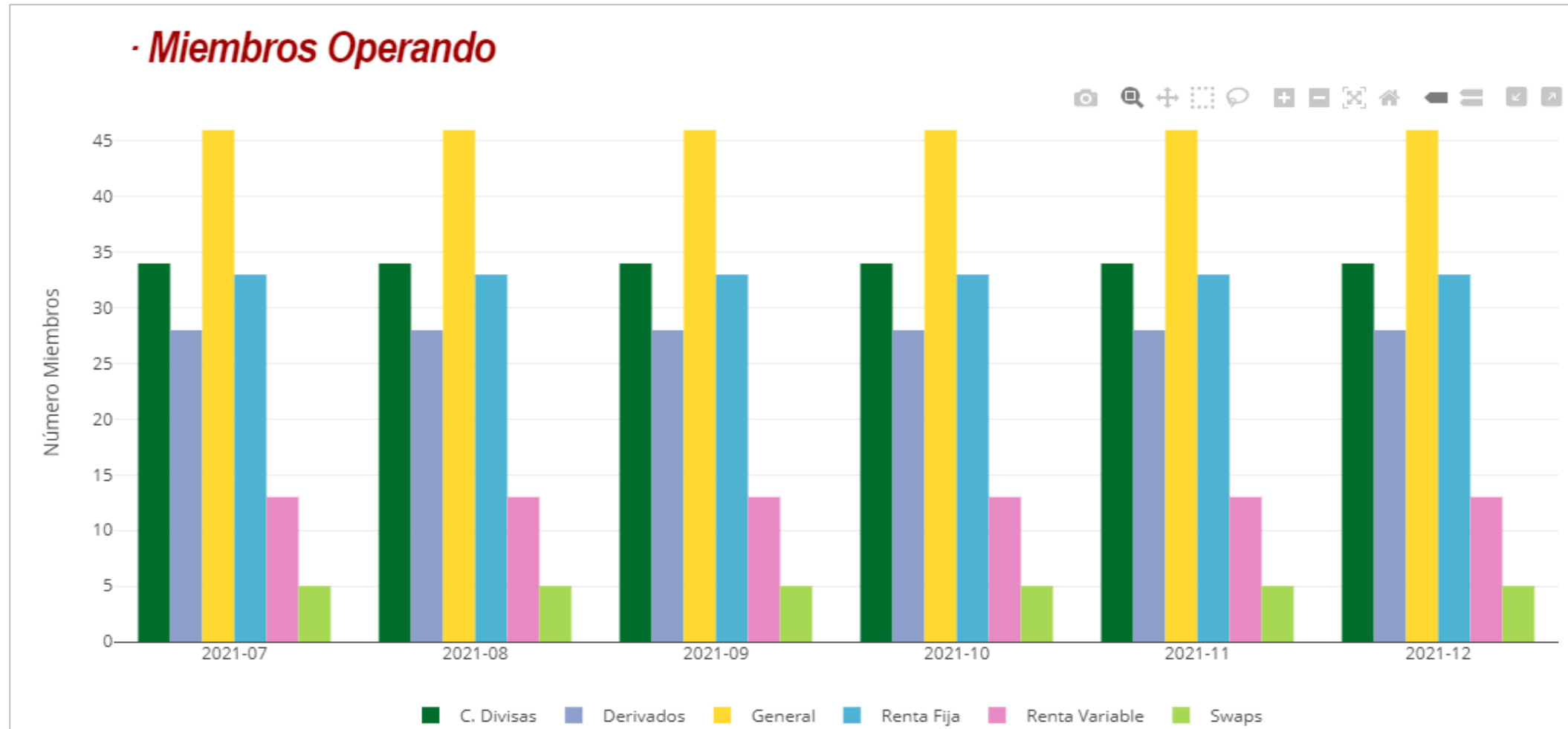




# Evolución de Mercado

*Diciembre 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%	\$7,245,842	\$12,470,874	\$261,888,359	\$13,611,412	\$1,687,815,126
C. Divisas	C. Divisas	C. Divisas	57.71%	\$4,181,663	\$4,644,031	\$97,524,655	\$4,932,166	\$611,588,581
Renta Fija	TES	Simultaneas	26.13%	\$1,893,166	\$4,381,816	\$92,018,142	\$5,310,177	\$658,461,934
Derivados	TRM	NDF FX FWD	6.72%	\$486,590	\$1,675,308	\$35,181,458	\$1,756,624	\$217,821,393
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	6.67%	\$483,132	\$746,651	\$15,679,672	\$783,142	\$97,109,593
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	1.28%	\$92,695	\$92,666	\$1,945,986	\$92,502	\$11,470,245
Derivados	TRM	F. TRM	1.06%	\$76,498	\$407,452	\$8,556,499	\$252,030	\$31,251,765
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	0.42%	\$30,427	\$85,615	\$1,797,905	\$98,151	\$12,170,695
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	0.01%	\$1,065	\$12,670	\$266,062	\$13,795	\$1,710,549

# Informe de la Administración

## - Volumen Operado

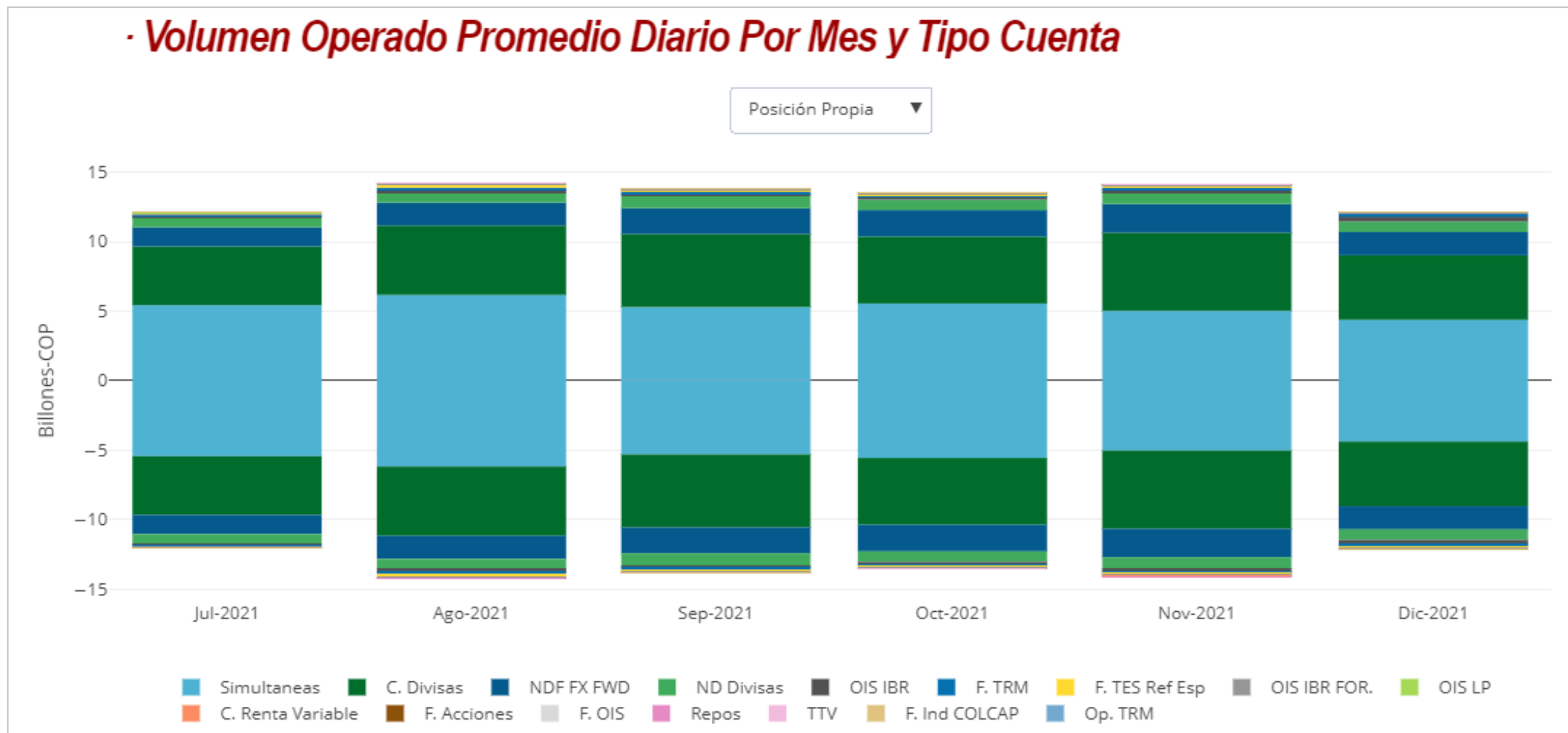
Segmento	Tipo Producto	Producto	%	Volumen Último Día M-COP	Volumen Promedio Diario Último Mes M-COP	Volumen Acumulado Último Mes M-COP	Volumen Promedio Diario Periodo M-COP	Volumen Acumulado Periodo M-COP
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	0.01%	\$417	\$3,219	\$67,599	\$1,896	\$235,050
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T2	0.00%	\$175	\$16,203	\$340,256	\$5,460	\$677,047
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	0.00%	\$13	\$5,648	\$118,598	\$6,534	\$810,247
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	0.00%	\$0	\$2,316	\$48,640	\$941	\$116,735
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	0.00%	\$0	\$9	\$194	\$11	\$1,332
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	0.00%	\$0	\$1,787	\$37,528	\$885	\$109,700
Derivados	OIS	F. OIS	0.00%	\$0	\$1,345	\$28,250	\$1,885	\$233,798
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	0.00%	\$0	\$57,288	\$1,203,045	\$142,843	\$17,712,495
Derivados	OIS	OIS IBR	0.00%	\$0	\$322,593	\$6,774,462	\$188,157	\$23,331,451

# 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	TRM	Opcion TRM	0.00%	\$0	\$67	\$1,408	\$1,525	\$189,088
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	0.00%	\$0	\$0	\$0	\$249	\$30,928
Swaps	OIS LP	OIS LP	0.00%	\$0	\$14,190	\$298,000	\$22,440	\$2,782,500

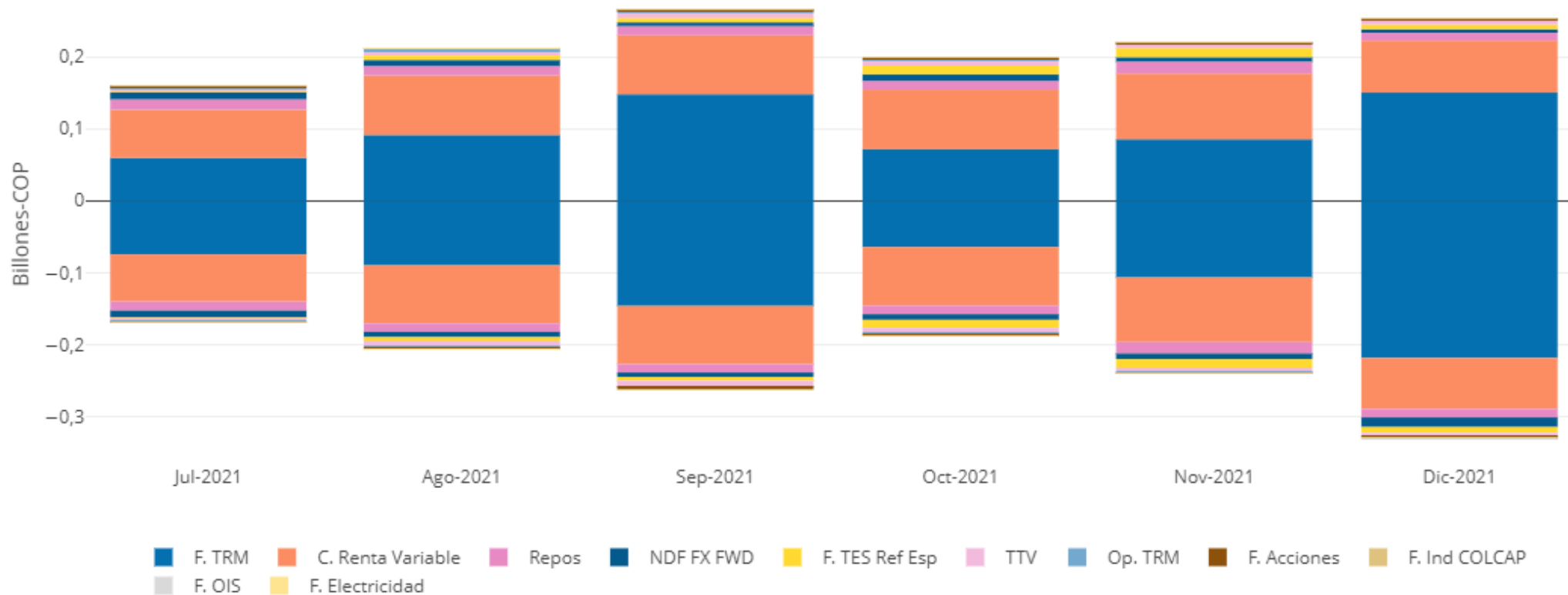
# Informe de la Administración



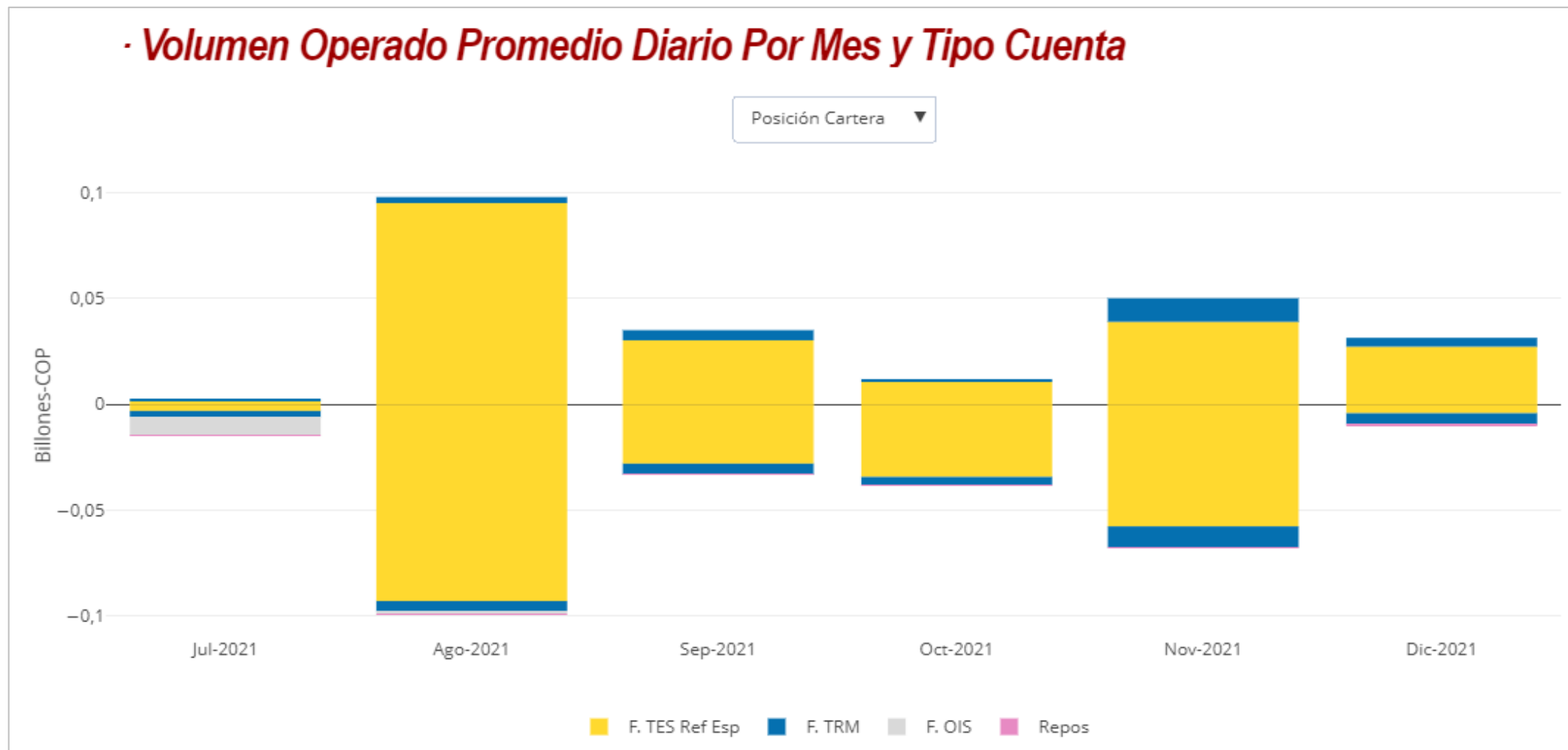
# Informe de la Administración

## - Volumen Operado Promedio Diario Por Mes y Tipo Cuenta

Posición Terceros ▼

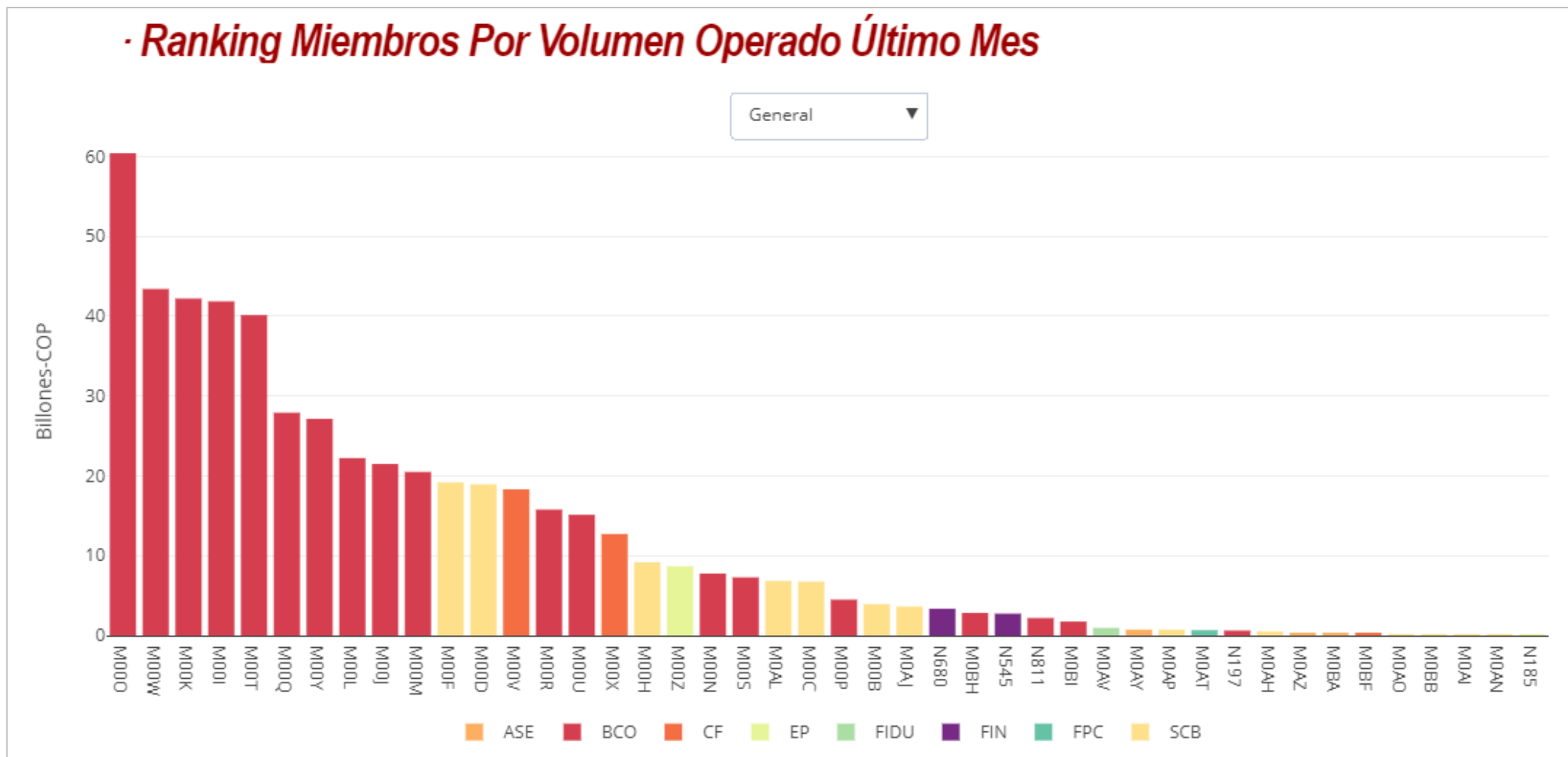


# Informe de la Administración

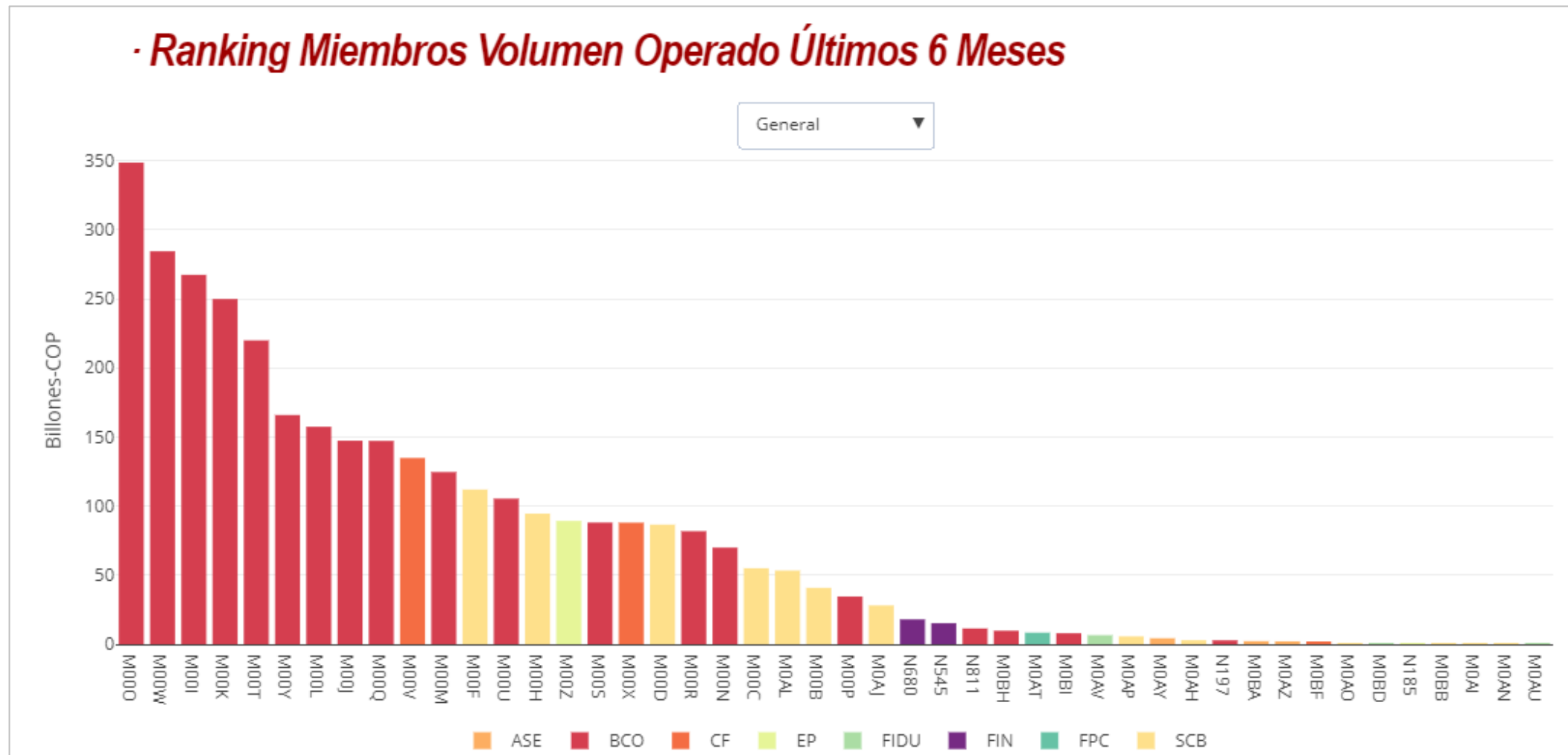




# Informe de la Administración



# Informe de la Administración



# 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	\$98,306,475	\$98,306,475	\$89,702,757	\$89,702,755	\$78,875,374	\$78,875,373
Derivados	TRM	NDF FX FWD	\$39,977,523	\$39,977,523	\$40,161,293	\$40,161,293	\$35,348,274	\$35,348,274
Derivados	OIS	OIS IBR	\$24,295,124	\$24,295,124	\$20,746,848	\$20,746,848	\$15,178,523	\$15,178,523
Renta Fija	TES	Simultaneas	\$14,850,215	\$14,850,215	\$9,500,024	\$9,500,024	\$10,202,053	\$10,202,053
Swaps	OIS LP	OIS LP	\$6,641,500	\$6,641,500	\$6,559,476	\$6,559,476	\$5,514,710	\$5,514,710
Derivados	OIS	OIS IBR FOR.	\$4,625,466	\$4,625,466	\$4,700,073	\$4,700,073	\$4,729,963	\$4,729,963
Derivados	TRM	F. TRM	\$4,044,625	\$4,044,625	\$3,892,602	\$3,892,602	\$2,534,835	\$2,534,835
Derivados	F. TES	F. TES Ref Esp	\$1,661,991	\$1,661,991	\$1,419,268	\$1,419,268	\$2,420,899	\$2,420,899
Derivados	OIS	F. OIS	\$1,183,228	\$1,183,228	\$1,182,232	\$1,182,232	\$1,361,947	\$1,361,947

