



Boletín informativo

No.017 / Febrero 01 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.





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.



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 02 de febrero 2021 hasta el 08 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.130.000.000	265.684
CELSIA	983.000.000	204.729
CEMARGOS	2.977.000.000	509.738
CORFICOLCF	2.195.000.000	68.121
ECOPETROL	64.334.000.000	31.691.440
GEB	2.923.000.000	1.119.337
GRUPOARGOS	2.809.000.000	211.211
GRUPOSURA	6.287.000.000	276.965
ISA	7.712.000.000	334.450
NUTRESA	3.419.000.000	140.119
PFAVAL	10.326.000.000	8.917.135
PFBCOLOM	54.554.000.000	1.730.788
PFDVVNDA	4.216.000.000	125.118
PFGRUPSURA	1.930.000.000	94.149
ICOLCAP	7.716.000.000	559.869

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 02 de febrero 2021 hasta el 08 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	81.580.742
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.853.448
BAC	1.000.000.000.000	54.827.499
BBVACOL	21.000.000	69.010
BCOLOMBIA	8.130.000.000	265.684
BMC	3.000.000	2.318
BOGOTA	677.000.000	8.123



**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	366.000.000	29.666
C	1.000.000.000.000	22.582.263
CARTON	14.000.000	1.419
CELSIA	983.000.000	204.729
CEMARGOS	2.977.000.000	509.738
CLH	2.518.000.000	602.459
CNEC	1.822.000.000	177.066
COLTEJER	-	197
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	240.000.000	501.001
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32.000.000	63.215
CORFICOLCF	2.195.000.000	68.121
CREDIFAMI	1.120.000.000	427.740
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	64.334.000.000	31.691.440
ELCONDOR	72.000.000	64.108
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	68.000.000	5.926.851
ESTRA	-	-
ETB	208.000.000	991.944
EXITO	193.000.000	14.240
FABRICATO	13.000.000	2.584.313
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	19.094.361
FGNTOLIMA	-	-





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	91.109.167
GEB	2.923.000.000	1.119.337
GRUBOLIVAR	222.000.000	3.410
GRUPOARGOS	2.809.000.000	211.211
GRUPOAVAL	78.000.000	69.300
GRUPOSURA	6.287.000.000	276.965
HCOLSEL	4.195.000.000	331.511
ICOLCAP	7.716.000.000	559.869
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.712.000.000	334.450
JNJ	1.000.000.000.000	6.952.877
JPM	1.000.000.000.000	14.793.188
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	544.000.000	126.434
MOAT	69.989.000.000	319.355
NUTRESA	3.419.000.000	140.119
OCCIDENTE	91.000.000	2.708
ORBIS	-	-
PAZRIO	2.000.000	196.053
PFAVAL	10.326.000.000	8.917.135
PFAVH	31.000.000	177.477
PFBBVACOL	-	-
PFBCELOM	54.554.000.000	1.730.788
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	364.000.000	82.697





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	579.000.000	22.268
PFDVVVDA	4.216.000.000	125.118
PFE	1.000.000.000.000	32.714.355
PFGRUPOARG	550.000.000	53.421
PFGRUPSURA	1.930.000.000	94.149
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	10.000.000	2.145
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	12.000.000	41.544
PROMIGAS	182.000.000	23.892
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	318.000.000	40.750
TGLSC	-	1.520
TITAN	119.000.000	7.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6.000.000	1.300
VILLAS	58.000.000	11.545

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 02 de febrero 2021 hasta el 08 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81.580.742
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	3.853.448
BAC	54.827.499
BBVACOL	69.010
BCOLOMBIA	265.684
BMC	2.318
BOGOTA	8.123
BVC	29.666
C	22.582.263
CARTON	1.419
CELSIA	204.729
CEMARGOS	509.738
CLH	602.459
CNEC	177.066
COLTEJER	197
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	501.001
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63.215
CORFICOLCF	68.121
CREDIFAMI	427.740
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	31.691.440
ELCONDOR	64.108
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.926.851
ESTRA	-
ETB	991.944



**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	14.240
FABRICATO	2.584.313
FAMILIA	-
FB	19.094.361
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	91.109.167
GEB	1.119.337
GRUBOLIVAR	3.410
GRUPOARGOS	211.211
GRUPOAVAL	69.300
GRUPOSURA	276.965
HCOLSEL	331.511
ICOLCAP	559.869
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	334.450
JNJ	6.952.877
JPM	14.793.188
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	126.434
MOAT	319.355
NUTRESA	140.119
OCCIDENTE	2.708
ORBIS	-
PAZRIO	196.053
PFAVAL	8.917.135
PFAVH	177.477
Nemotécnico	VMD acciones



**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

PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.730.788
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	82.697
PFCORFICOL	22.268
PFDVVVND	125.118
PFE	32.714.355
PFGRUPOARG	53.421
PFGRUPSURA	94.149
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.145
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	41.544
PROMIGAS	23.892
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	40.750
TGLSC	1.520
TITAN	7.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.300
VILLAS	11.545

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías