



Boletín informativo

No.001 / Enero 12 de 2021

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.4. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. - CRCC S.A.

Cualquier aclaración que requiera, favor comunicarse con Subgerencia de Riesgos y Operaciones de la CRCC S.A. vía telefónica al número 3277000 opción 1 o a través de la cuenta de correo electrónico: operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co.



A. GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES

En caso de que el valor de la Posición Abierta neta de una Cuenta, ya sea de Registro de la Posición Propia o de un Tercero Identificado, y en un determinado Activo objeto de las Operaciones Repo, Operaciones TTV y Operaciones de Contado supere el 100% del Volumen Medio Diario será considerada como una Gran Posición, por lo tanto, se entiende que el horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar dicha posición aumenta, según lo muestra la siguiente tabla:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)
Hasta un 100%	3
Hasta un 200%	4
Mayor a un 300%	5

Por tal razón los parámetros para el cálculo de la Garantía por Posición y el Riesgo en situación de estrés se incrementarán de acuerdo al incremento del horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar la posición según se muestra en la siguiente tabla:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de incremento en la Garantía por Posición.
Entre un 100% y 150%	3	28%
Entre un 150% y 200%	4	52%
Mayor a un 200%	5	73%

El incremento de las fluctuaciones y de las fluctuaciones de estrés en el caso de existir una Gran Posición se hará efectivo en el siguiente día hábil de registrada dicha posición.



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de enero 2021 hasta el 18 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,490,000,000	241,879
CELSIA	982,000,000	205,482
CEMARGOS	3,064,000,000	521,982
CORFICOLCF	2,175,000,000	66,832
ECOPETROL	72,350,000,000	30,158,216
GEB	2,277,000,000	888,301
GRUPOARGOS	3,032,000,000	219,716
GRUPOSURA	6,444,000,000	266,942
ISA	8,396,000,000	289,530
NUTRESA	3,263,000,000	139,187
PFAVAL	11,160,000,000	9,579,593
PFBCOLOM	58,424,000,000	1,680,307
PFDVVNDA	4,473,000,000	127,133
PFGRUPSURA	2,004,000,000	91,877
ICOLCAP	7,853,000,000	535,070

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de enero 2021 hasta el 18 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	77,014,314
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	4,247,015
BAC	1,000,000,000,000	57,643,138
BBVACOL	20,000,000	67,825
BCOLOMBIA	8,490,000,000	241,879
BMC	-	-
BOGOTA	632,000,000	8,210



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	382,000,000	30,109
C	1,000,000,000,000	23,262,310
CARTON	6,000,000	637
CELSIA	982,000,000	205,482
CEMARGOS	3,064,000,000	521,982
CLH	2,822,000,000	606,945
CNEC	1,813,000,000	179,006
COLTEJER	1,000,000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	175,000,000	397,939
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,175,000,000	66,832
CREDIFAMI	596,000,000	238,207
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	72,350,000,000	30,158,216
ELCONDOR	87,000,000	73,603
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	74,000,000	5,727,917
ESTRA	-	-
ETB	198,000,000	921,064
EXITO	210,000,000	15,352
FABRICATO	16,000,000	2,972,787
FAMILIA	-	-
FB	1,000,000,000,000	17,905,846
FGNTOLIMA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	95,419,989
GEB	2,277,000,000	888,301
GRUBOLIVAR	229,000,000	3,430
GRUPOARGOS	3,032,000,000	219,716
GRUPOAVAL	85,000,000	71,888
GRUPOSURA	6,444,000,000	266,942
HCOLSEL	5,510,000,000	405,707
ICOLCAP	7,853,000,000	535,070
INCASTILLA	-	-
INESA	11,000,000	26,662
INVENSA	34,000,000	66,935
ISA	8,396,000,000	289,530
JNJ	1,000,000,000,000	6,594,659
JPM	1,000,000,000,000	14,536,844
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	477,000,000	115,694
MOAT	70,731,000,000	317,998
NUTRESA	3,263,000,000	139,187
OCCIDENTE	134,000,000	3,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	1,000,000	168,032
PFAVAL	11,160,000,000	9,579,593
PFAVH	38,000,000	200,720
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	58,424,000,000	1,680,307
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	348,000,000	79,093



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	588,000,000	22,607
PFDVVVDA	4,473,000,000	127,133
PFE	1,000,000,000,000	32,091,939
PFGRUPOARG	479,000,000	45,981
PFGRUPSURA	2,004,000,000	91,877
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	10,000,000	2,261
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	3,000,000	810
POPULAR	3,000,000	12,294
PROMIGAS	190,000,000	23,412
PROTECCION	5,000,000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4,000,000	7,395
TERPEL	346,000,000	41,806
TGLSC	-	1,720
TITAN	51,000,000	3,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6,000,000	1,138
VILLAS	59,000,000	11,243

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de enero 2021 hasta el 18 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	77,014,314
AGROCHAL	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AMZN	4,247,015
BAC	57,643,138
BBVACOL	67,825
BCOLOMBIA	241,879
BMC	-
BOGOTA	8,210
BVC	30,109
C	23,262,310
CARTON	637
CELSIA	205,482
CEMARGOS	521,982
CLH	606,945
CNEC	179,006
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	397,939
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	66,832
CREDIFAMI	238,207
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	30,158,216
ELCONDOR	73,603
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5,727,917
ESTRA	-
ETB	921,064



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de
las transacciones generando
seguridad y transparencia al
mercado de capitales colombiano.*



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
EXITO	15,352
FABRICATO	2,972,787
FAMILIA	-
FB	17,905,846
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	95,419,989
GEB	888,301
GRUBOLIVAR	3,430
GRUPOARGOS	219,716
GRUPOAVAL	71,888
GRUPOSURA	266,942
HCOLSEL	405,707
ICOLCAP	535,070
INCASTILLA	-
INESA	26,662
INVENSA	66,935
ISA	289,530
JNJ	6,594,659
JPM	14,536,844
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	115,694
MOAT	317,998
NUTRESA	139,187
OCCIDENTE	3,951
ORBIS	-
PAZRIO	168,032
PFAVAL	9,579,593
PFAVH	200,720



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de
las transacciones generando
seguridad y transparencia al
mercado de capitales colombiano.*



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,680,307
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	79,093
PFCORFICOL	22,607
PFDVVNDA	127,133
PFE	32,091,939
PFGRUPOARG	45,981
PFGRUPSURA	91,877
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,261
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	810
POPULAR	12,294
PROMIGAS	23,412
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7,395
TERPEL	41,806
TGLSC	1,720
TITAN	3,000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,138
VILLAS	11,243

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías



Aseguramos el cumplimiento de las transacciones generando seguridad y transparencia al mercado de capitales colombiano.