

Informe Formador de Liquidez Fututo Mini Colcap

III Trimestre 2020

Período del reporte 01/07/2020 – 30/09/2020

Resumen del comportamiento del Activo (Total Mercado)

Total Contratos Negociados	22.083	Precio Inicial (COLCAP)	\$1.095
Precio Final (COLCAP)	\$1.171	Variación	6.94%
Open Interest en Contratos (Inicial)	3.891	Open Interest en Contratos (Final)	4.193

Resultados operativos del Formador de Liquidez (Casa de Bolsa)

Total Contratos Negociados	1.240	Monto Negociado	\$3.744 M
Total Contratos Comprados	770	Total Contratos Vendidos	470
Participación de Mercado	5.61%	Contratos Negociados (Jul)	360
Contratos Negociados (Ago)	60	Contratos Negociados (Sep)	820

Cumplimiento de requerimientos programa de Formadores de Liquidez¹

Julio

Puntaje	Creador
5,28	Credicorp Capital
3,19	Alianza Valores
2,22	Casa de Bolsa

Permanencia	Creador
97%	Credicorp Capital
95%	Alianza Valores
99%	Casa de Bolsa

Agosto

Puntaje	Creador
5,22	Credicorp Capital
4,44	Alianza Valores
1,96	Casa de Bolsa

Permanencia	Creador
94%	Credicorp Capital
97%	Alianza Valores
91%	Casa de Bolsa

Septiembre

Puntaje	Creador
4,52	Credicorp Capital
2,57	Alianza Valores
1,59	Casa de Bolsa

Permanencia	Creador
96%	Credicorp Capital
93%	Alianza Valores
95%	Casa de Bolsa

¹ Según datos suministrados por la Bolsa de Valores de Colombia (BVC). Corresponde al porcentaje de mediciones que cumplieron con los requerimientos exigidos para el programa de Formadores de Liquidez. El porcentaje de cumplimiento mínimo es del 80%.

Julio

Puntaje	Spread (30%)
6,86	Credicorp Capital
3,31	Alianza Valores
2,50	Casa de Bolsa

Puntaje	Cantidad (20%)
2,77	Credicorp Capital
2,30	Alianza Valores
2,06	Casa de Bolsa

Puntaje	Mejores Puntas (25%)
5,68	Credicorp Capital
3,95	Alianza Valores
3,22	Casa de Bolsa

Puntaje	Volumen (25%)
5,00	Credicorp Capital
3,00	Alianza Valores
1,00	Casa de Bolsa

Agosto

Puntaje	Spread (30%)
7,63	Credicorp Capital
4,78	Alianza Valores
2,05	Casa de Bolsa

Puntaje	Cantidad (20%)
2,57	Credicorp Capital
2,25	Alianza Valores
2,00	Casa de Bolsa

Puntaje	Mejores Puntas (25%)
6,68	Credicorp Capital
5,21	Alianza Valores
2,78	Casa de Bolsa

Puntaje	Volumen (25%)
3,00	Credicorp Capital
5,00	Alianza Valores
1,00	Casa de Bolsa

Septiembre

Puntaje	Spread (30%)
5,00	Credicorp Capital
2,72	Alianza Valores
1,27	Casa de Bolsa

Puntaje	Cantidad (20%)
2,93	Credicorp Capital
2,19	Alianza Valores
2,09	Casa de Bolsa

Puntaje	Mejores Puntas (25%)
4,72	Credicorp Capital
2,27	Alianza Valores
2,18	Casa de Bolsa

Puntaje	Volumen (25%)
5,00	Credicorp Capital
3,00	Alianza Valores
1,00	Casa de Bolsa

Comentarios

Señalamos el cumplimiento de los parámetros evaluados por la BVC (Bolsa de Valores de Colombia) en el programa de creadores de mercado, tanto en términos de volumen y spread máximo, como de tiempo de presencia en la pantalla. A pesar que las operaciones de contratos sobre el índice han disminuido en último semestre del año, Casa de Bolsa S.A. sigue participando activamente en la generación de liquidez en el mercado secundario.