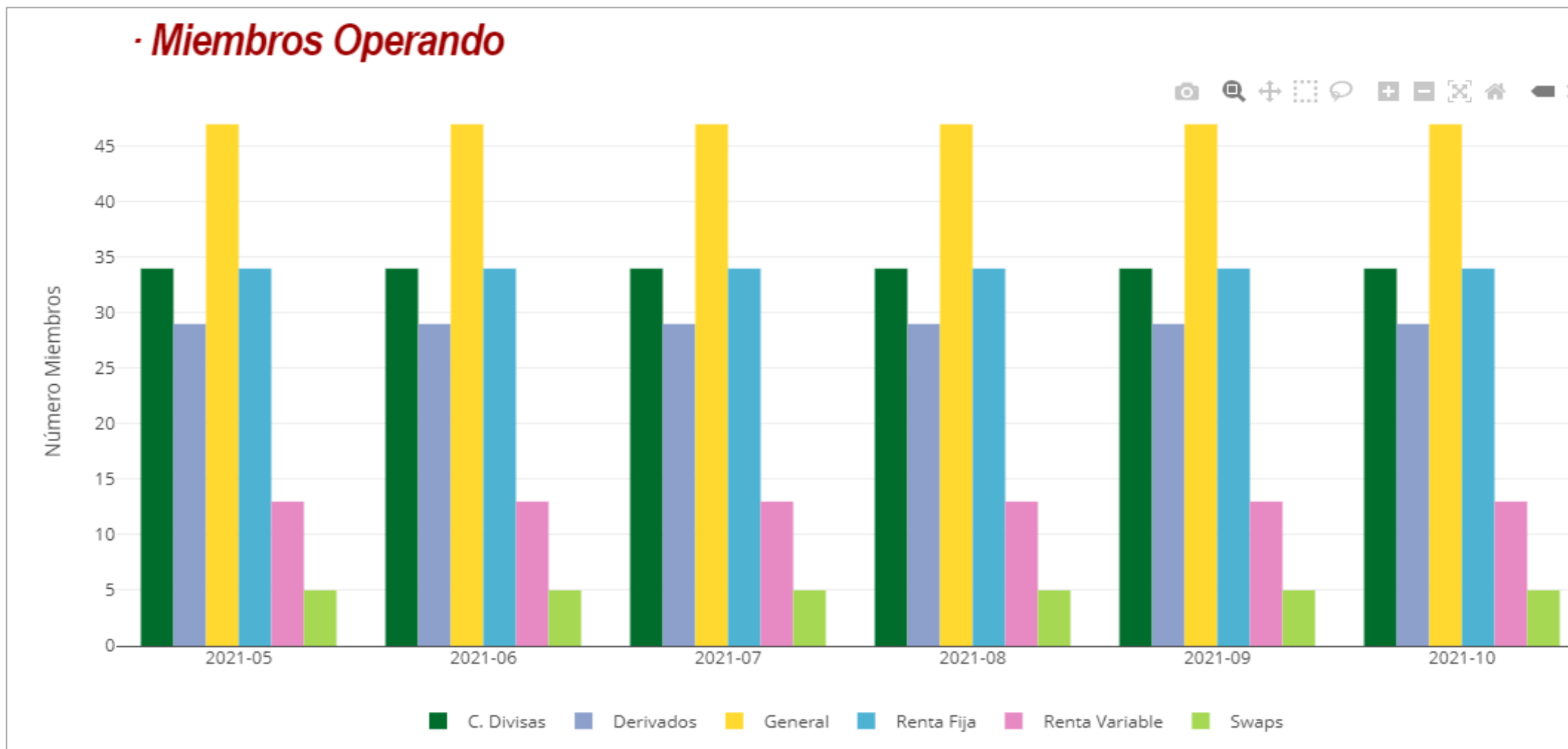




Evolución de Mercado

Octubre 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%	\$15,719,881	\$13,771,595	\$275,431,898	\$13,216,561	\$1,625,637,002
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	42.42%	\$6,667,775	\$4,811,889	\$96,237,775	\$4,683,838	\$576,112,067
Renta Fija	TES	Simultaneas	40.86%	\$6,423,903	\$5,556,612	\$111,132,237	\$5,357,815	\$659,011,210
Derivados	TRM	NDF FX FWD	9.03%	\$1,420,256	\$1,911,974	\$38,239,485	\$1,684,471	\$207,189,948
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.48%	\$704,904	\$755,969	\$15,119,372	\$712,643	\$87,655,076
Derivados	TRM	F. TRM	0.94%	\$148,159	\$161,251	\$3,225,027	\$229,746	\$28,258,719
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.79%	\$124,576	\$105,531	\$2,110,617	\$99,925	\$12,290,759
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.59%	\$92,552	\$92,521	\$1,850,423	\$92,417	\$11,367,306
Derivados	OIS	OIS IBR	0.38%	\$59,425	\$203,564	\$4,071,286	\$115,219	\$14,171,887

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%	\$15,719,881	\$13,771,595	\$275,431,898	\$13,216,561	\$1,625,637,002
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	42.42%	\$6,667,775	\$4,811,889	\$96,237,775	\$4,683,838	\$576,112,067
Renta Fija	TES	Simultaneas	40.86%	\$6,423,903	\$5,556,612	\$111,132,237	\$5,357,815	\$659,011,210
Derivados	TRM	NDF FX FWD	9.03%	\$1,420,256	\$1,911,974	\$38,239,485	\$1,684,471	\$207,189,948
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	4.48%	\$704,904	\$755,969	\$15,119,372	\$712,643	\$87,655,076
Derivados	TRM	F. TRM	0.94%	\$148,159	\$161,251	\$3,225,027	\$229,746	\$28,258,719
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.79%	\$124,576	\$105,531	\$2,110,617	\$99,925	\$12,290,759
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	0.59%	\$92,552	\$92,521	\$1,850,423	\$92,417	\$11,367,306
Derivados	OIS	OIS IBR	0.38%	\$59,425	\$203,564	\$4,071,286	\$115,219	\$14,171,887

Informe de la Administración

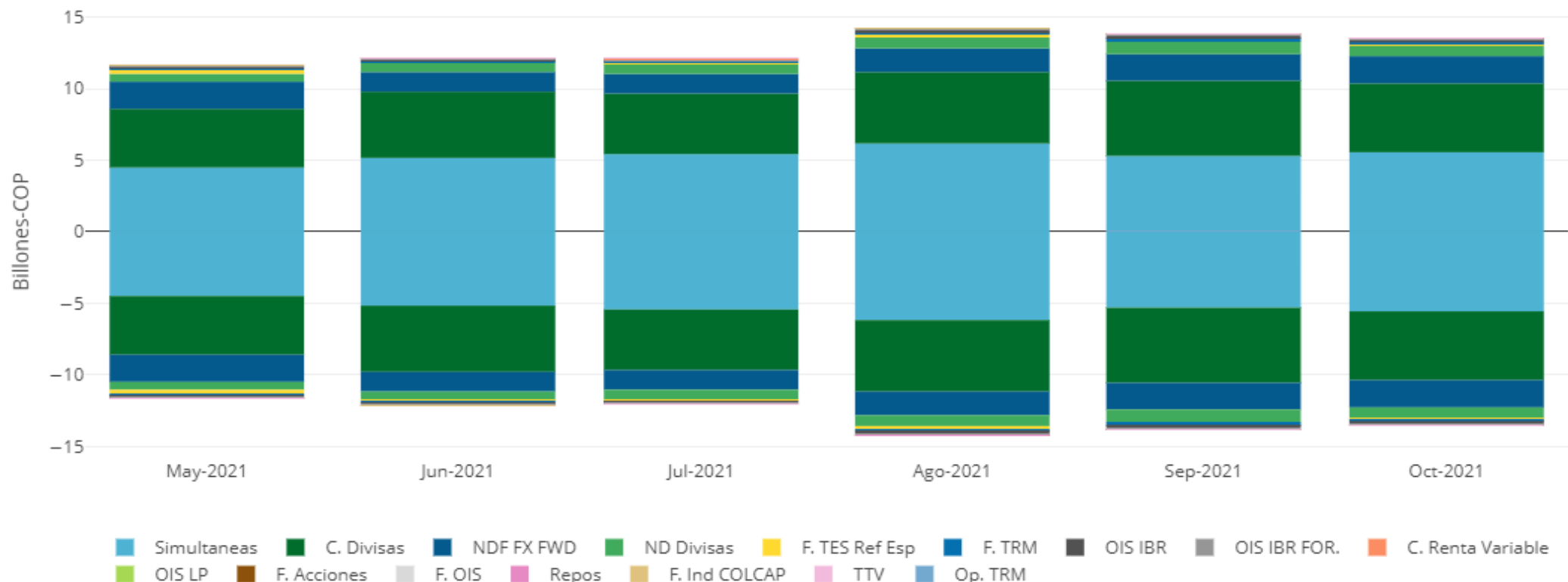
- Volumen Operado

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	\$0	\$0	\$1,958	\$240,809
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$28	\$569	\$428	\$52,583
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$10,300	\$206,000	\$19,996	\$2,459,500