# Informe de la Administración

**- Posición Abierta**

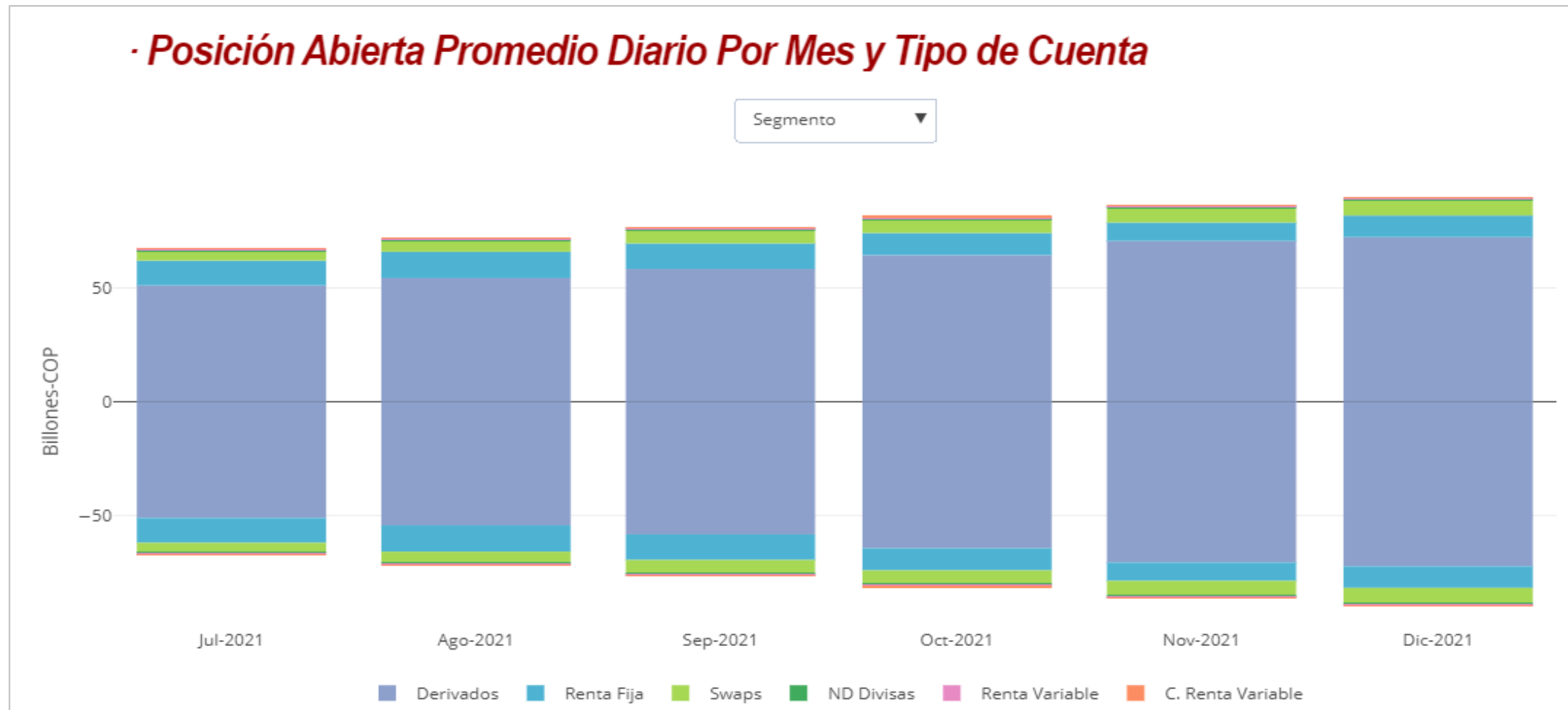
Segmento	Tipo Producto	Producto	Posición Abierta Compradora Último Día M-COP	Posición Abierta Vendedora Último Día M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Último Mes M-COP	Posición Abierta Compradora Promedio Diario Periodo M-COP	Posición Abierta Vendedora Promedio Diario Periodo M-COP
Renta Variable	Repos y TTV	Repos	\$471,789	\$471,789	\$511,753	\$511,753	\$505,250	\$505,250
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T1	\$373,802	\$373,802	\$672,134	\$672,134	\$692,306	\$692,306
C. Renta Variable	C. Renta Variable	C. Renta Variable	\$56,160	\$56,160	\$158,216	\$158,214	\$165,491	\$165,490
Derivados	TRM	Opcion TRM	\$49,445	\$49,445	\$87,338	\$87,338	\$120,111	\$120,111
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq ent	\$32,084	\$32,084	\$33,863	\$33,863	\$32,381	\$32,381
