



Boletín informativo

No.059 / Abril 19 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 20 de abril 2021 hasta el 26 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,910,000,000	260,708
CELSIA	1,000,000,000	217,378
CEMARGOS	2,179,000,000	416,622
CORFICOLCF	2,091,000,000	64,135
ECOPETROL	73,136,000,000	31,784,311
GEB	4,757,000,000	1,816,948
GRUPOARGOS	1,855,000,000	161,058
GRUPOSURA	5,293,000,000	258,199
ISA	7,338,000,000	324,112
NUTRESA	3,142,000,000	138,397
PFAVAL	8,394,000,000	7,229,793
PFBCOLOM	44,173,000,000	1,448,776
PFDAVVNDA	3,943,000,000	126,375
PFGRUPSURA	915,000,000	49,815
ICOLCAP	7,485,000,000	557,301

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de abril 2021 hasta el 26 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	92,349,317
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,470,088
BAC	1,000,000,000,000	53,477,863
BBVACOL	14,000,000	47,127
BCOLOMBIA	7,910,000,000	260,708
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	455,000,000	5,908
BVC	503,000,000	40,784
C	1,000,000,000,000	19,004,823
CARTON	26,000,000	2,664





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CELSIA	1,000,000,000	217,378
CEMARGOS	2,179,000,000	416,622
CLH	97,000,000	24,431
CNEC	1,195,000,000	111,727
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	209,000,000	456,491
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,091,000,000	64,135
CREDIFAMI	724,000,000	273,418
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	73,136,000,000	31,784,311
ELCONDOR	43,000,000	41,159
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	118,000,000	7,820,886
ESTRA	-	-
ETB	189,000,000	858,665
EXITO	130,000,000	10,829
FABRICATO	11,000,000	2,482,164
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	79,744,077
GEB	4,757,000,000	1,816,948
GRUBOLIVAR	280,000,000	3,941
GRUPOARGOS	1,855,000,000	161,058
GRUPOAVAL	52,000,000	44,615
GRUPOSURA	5,293,000,000	258,199



**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
HCOLSEL	5,028,000,000	407,937
ICOLCAP	7,485,000,000	557,301
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,338,000,000	324,112
JNJ	1,000,000,000,000	7,225,197
JPM	1,000,000,000,000	14,361,229
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	546,000,000	128,801
MOAT	95,379,000,000	366,950
NUTRESA	3,142,000,000	138,397
OCCIDENTE	91,000,000	2,669
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	334,485
PFAVAL	8,394,000,000	7,229,793
PFAVH	24,000,000	199,545
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	44,173,000,000	1,448,776
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	199,000,000	51,081
PFCORFICOL	255,000,000	9,552
PFDVVNDA	3,943,000,000	126,375
PFE	1,000,000,000,000	31,199,358
PFGRUPOARG	250,000,000	25,536
PFGRUPSURA	915,000,000	49,815
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	12,000,000	2,697
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	3,000,000	793



**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
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	325,000,000	43,648
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	93,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,900
VILLAS	16,000,000	3,245

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de abril 2021 hasta el 26 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	92,349,317
AGROCHAL	-
AMZN	3,470,088
BAC	53,477,863
BBVACOL	47,127
BCOLOMBIA	260,708
BMC	2,266
BOGOTA	5,908
BVC	40,784
C	19,004,823
CARTON	2,664
CELSIA	217,378
CEMARGOS	416,622
CLH	24,431
CNEC	111,727
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-



**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
CONCRET	456,491
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,135
CREDIFAMI	273,418
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	31,784,311
ELCONDOR	41,159
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,820,886
ESTRA	-
ETB	858,665
EXITO	10,829
FABRICATO	2,482,164
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	79,744,077
GEB	1,816,948
GRUBOLIVAR	3,941
GRUPOARGOS	161,058
GRUPOAVAL	44,615
GRUPOSURA	258,199
HCOLSEL	407,937
ICOLCAP	557,301
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	324,112
JNJ	7,225,197
JPM	14,361,229
MARLY	-



**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
MAYAGUEZ	-
MINEROS	128,801
MOAT	366,950
NUTRESA	138,397
OCCIDENTE	2,669
ORBIS	-
PAZRIO	334,485
PFAVAL	7,229,793
PFAVH	199,545
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,448,776
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	51,081
PFCORFICOL	9,552
PFDVVNDA	126,375
PFE	31,199,358
PFGRUPOARG	25,536
PFGRUPSURA	49,815
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,697
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	793
POPULAR	35,307
PROMIGAS	43,648
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,900
VILLAS	3,245



**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

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías

