\$922,526	\$1,382,230	\$27,644,606	\$1,587,584	\$193,685,283
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	7.46%	\$872,611	\$708,739	\$14,174,773	\$641,411	\$78,252,198
Derivados	OIS	OIS IBR	2.24%	\$262,612	\$80,746	\$1,614,924	\$51,428	\$6,274,265
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.89%	\$104,643	\$62,644	\$1,252,884	\$163,748	\$19,977,242
Derivados	TRM	F. TRM	0.83%	\$97,141	\$152,932	\$3,058,630	\$232,115	\$28,317,983
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.79%	\$92,373	\$92,383	\$1,847,661	\$92,356	\$11,267,428

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
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.34%	\$39,648	\$82,109	\$1,642,178	\$101,241	\$12,351,438
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.15%	\$17,311	\$14,447	\$288,945	\$12,690	\$1,548,239
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.01%	\$1,059	\$4,564	\$91,273	\$3,822	\$466,286
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.01%	\$974	\$1,784	\$35,673	\$397	\$48,423
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.00%	\$130	\$586	\$11,721	\$1,539	\$187,771
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$62	\$2,021	\$40,423	\$3,191	\$389,317
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$31	\$478	\$9,567	\$1,086	\$132,535
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$258	\$5,163	\$734	\$89,583
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$4	\$79	\$27	\$3,298

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	\$8,665	\$173,306	\$6,187	\$754,773
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$1,518	\$30,359	\$426	\$52,014
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$16,150	\$323,000	\$11,939	\$1,456,500

Registros del 19 al 21 de un total de 21

Anterior 1 2 **3** Siguiente

*Datos del 2021-02-01 al 2021-07-30

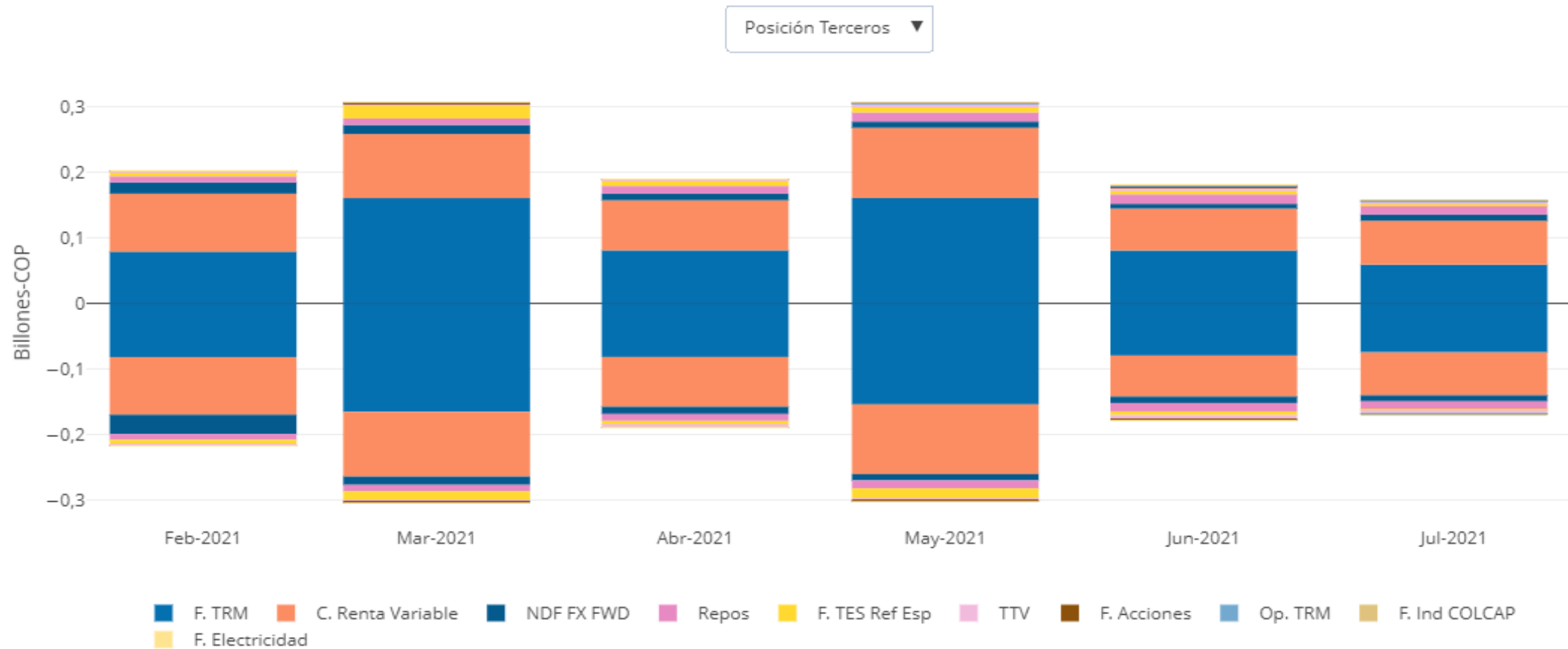
Informe de la Administración

- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta



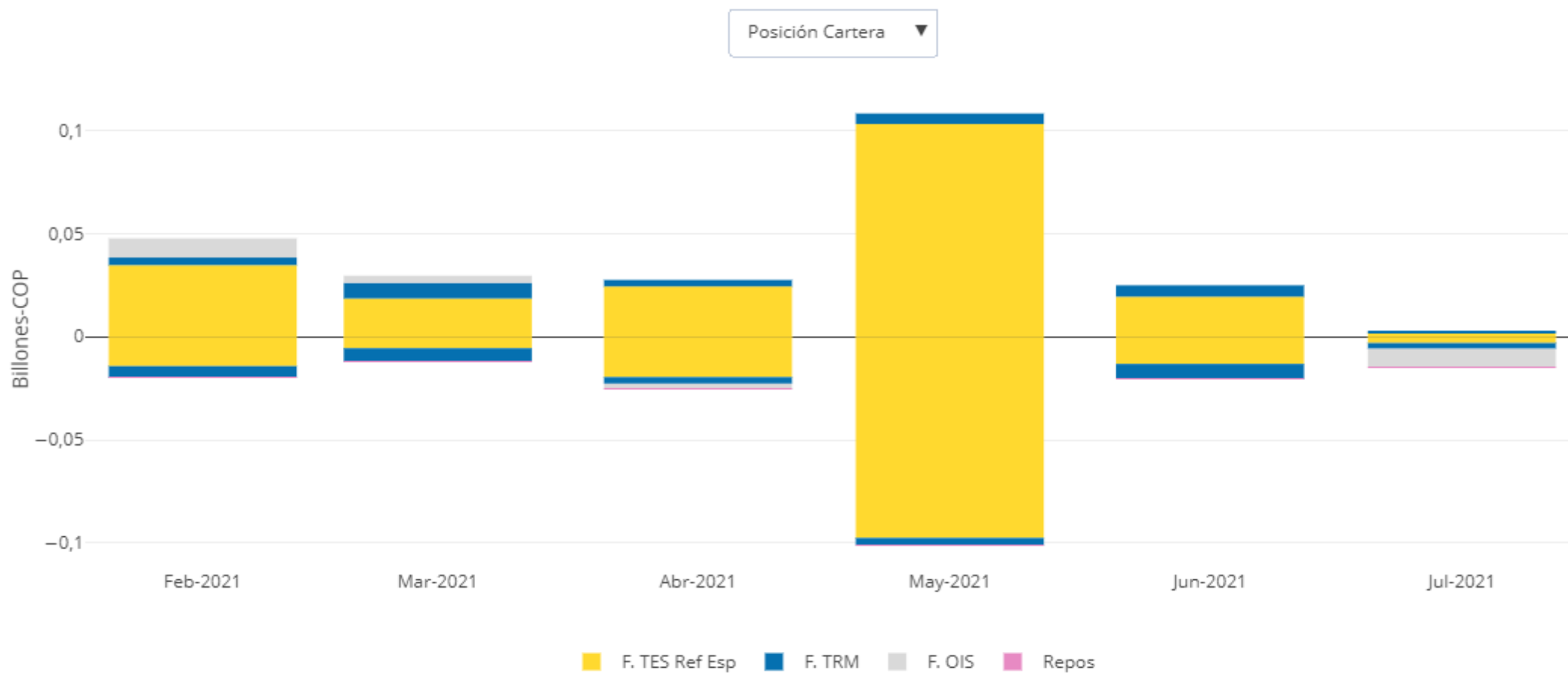
Informe de la Administración

- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta



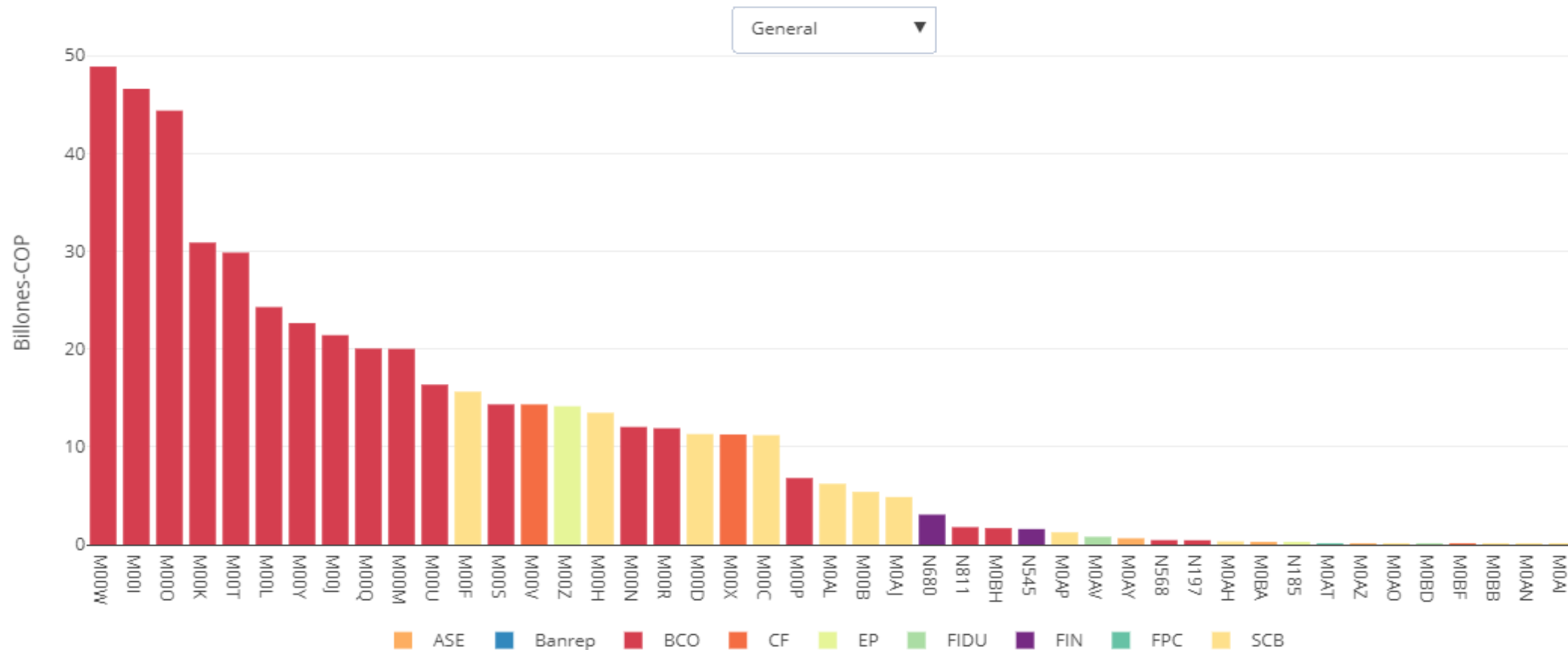
Informe de la Administración

- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta



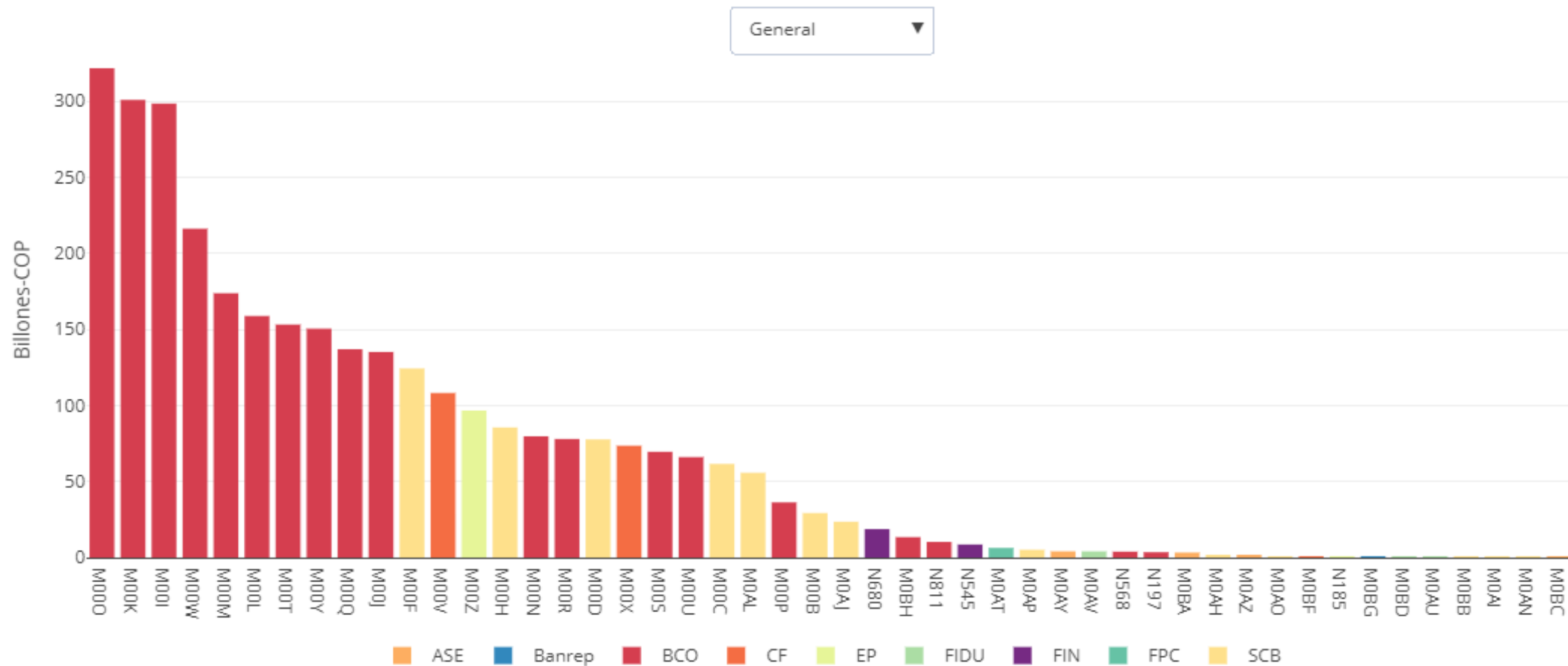
Informe de la Administración

- Ranking Miembros Por Volumen Operado Último Mes



Informe de la Administración

- Ranking Miembros Volumen Operado Últimos 6 Meses



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%	\$73,263,221	\$67,534,596	\$64,096,571
Derivados	TRM	NDF FX FWD	41.45%	\$30,366,063	\$29,855,159	\$27,861,946
Renta Fija	TES	Simultaneas	20.61%	\$15,096,635	\$10,924,419	\$10,646,008
Derivados	OIS	OIS IBR	14.46%	\$10,596,310	\$10,110,165	\$9,885,334
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	6.26%	\$4,585,436	\$4,616,522	\$4,626,293
Swaps	OIS LP	OIS LP	6.06%	\$4,439,500	\$4,297,950	\$3,751,008
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	3.83%	\$2,807,588	\$2,691,994	\$2,594,561
Derivados	TRM	F. TRM	3.12%	\$2,286,473	\$2,203,557	\$2,056,581
Derivados	OIS	F. OIS	2.14%	\$1,570,165	\$1,456,311	\$1,474,998

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	1.16%	\$852,324	\$657,258	\$577,394
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.62%	\$453,349	\$461,028	\$360,847
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.10%	\$70,605	\$141,242	\$175,414
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.06%	\$44,205	\$25,734	\$5,486
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.04%	\$32,628	\$31,072	\$27,901
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.03%	\$21,838	\$20,746	\$17,132
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.03%	\$18,914	\$19,366	\$16,965
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.02%	\$17,366	\$14,736	\$12,057
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.01%	\$3,761	\$3,919	\$3,321

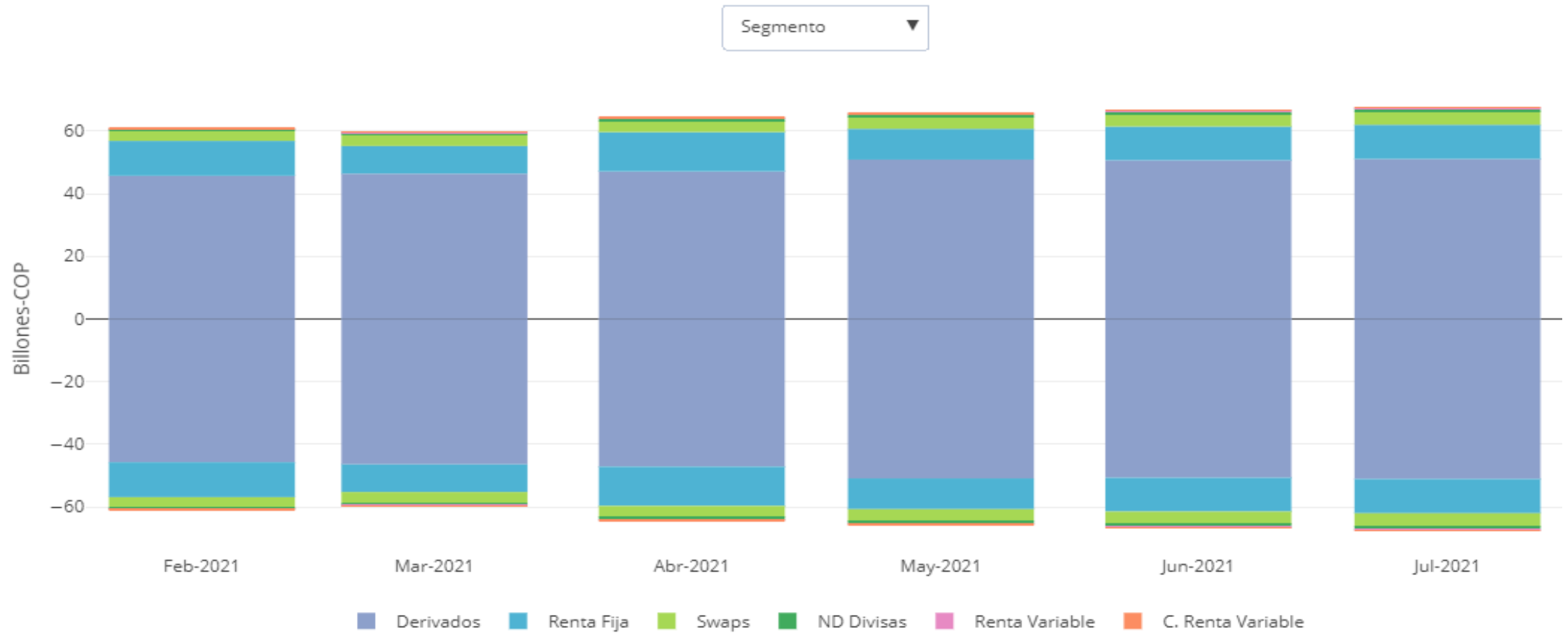
Informe de la Administración

- 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%	\$62	\$1,902	\$2,900
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$1,518	\$426

Informe de la Administración

- Posición Abierta Promedio Diario Por Mes



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	\$667,000	\$667,000	\$542,393
1Y-2Y	\$1,365,000	\$1,306,000	\$1,121,057
2Y-5Y	\$1,756,000	\$1,678,350	\$1,491,795
5Y-10Y	\$651,500	\$646,600	\$595,762
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM