



Boletín informativo

No.064 / Mayo 03 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 04 de mayo de 2021 hasta el 10 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,126,000,000	255,213
CELSIA	937,000,000	217,289
CEMARGOS	2,292,000,000	446,775
CORFICOLCF	2,068,000,000	64,582
ECOPETROL	68,909,000,000	31,180,441
GEB	4,702,000,000	1,801,383
GRUPOARGOS	1,781,000,000	168,187
GRUPOSURA	4,999,000,000	260,913
ISA	7,238,000,000	338,532
NUTRESA	3,040,000,000	141,396
PFAVAL	7,855,000,000	7,108,619
PFBCOLOM	37,745,000,000	1,348,024
PFDAVVNDA	3,759,000,000	128,264
PFGRUPSURA	841,000,000	49,627
ICOLCAP	7,621,000,000	600,850

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de mayo de 2021 hasta el 10 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	94,671,010
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,569,740
BAC	1,000,000,000,000	52,244,732
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,126,000,000	255,213
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	467,000,000	5,948
BVC	471,000,000	39,453
C	1,000,000,000,000	18,578,013
CARTON	29,000,000	2,989



**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
CELSIA	937,000,000	217,289
CEMARGOS	2,292,000,000	446,775
CLH	89,000,000	22,834
CNEC	1,122,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,894
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	123,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,068,000,000	64,582
CREDIFAMI	529,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	68,909,000,000	31,180,441
ELCONDOR	40,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	116,000,000	7,666,031
ESTRA	-	-
ETB	184,000,000	842,975
EXITO	126,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	76,076,683
GEB	4,702,000,000	1,801,383
GRUBOLIVAR	284,000,000	3,931
GRUPOARGOS	1,781,000,000	168,187
GRUPOAVAL	45,000,000	38,515
GRUPOSURA	4,999,000,000	260,913
HCOLSEL	5,062,000,000	432,810
ICOLCAP	7,621,000,000	600,850



**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
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,238,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,107,999
JPM	1,000,000,000,000	14,207,736
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	542,000,000	131,289
MOAT	100,531,000,000	372,284
NUTRESA	3,040,000,000	141,396
OCCIDENTE	100,000,000	2,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	345,776
PFAVAL	7,855,000,000	7,108,619
PFAVH	24,000,000	206,473
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	37,745,000,000	1,348,024
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	186,000,000	48,346
PFCORFICOL	248,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,759,000,000	128,264
PFE	1,000,000,000,000	29,885,811
PFGRUPOARG	215,000,000	24,701
PFGRUPSURA	841,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,481
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	309,000,000	41,661
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-



**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
SANFELIPE	-	-
TERPEL	89,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,987
VILLAS	17,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de mayo de 2021 hasta el 10 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	94,671,010
AGROCHAL	-
AMZN	3,569,740
BAC	52,244,732
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	255,213
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	39,453
C	18,578,013
CARTON	2,989
CELSIA	217,289
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,894
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,582
CREDIFAMI	199,159



**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
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	31,180,441
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,666,031
ESTRA	-
ETB	842,975
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	76,076,683
GEB	1,801,383
GRUBOLIVAR	3,931
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	432,810
ICOLCAP	600,850
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,107,999
JPM	14,207,736
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	131,289
MOAT	372,284
NUTRESA	141,396
OCCIDENTE	2,951



**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
DESCAUCANO	-
PAZRIO	345,776
PFAVAL	7,108,619
PFAVH	206,473
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,348,024
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDVVNDA	128,264
PFE	29,885,811
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	2,481
PVILLAS00	-
PVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	41,661
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,987
VILLAS	3,328

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.*