



Boletín informativo

No.028 / Febrero 22 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 23 de febrero 2021 hasta el 01 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.563.000.000	243.180
CELSIA	921.000.000	196.007
CEMARGOS	2.701.000.000	470.524
CORFICOLCF	2.137.000.000	65.582
ECOPETROL	68.986.000.000	31.864.190
GEB	3.133.000.000	1.195.238
GRUPOARGOS	2.495.000.000	197.409
GRUPOSURA	6.363.000.000	278.362
ISA	7.551.000.000	328.304
NUTRESA	3.102.000.000	129.514
PFAVAL	10.036.000.000	8.483.375
PFBCOLOM	50.101.000.000	1.581.463
PFDVVNDA	3.613.000.000	111.868
PFGRUPSURA	1.852.000.000	89.704
ICOLCAP	8.020.000.000	587.292

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 23 de febrero 2021 hasta el 01 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	84.525.673
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.495.637
BAC	1.000.000.000.000	48.108.315
BBVACOL	22.000.000	72.557
BCOLOMBIA	7.563.000.000	243.180
BMC	3.000.000	2.266
BOGOTA	587.000.000	7.278





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	368.000.000	29.452
C	1.000.000.000.000	19.628.428
CARTON	35.000.000	3.566
CELSIA	921.000.000	196.007
CEMARGOS	2.701.000.000	470.524
CLH	779.000.000	177.936
CNEC	1.331.000.000	129.264
COLTEJER	1.000.000	688
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	251.000.000	502.679
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32.000.000	63.215
CORFICOLCF	2.137.000.000	65.582
CREDIFAMI	1.120.000.000	427.740
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	68.986.000.000	31.864.190
ELCONDOR	69.000.000	62.983
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	71.000.000	5.786.852
ESTRA	-	-
ETB	229.000.000	960.998
EXITO	166.000.000	12.107
FABRICATO	12.000.000	2.626.703
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	17.583.947
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	76.807.172
GEB	3.133.000.000	1.195.238
GRUBOLIVAR	203.000.000	3.146
GRUPOARGOS	2.495.000.000	197.409
GRUPOAVAL	69.000.000	58.987
GRUPOSURA	6.363.000.000	278.362
HCOLSEL	3.997.000.000	317.031
ICOLCAP	8.020.000.000	587.292
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.551.000.000	328.304
JNJ	1.000.000.000.000	7.080.601
JPM	1.000.000.000.000	12.874.479
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	534.000.000	130.119
MOAT	69.811.000.000	293.720
NUTRESA	3.102.000.000	129.514
OCCIDENTE	84.000.000	2.476
ORBIS	-	-
PAZRIO	2.000.000	188.882
PFAVAL	10.036.000.000	8.483.375
PFAVH	35.000.000	192.216
PFBBVACOL	-	-
PFBCELOM	50.101.000.000	1.581.463
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	341.000.000	78.453



**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	480.000.000	18.081
PFDVVVDA	3.613.000.000	111.868
PFE	1.000.000.000.000	33.419.777
PFGRUPOARG	444.000.000	44.370
PFGRUPSURA	1.852.000.000	89.704
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11.000.000	2.436
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	10.000.000	35.231
PROMIGAS	160.000.000	20.812
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	163.000.000	20.570
TGLSC	-	-
TITAN	119.000.000	7.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10.000.000	2.081
VILLAS	51.000.000	11.003

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 23 de febrero 2021 hasta el 01 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84.525.673
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	3.495.637
BAC	48.108.315
BBVACOL	72.557
BCOLOMBIA	243.180
BMC	2.266
BOGOTA	7.278
BVC	29.452
C	19.628.428
CARTON	3.566
CELSIA	196.007
CEMARGOS	470.524
CLH	177.936
CNEC	129.264
COLTEJER	688
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	502.679
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63.215
CORFICOLCF	65.582
CREDIFAMI	427.740
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	31.864.190
ELCONDOR	62.983
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.786.852
ESTRA	-
ETB	960.998



**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	12.107
FABRICATO	2.626.703
FAMILIA	-
FB	17.583.947
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	76.807.172
GEB	1.195.238
GRUBOLIVAR	3.146
GRUPOARGOS	197.409
GRUPOAVAL	58.987
GRUPOSURA	278.362
HCOLSEL	317.031
ICOLCAP	587.292
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	328.304
JNJ	7.080.601
JPM	12.874.479
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	130.119
MOAT	293.720
NUTRESA	129.514
OCCIDENTE	2.476
ORBIS	-
PAZRIO	188.882
PFAVAL	8.483.375
PFAVH	192.216



**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	1.581.463
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	78.453
PFCORFICOL	18.081
PFDVVNDA	111.868
PFE	33.419.777
PFGRUPOARG	44.370
PFGRUPSURA	89.704
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.436
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	35.231
PROMIGAS	20.812
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	20.570
TGLSC	-
TITAN	7.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2.081
VILLAS	11.003

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.*