



Boletín informativo

No.006 / Enero 18 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.



**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

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.



**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

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de enero 2021 hasta el 25 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,207,000,000	247,941
CELSIA	926,000,000	198,262
CEMARGOS	2,973,000,000	506,858
CORFICOLCF	2,180,000,000	68,397
ECOPETROL	73,806,000,000	30,498,506
GEB	2,588,000,000	948,038
GRUPOARGOS	3,028,000,000	216,294
GRUPOSURA	6,690,000,000	270,306
ISA	8,601,000,000	296,774
NUTRESA	3,149,000,000	132,852
PFAVAL	10,427,000,000	8,950,114
PFBCELOM	54,985,000,000	1,635,959
PFDVVNDA	4,474,000,000	127,821
PFGROUPSURA	2,031,000,000	93,187
ICOLCAP	7,213,000,000	488,210

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de enero 2021 hasta el 25 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	78,161,559
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	4,118,978
BAC	1,000,000,000,000	56,243,350
BBVACOL	21,000,000	70,397
BCOLOMBIA	8,207,000,000	247,941
BMC	1,000,000	695
BOGOTA	624,000,000	7,899



**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 Efectivo	VMD acciones
BVC	387,000,000	30,483
C	1,000,000,000,000	23,003,480
CARTON	6,000,000	637
CELSIA	926,000,000	198,262
CEMARGOS	2,973,000,000	506,858
CLH	2,780,000,000	609,339
CNEC	1,780,000,000	174,668
COLTEJER	1,000,000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	207,000,000	432,983
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,180,000,000	68,397
CREDIFAMI	596,000,000	238,207
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	73,806,000,000	30,498,506
ELCONDOR	81,000,000	71,155
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	72,000,000	5,646,458
ESTRA	-	-
ETB	199,000,000	928,179
EXITO	218,000,000	16,150
FABRICATO	16,000,000	2,986,647
FAMILIA	-	-
FB	1,000,000,000,000	18,540,979
FGNTOLIMA	-	-



**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 Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	95,481,078
GEB	2,588,000,000	948,038
GRUBOLIVAR	229,000,000	3,420
GRUPOARGOS	3,028,000,000	216,294
GRUPOAVAL	83,000,000	70,352
GRUPOSURA	6,690,000,000	270,306
HCOLSEL	5,033,000,000	366,793
ICOLCAP	7,213,000,000	488,210
INCASTILLA	-	-
INESA	11,000,000	26,662
INVENSA	34,000,000	66,935
ISA	8,601,000,000	296,774
JNJ	1,000,000,000,000	6,634,904
JPM	1,000,000,000,000	14,732,171
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	511,000,000	119,059
MOAT	71,416,000,000	321,170
NUTRESA	3,149,000,000	132,852
OCCIDENTE	134,000,000	3,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	1,000,000	154,873
PFAVAL	10,427,000,000	8,950,114
PFAVH	38,000,000	202,385
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	54,985,000,000	1,635,959
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	359,000,000	79,712



**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 Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	598,000,000	22,635
PFDVVVDA	4,474,000,000	127,821
PFE	1,000,000,000,000	32,407,751
PFGRUPOARG	490,000,000	46,923
PFGRUPSURA	2,031,000,000	93,187
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11,000,000	2,395
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6,000,000	1,385
POPULAR	10,000,000	34,035
PROMIGAS	195,000,000	23,645
PROTECCION	5,000,000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4,000,000	7,395
TERPEL	355,000,000	41,838
TGLSC	-	1,720
TITAN	51,000,000	3,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6,000,000	1,138
VILLAS	61,000,000	11,450

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de enero 2021 hasta el 25 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	78,161,559
AGROCHAL	-



**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
AMZN	4,118,978
BAC	56,243,350
BBVACOL	70,397
BCOLOMBIA	247,941
BMC	695
BOGOTA	7,899
BVC	30,483
C	23,003,480
CARTON	637
CELSIA	198,262
CEMARGOS	506,858
CLH	609,339
CNEC	174,668
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	432,983
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	68,397
CREDIFAMI	238,207
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	30,498,506
ELCONDOR	71,155
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5,646,458
ESTRA	-
ETB	928,179



**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	16,150
FABRICATO	2,986,647
FAMILIA	-
FB	18,540,979
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	95,481,078
GEB	948,038
GRUBOLIVAR	3,420
GRUPOARGOS	216,294
GRUPOAVAL	70,352
GRUPOSURA	270,306
HCOLSEL	366,793
ICOLCAP	488,210
INCASTILLA	-
INESA	26,662
INVENSA	66,935
ISA	296,774
JNJ	6,634,904
JPM	14,732,171
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	119,059
MOAT	321,170
NUTRESA	132,852
OCCIDENTE	3,951
ORBIS	-
PAZRIO	154,873
PFAVAL	8,950,114
PFAVH	202,385



**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	1,635,959
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	79,712
PFCORFICOL	22,635
PFDAVVNDA	127,821
PFE	32,407,751
PFGRUPOARG	46,923
PFGRUPSURA	93,187
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,395
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,385
POPULAR	34,035
PROMIGAS	23,645
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7,395
TERPEL	41,838
TGLSC	1,720
TITAN	3,000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,138
VILLAS	11,450

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías



**CÁMARA
DE RIESGO**
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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