



Boletín informativo

No.030 / Marzo 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 marzo 2021 hasta el 08 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.883.000.000	251.050
CELSIA	894.000.000	190.251
CEMARGOS	2.670.000.000	462.751
CORFICOLCF	2.136.000.000	65.636
ECOPETROL	73.838.000.000	32.816.756
GEB	3.219.000.000	1.247.603
GRUPOARGOS	2.581.000.000	194.062
GRUPOSURA	6.625.000.000	279.890
ISA	7.811.000.000	328.178
NUTRESA	2.839.000.000	119.849
PFAVAL	10.212.000.000	8.595.574
PFBCOLOM	50.879.000.000	1.641.261
PFDVVNDA	3.528.000.000	112.050
PFGRUPSURA	1.738.000.000	87.328
ICOLCAP	7.685.000.000	557.210

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 02 de marzo 2021 hasta el 08 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	86.433.566
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.569.938
BAC	1.000.000.000.000	49.820.806
BBVACOL	22.000.000	72.460
BCOLOMBIA	7.883.000.000	251.050
BMC	3.000.000	2.266
BOGOTA	586.000.000	7.419





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	375.000.000	31.859
C	1.000.000.000.000	19.864.997
CARTON	34.000.000	3.470
CELSIA	894.000.000	190.251
CEMARGOS	2.670.000.000	462.751
CLH	545.000.000	132.873
CNEC	1.318.000.000	129.941
COLTEJER	1.000.000	762
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	256.000.000	508.580
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32.000.000	63.215
CORFICOLCF	2.136.000.000	65.636
CREDIFAMI	873.000.000	327.479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	73.838.000.000	32.816.756
ELCONDOR	67.000.000	61.277
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	79.000.000	6.062.299
ESTRA	-	-
ETB	212.000.000	939.629
EXITO	141.000.000	10.326
FABRICATO	11.000.000	2.365.722
FAMILIA	24.000.000	5.257
FB	1.000.000.000.000	18.112.760
FGNTOLIMA	-	-





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	76.512.784
GEB	3.219.000.000	1.247.603
GRUBOLIVAR	195.000.000	3.060
GRUPOARGOS	2.581.000.000	194.062
GRUPOAVAL	69.000.000	58.882
GRUPOSURA	6.625.000.000	279.890
HCOLSEL	4.093.000.000	326.457
ICOLCAP	7.685.000.000	557.210
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.811.000.000	328.178
JNJ	1.000.000.000.000	7.234.279
JPM	1.000.000.000.000	13.251.101
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	517.000.000	127.018
MOAT	75.595.000.000	319.261
NUTRESA	2.839.000.000	119.849
OCCIDENTE	80.000.000	2.382
ORBIS	-	-
PAZRIO	2.000.000	188.882
PFAVAL	10.212.000.000	8.595.574
PFAVH	30.000.000	188.790
PFBBVACOL	-	-
PFBCELOM	50.879.000.000	1.641.261
PFCARPAK	16.000.000	3.000
PFCMARGOS	331.000.000	78.230



**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	437.000.000	16.379
PFDVVVDA	3.528.000.000	112.050
PFE	1.000.000.000.000	33.374.118
PFGRUPOARG	412.000.000	41.983
PFGRUPSURA	1.738.000.000	87.328
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11.000.000	2.436
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	10.000.000	35.231
PROMIGAS	334.000.000	43.366
PROTECCION	42.000.000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	153.000.000	19.616
TGLSC	-	-
TITAN	119.000.000	7.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10.000.000	2.081
VILLAS	52.000.000	10.333

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

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	86.433.566
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	3.569.938
BAC	49.820.806
BBVACOL	72.460
BCOLOMBIA	251.050
BMC	2.266
BOGOTA	7.419
BVC	31.859
C	19.864.997
CARTON	3.470
CELSIA	190.251
CEMARGOS	462.751
CLH	132.873
CNEC	129.941
COLTEJER	762
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	508.580
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63.215
CORFICOLCF	65.636
CREDIFAMI	327.479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	32.816.756
ELCONDOR	61.277
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6.062.299
ESTRA	-
ETB	939.629



**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	10.326
FABRICATO	2.365.722
FAMILIA	5.257
FB	18.112.760
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	76.512.784
GEB	1.247.603
GRUBOLIVAR	3.060
GRUPOARGOS	194.062
GRUPOAVAL	58.882
GRUPOSURA	279.890
HCOLSEL	326.457
ICOLCAP	557.210
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	328.178
JNJ	7.234.279
JPM	13.251.101
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	127.018
MOAT	319.261
NUTRESA	119.849
OCCIDENTE	2.382
ORBIS	-
PAZRIO	188.882
PFAVAL	8.595.574
PFAVH	188.790



**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	1.641.261
PFCARPAK	3.000
PFCEMARGOS	78.230
PFCORFICOL	16.379
PFDVVNDA	112.050
PFE	33.374.118
PFGRUPOARG	41.983
PFGRUPSURA	87.328
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.436
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	35.231
PROMIGAS	43.366
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	19.616
TGLSC	-
TITAN	7.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2.081
VILLAS	10.333

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.*