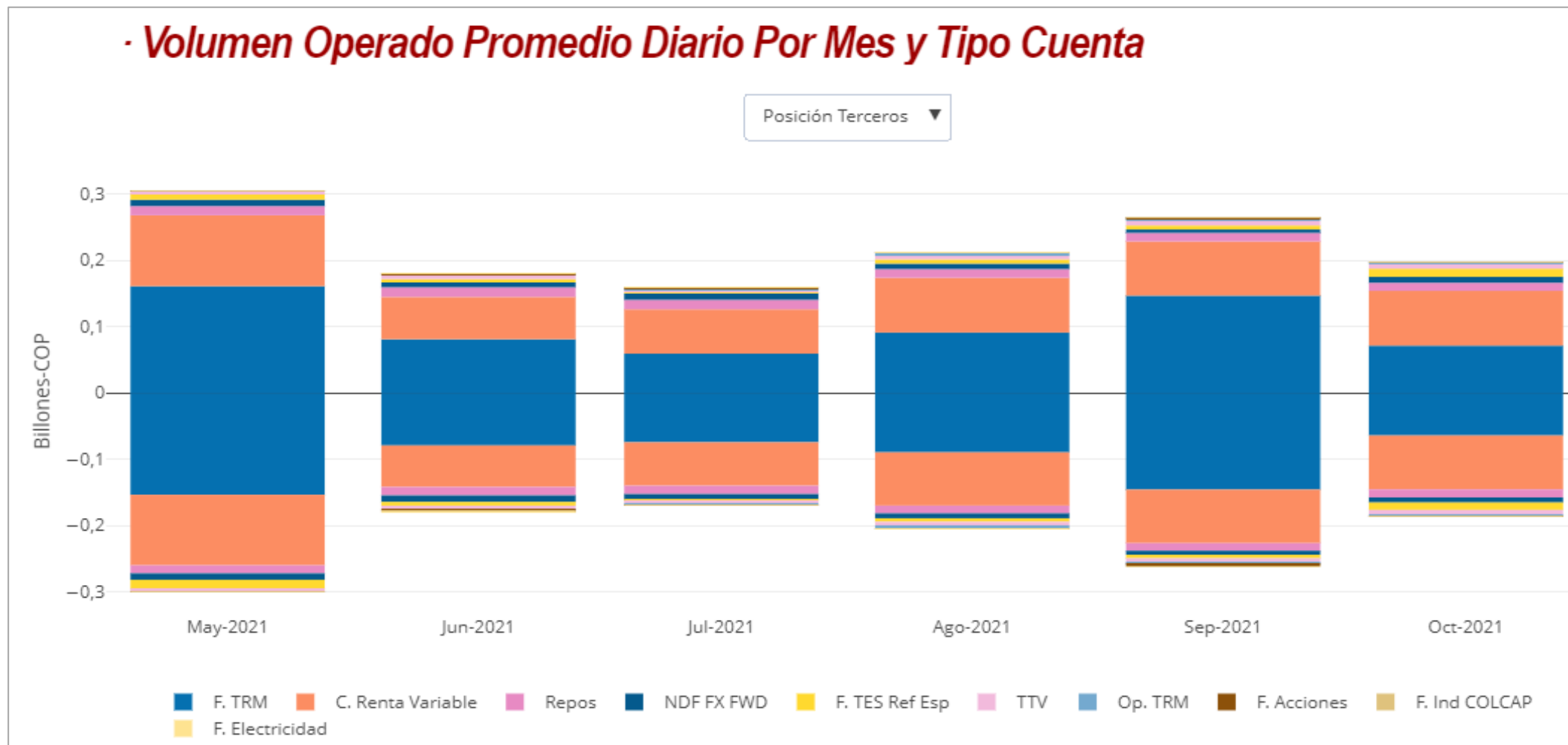
Informe de la Administración

- Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

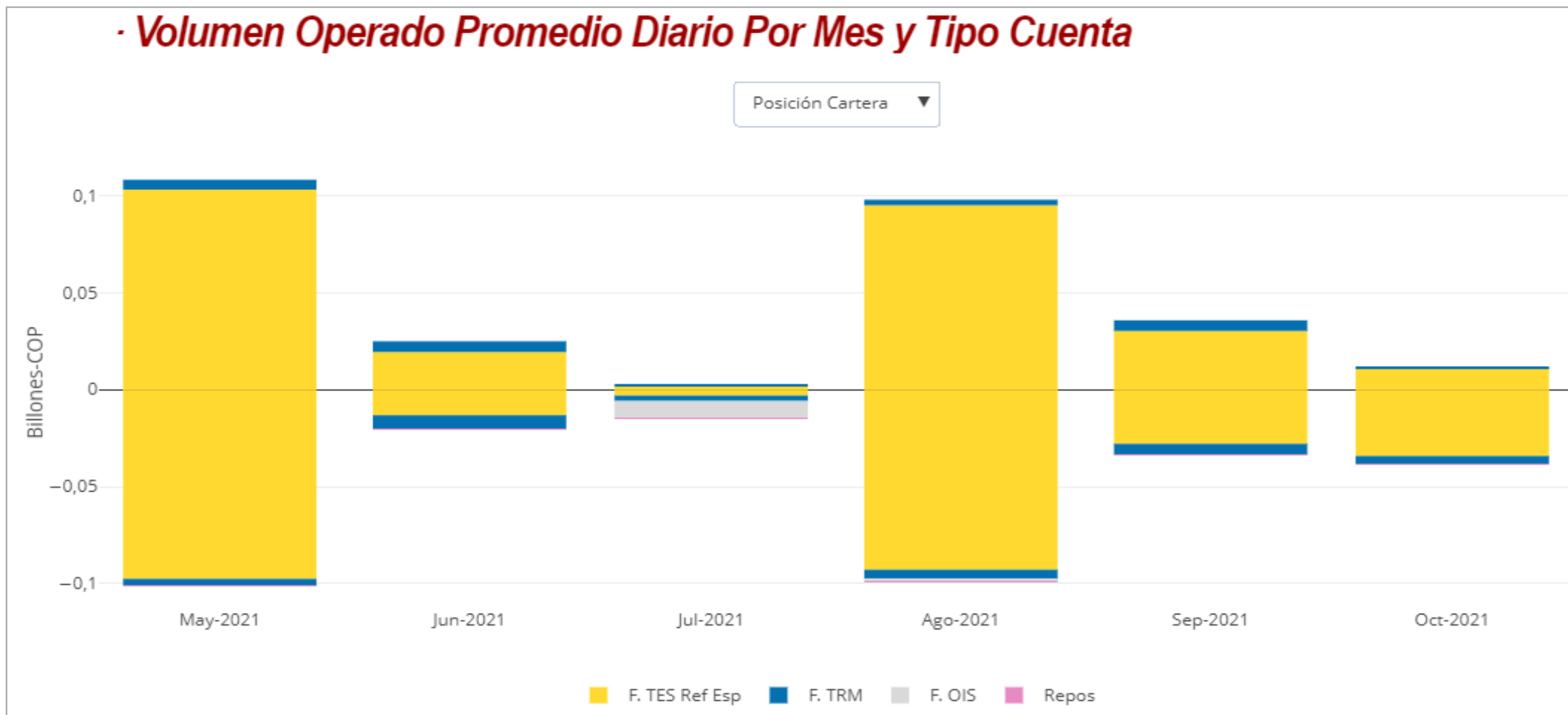
Posición Propia ▼



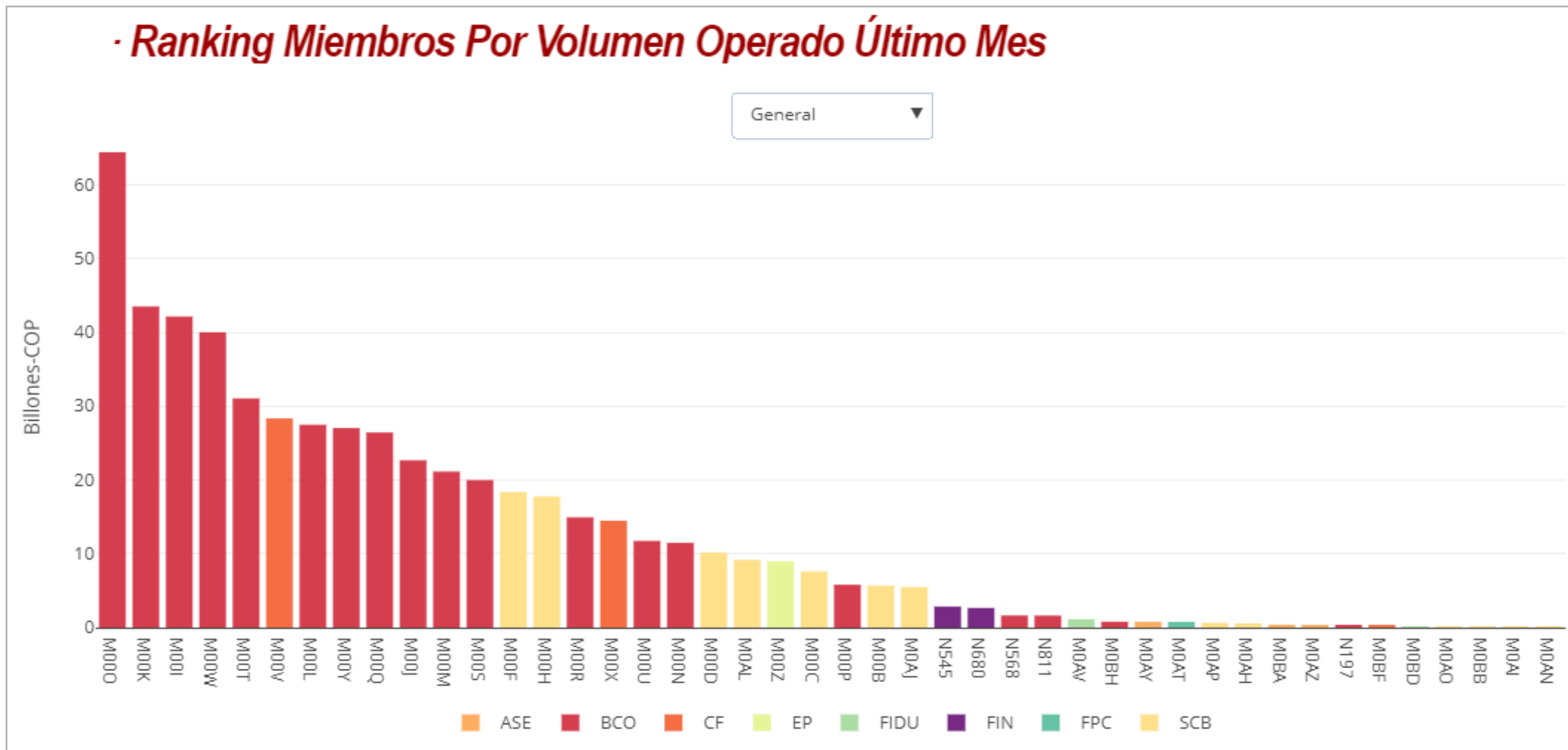
Informe de la Administración



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%	\$86,084,865	\$81,399,574	\$71,720,514
Derivados	TRM	NDF FX FWD	42.95%	\$36,976,679	\$36,870,977	\$31,859,725
Derivados	OIS	OIS IBR	19.54%	\$16,818,248	\$16,150,881	\$11,899,937
Renta Fija	TES	Simultaneas	16.23%	\$13,972,153	\$9,744,046	\$10,690,575
Swaps	OIS LP	OIS LP	6.95%	\$5,982,000	\$5,938,700	\$4,788,065
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	5.52%	\$4,748,859	\$4,835,082	\$4,700,856
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	2.84%	\$2,446,645	\$2,733,957	\$2,743,905
Derivados	TRM	F. TRM	2.50%	\$2,148,481	\$2,174,538	\$2,187,843
Derivados	OIS	F. OIS	1.53%	\$1,316,857	\$1,336,268	\$1,421,638

Informe de la Administración

- Posición Abierta

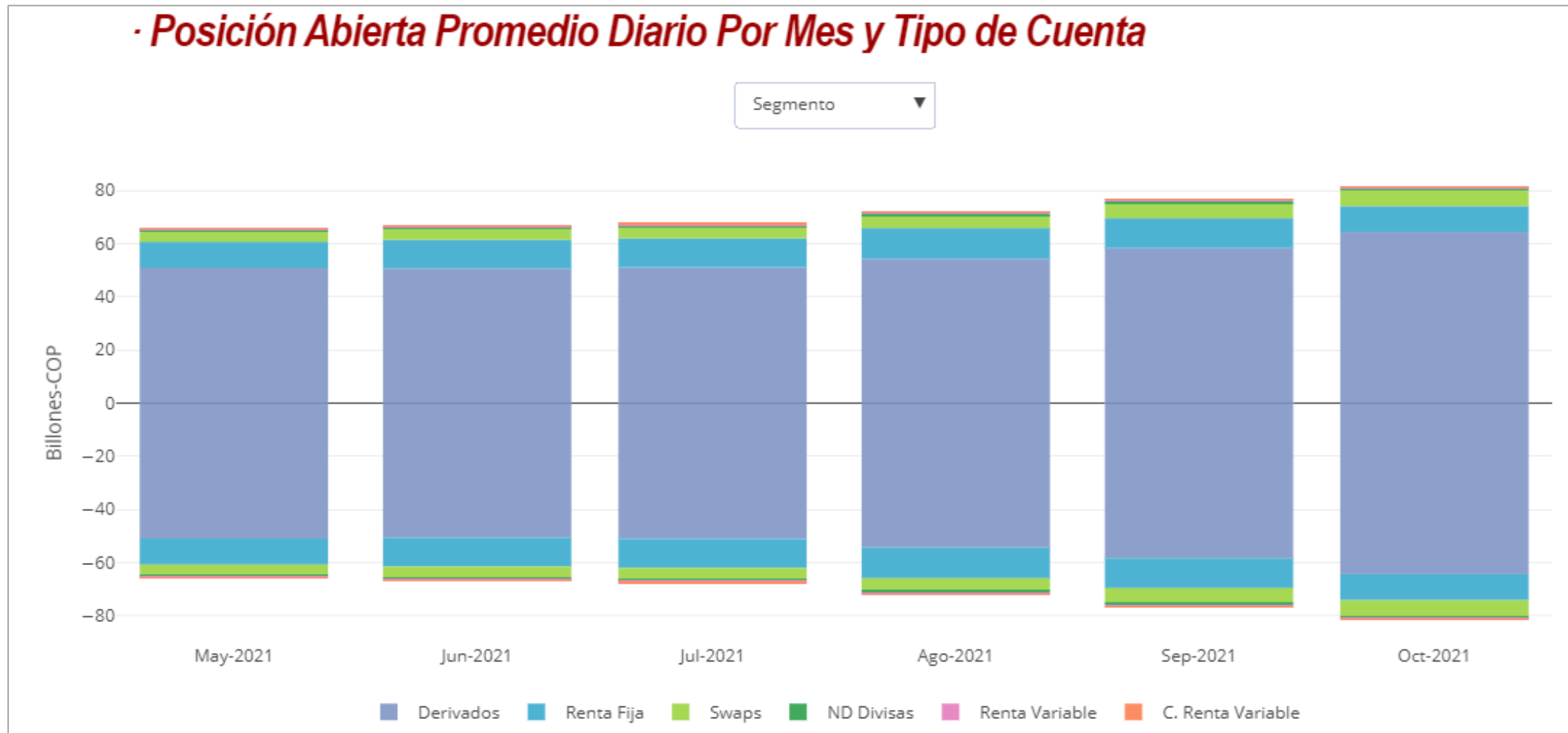
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Posición Abierta Último Día M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Promedio Diario Periodo M-COP
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	0.74%	\$635,218	\$623,055	\$632,014
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.62%	\$532,247	\$541,798	\$458,881
Derivados	TRM	Opcion TRM	0.24%	\$205,236	\$171,451	\$72,992
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.23%	\$195,067	\$174,513	\$168,929
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.04%	\$32,228	\$33,165	\$30,120
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.03%	\$27,925	\$24,882	\$18,344
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.03%	\$23,884	\$23,410	\$20,337
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.02%	\$17,409	\$18,653	\$18,586
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$3,430	\$1,833	\$4,192

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%	\$2,295	\$2,336	\$3,149
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$28	\$428

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	\$1,177,000	\$1,144,400	\$772,870
1Y-2Y	\$1,624,500	\$1,634,100	\$1,373,772
2Y-5Y	\$2,458,000	\$2,436,800	\$1,964,963
5Y-10Y	\$722,500	\$723,400	\$676,459
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



CÁMARA DE RIESGO

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

WWW.CAMARADERIESGO.COM