



Boletín informativo

No.040 / Marzo 23 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 24 de marzo 2021 hasta el 29 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,265,000,000	248,798
CELSIA	971,000,000	203,134
CEMARGOS	1,938,000,000	399,669
CORFICOLCF	2,133,000,000	66,668
ECOPETROL	79,122,000,000	33,384,721
GEB	5,048,000,000	1,993,539
GRUPOARGOS	1,904,000,000	166,978
GRUPOSURA	6,047,000,000	277,115
ISA	7,680,000,000	325,405
NUTRESA	3,266,000,000	131,540
PFAVAL	8,989,000,000	7,871,453
PFBCOLOM	45,106,000,000	1,503,528
PFDVVNDA	3,735,000,000	126,173
PFGRUPSURA	1,216,000,000	64,868
ICOLCAP	7,722,000,000	575,035

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 24 de marzo 2021 hasta el 29 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	89,496,395
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,557,027
BAC	1,000,000,000,000	53,267,023
BBVACOL	20,000,000	65,346
BCOLOMBIA	7,265,000,000	248,798
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	441,000,000	5,631



**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	454,000,000	37,269
C	1,000,000,000,000	20,051,798
CARTON	26,000,000	2,664
CELSIA	971,000,000	203,134
CEMARGOS	1,938,000,000	399,669
CLH	218,000,000	54,808
CNEC	1,185,000,000	117,881
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	238,000,000	505,970
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,133,000,000	66,668
CREDIFAMI	873,000,000	327,479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	79,122,000,000	33,384,721
ELCONDOR	51,000,000	48,883
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	102,000,000	6,569,001
ESTRA	-	-
ETB	203,000,000	942,486
EXITO	153,000,000	11,345
FABRICATO	10,000,000	2,141,889
FAMILIA	17,000,000	3,781
FB	1,000,000,000,000	19,008,740
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	84,390,370
GEB	5,048,000,000	1,993,539
GRUBOLIVAR	132,000,000	2,091
GRUPOARGOS	1,904,000,000	166,978
GRUPOAVAL	64,000,000	56,508
GRUPOSURA	6,047,000,000	277,115
HCOLSEL	4,032,000,000	327,055
ICOLCAP	7,722,000,000	575,035
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,680,000,000	325,405
JNJ	1,000,000,000,000	7,466,028
JPM	1,000,000,000,000	14,500,230
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	527,000,000	126,025
MOAT	83,307,000,000	341,957
NUTRESA	3,266,000,000	131,540
OCCIDENTE	50,000,000	1,479
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	197,651
PFAVAL	8,989,000,000	7,871,453
PFAVH	23,000,000	142,856
PFBVACOL	-	-
PFBLOM	45,106,000,000	1,503,528
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCMARGOS	265,000,000	66,811



**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	189,000,000	7,261
PFDVVNDA	3,735,000,000	126,173
PFE	1,000,000,000,000	32,285,598
PFGRUPOARG	300,000,000	31,591
PFGRUPSURA	1,216,000,000	64,868
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11,000,000	2,550
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6,000,000	1,483
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	313,000,000	42,881
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	103,000,000	13,211
TGLSC	-	-
TITAN	119,000,000	7,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10,000,000	2,196
VILLAS	33,000,000	6,507

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 24 de marzo 2021 hasta el 29 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	89,496,395
AGROCHAL	-





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AMZN	3,557,027
BAC	53,267,023
BBVACOL	65,346
BCOLOMBIA	248,798
BMC	2,266
BOGOTA	5,631
BVC	37,269
C	20,051,798
CARTON	2,664
CELSIA	203,134
CEMARGOS	399,669
CLH	54,808
CNEC	117,881
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	505,970
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	66,668
CREDIFAMI	327,479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	33,384,721
ELCONDOR	48,883
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,569,001
ESTRA	-
ETB	942,486



**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	11,345
FABRICATO	2,141,889
FAMILIA	3,781
FB	19,008,740
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	84,390,370
GEB	1,993,539
GRUBOLIVAR	2,091
GRUPOARGOS	166,978
GRUPOAVAL	56,508
GRUPOSURA	277,115
HCOLSEL	327,055
ICOLCAP	575,035
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	325,405
JNJ	7,466,028
JPM	14,500,230
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	126,025
MOAT	341,957
NUTRESA	131,540
OCCIDENTE	1,479
ORBIS	-
PAZRIO	197,651
PFAVAL	7,871,453
PFAVH	142,856





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,503,528
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	66,811
PFCORFICOL	7,261
PFDVVNDA	126,173
PFE	32,285,598
PFGRUPOARG	31,591
PFGRUPSURA	64,868
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,550
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,483
POPULAR	35,307
PROMIGAS	42,881
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	13,211
TGLSC	-
TITAN	7,000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2,196
VILLAS	6,507

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.*