Derivados	F. Renta Variable	F. acc liq dif	\$20,650	\$20,650	\$21,432	\$21,432	\$22,241	\$22,241
Derivados	F. Renta Variable	F. ind COLCAP	\$17,546	\$17,546	\$18,352	\$18,352	\$19,031	\$19,031
Renta Variable	Repos y TTV	TTV	\$2,699	\$2,699	\$19,508	\$19,508	\$19,070	\$19,070
Derivados	F. Electricidad	F. Electricidad	\$2,453	\$2,453	\$2,177	\$2,177	\$2,717	\$2,717

# 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 T2	\$175	\$175	\$16,169	\$16,169	\$5,322	\$5,322
ND Divisas	ND Divisas	Divisas T3	\$0	\$0	\$0	\$0	\$249	\$249

# 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	\$1,163,000	\$1,158,429	\$914,411
1Y-2Y	\$2,040,000	\$1,988,167	\$1,616,601
2Y-5Y	\$2,608,000	\$2,588,143	\$2,254,262
5Y-10Y	\$830,500	\$824,738	\$729,435
10Y-15Y	\$0	\$0	\$0



**CÁMARA DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

POR UN MERCADO DINÁMICO Y CONFIABLE

[WWW.CAMARADERIESGO.COM](http://WWW.CAMARADERIESGO.COM)