



Boletín informativo

No.022 / Febrero 15 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 16 de febrero 2021 hasta el 22 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.585.000.000	245.863
CELSIA	907.000.000	192.022
CEMARGOS	2.799.000.000	477.278
CORFICOLCF	2.171.000.000	66.205
ECOPETROL	67.865.000.000	31.565.304
GEB	3.199.000.000	1.202.760
GRUPOARGOS	2.865.000.000	215.760
GRUPOSURA	6.506.000.000	279.248
ISA	7.763.000.000	327.826
NUTRESA	3.185.000.000	132.723
PFAVAL	10.126.000.000	8.480.975
PFBCOLOM	50.724.000.000	1.595.103
PFDVVNDA	3.867.000.000	117.088
PFGRUPSURA	1.902.000.000	91.488
ICOLCAP	8.214.000.000	593.580

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de febrero 2021 hasta el 22 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	83.469.176
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.552.544
BAC	1.000.000.000.000	49.055.721
BBVACOL	23.000.000	75.408
BCOLOMBIA	7.585.000.000	245.863
BMC	3.000.000	2.318
BOGOTA	596.000.000	7.419





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	370.000.000	29.485
C	1.000.000.000.000	20.106.562
CARTON	39.000.000	3.962
CELSIA	907.000.000	192.022
CEMARGOS	2.799.000.000	477.278
CLH	859.000.000	202.133
CNEC	1.301.000.000	127.636
COLTEJER	1.000.000	585
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	245.000.000	499.463
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32.000.000	63.215
CORFICOLCF	2.171.000.000	66.205
CREDIFAMI	1.120.000.000	427.740
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	67.865.000.000	31.565.304
ELCONDOR	69.000.000	61.702
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	70.000.000	5.831.820
ESTRA	-	-
ETB	236.000.000	961.049
EXITO	174.000.000	12.737
FABRICATO	12.000.000	2.507.937
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	17.568.759
FGNTOLIMA	-	-





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	82.135.495
GEB	3.199.000.000	1.202.760
GRUBOLIVAR	214.000.000	3.314
GRUPOARGOS	2.865.000.000	215.760
GRUPOAVAL	72.000.000	61.395
GRUPOSURA	6.506.000.000	279.248
HCOLSEL	3.814.000.000	299.263
ICOLCAP	8.214.000.000	593.580
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.763.000.000	327.826
JNJ	1.000.000.000.000	7.104.143
JPM	1.000.000.000.000	13.150.037
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	528.000.000	128.654
MOAT	70.918.000.000	302.929
NUTRESA	3.185.000.000	132.723
OCCIDENTE	73.000.000	2.173
ORBIS	-	-
PAZRIO	2.000.000	188.882
PFAVAL	10.126.000.000	8.480.975
PFAVH	34.000.000	187.725
PFBBVACOL	-	-
PFBCELOM	50.724.000.000	1.595.103
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	345.000.000	78.503



**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	468.000.000	17.643
PFDVVVDA	3.867.000.000	117.088
PFE	1.000.000.000.000	33.286.117
PFGRUPOARG	460.000.000	45.862
PFGRUPSURA	1.902.000.000	91.488
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11.000.000	2.450
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	9.000.000	32.610
PROMIGAS	168.000.000	21.235
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	171.000.000	21.351
TGLSC	-	-
TITAN	119.000.000	7.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	11.000.000	2.135
VILLAS	53.000.000	11.429

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de febrero 2021 hasta el 22 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83.469.176
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	3.552.544
BAC	49.055.721
BBVACOL	75.408
BCOLOMBIA	245.863
BMC	2.318
BOGOTA	7.419
BVC	29.485
C	20.106.562
CARTON	3.962
CELSIA	192.022
CEMARGOS	477.278
CLH	202.133
CNEC	127.636
COLTEJER	585
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	499.463
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63.215
CORFICOLCF	66.205
CREDIFAMI	427.740
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	31.565.304
ELCONDOR	61.702
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.831.820
ESTRA	-
ETB	961.049



**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	12.737
FABRICATO	2.507.937
FAMILIA	-
FB	17.568.759
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	82.135.495
GEB	1.202.760
GRUBOLIVAR	3.314
GRUPOARGOS	215.760
GRUPOAVAL	61.395
GRUPOSURA	279.248
HCOLSEL	299.263
ICOLCAP	593.580
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	327.826
JNJ	7.104.143
JPM	13.150.037
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	128.654
MOAT	302.929
NUTRESA	132.723
OCCIDENTE	2.173
ORBIS	-
PAZRIO	188.882
PFAVAL	8.480.975
PFAVH	187.725



**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	1.595.103
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	78.503
PFCORFICOL	17.643
PFDVVNDA	117.088
PFE	33.286.117
PFGRUPOARG	45.862
PFGRUPSURA	91.488
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.450
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	32.610
PROMIGAS	21.235
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	21.351
TGLSC	-
TITAN	7.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2.135
VILLAS	11.429

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías