



Boletín informativo

No.054 / Abril 12 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 13 de abril 2021 hasta el 19 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,125,000,000	264,645
CELSIA	1,015,000,000	218,258
CEMARGOS	2,251,000,000	416,923
CORFICOLCF	2,065,000,000	63,926
ECOPETROL	72,595,000,000	32,121,534
GEB	4,841,000,000	1,840,675
GRUPOARGOS	1,944,000,000	166,154
GRUPOSURA	5,707,000,000	268,430
ISA	7,343,000,000	325,354
NUTRESA	3,085,000,000	133,570
PFAVAL	8,663,000,000	7,526,397
PFBCOLOM	45,153,000,000	1,475,595
PFDVVNDA	3,911,000,000	127,196
PFGRUPSURA	987,000,000	52,654
ICOLCAP	7,320,000,000	544,640

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de abril 2021 hasta el 19 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	91,526,681
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,493,996
BAC	1,000,000,000,000	52,623,493
BBVACOL	15,000,000	50,690
BCOLOMBIA	8,125,000,000	264,645
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	455,000,000	5,914



**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	492,000,000	41,019
C	1,000,000,000,000	19,293,698
CARTON	26,000,000	2,664
CELSIA	1,015,000,000	218,258
CEMARGOS	2,251,000,000	416,923
CLH	101,000,000	26,199
CNEC	1,241,000,000	117,319
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	239,000,000	508,267
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,065,000,000	63,926
CREDIFAMI	724,000,000	273,418
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	72,595,000,000	32,121,534
ELCONDOR	44,000,000	42,737
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	97,000,000	6,557,155
ESTRA	-	-
ETB	199,000,000	903,859
EXITO	150,000,000	11,545
FABRICATO	12,000,000	2,585,254
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-



**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
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	81,364,896
GEB	4,841,000,000	1,840,675
GRUBOLIVAR	282,000,000	3,927
GRUPOARGOS	1,944,000,000	166,154
GRUPOAVAL	53,000,000	45,760
GRUPOSURA	5,707,000,000	268,430
HCOLSEL	4,223,000,000	343,323
ICOLCAP	7,320,000,000	544,640
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,343,000,000	325,354
JNJ	1,000,000,000,000	7,248,520
JPM	1,000,000,000,000	14,570,451
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	542,000,000	126,121
MOAT	94,718,000,000	364,292
NUTRESA	3,085,000,000	133,570
OCCIDENTE	46,000,000	1,364
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	197,651
PFAVAL	8,663,000,000	7,526,397
PFAVH	19,000,000	121,704
PFBVACOL	-	-
PFBCELOM	45,153,000,000	1,475,595
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCMARGOS	211,000,000	52,010
PFCORFICOL	215,000,000	7,959



**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
PFDVVVDA	3,911,000,000	127,196
PFE	1,000,000,000,000	31,348,336
PFGRUPOARG	241,000,000	24,823
PFGRUPSURA	987,000,000	52,654
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11,000,000	2,550
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6,000,000	1,483
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	336,000,000	44,165
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	97,000,000	12,317
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10,000,000	2,003
VILLAS	17,000,000	3,447

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de abril 2021 hasta el 19 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	91,526,681
AGROCHAL	-
AMZN	3,493,996





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
BAC	52,623,493
BBVACOL	50,690
BCOLOMBIA	264,645
BMC	2,266
BOGOTA	5,914
BVC	41,019
C	19,293,698
CARTON	2,664
CELSIA	218,258
CEMARGOS	416,923
CLH	26,199
CNEC	117,319
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	508,267
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	63,926
CREDIFAMI	273,418
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	32,121,534
ELCONDOR	42,737
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,557,155
ESTRA	-
ETB	903,859
EXITO	11,545



**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
FABRICATO	2,585,254
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	81,364,896
GEB	1,840,675
GRUBOLIVAR	3,927
GRUPOARGOS	166,154
GRUPOAVAL	45,760
GRUPOSURA	268,430
HCOLSEL	343,323
ICOLCAP	544,640
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	325,354
JNJ	7,248,520
JPM	14,570,451
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	126,121
MOAT	364,292
NUTRESA	133,570
OCCIDENTE	1,364
ORBIS	-
PAZRIO	197,651
PFAVAL	7,526,397
PFAVH	121,704
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,475,595



**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
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	52,010
PFCORFICOL	7,959
PFDVVVND	127,196
PFE	31,348,336
PFGRUPOARG	24,823
PFGRUPSURA	52,654
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,550
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,483
POPULAR	35,307
PROMIGAS	44,165
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	12,317
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2,003
VILLAS	3,447

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías