



Boletín informativo

No.067 / Mayo 10 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 11 de mayo de 2021 hasta el 18 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,511,000,000	259,540
CELSIA	946,000,000	217,047
CEMARGOS	2,457,000,000	446,775
CORFICOLCF	2,137,000,000	64,802
ECOPETROL	70,935,000,000	31,002,859
GEB	4,675,000,000	1,809,969
GRUPOARGOS	1,901,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,401,000,000	260,913
ISA	7,190,000,000	338,532
NUTRESA	3,177,000,000	141,206
PFAVAL	7,942,000,000	7,285,848
PFBCOLOM	41,346,000,000	1,429,187
PFDAVVNDA	3,958,000,000	128,589
PFGRUPSURA	886,000,000	49,627
ICOLCAP	7,805,000,000	602,670

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 11 de mayo de 2021 hasta el 18 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	95,594,526
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,546,275
BAC	1,000,000,000,000	51,823,883
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,511,000,000	259,540
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	446,000,000	5,948
BVC	463,000,000	40,228
C	1,000,000,000,000	18,763,179
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	946,000,000	217,047
CEMARGOS	2,457,000,000	446,775
CLH	86,000,000	22,834
CNEC	1,132,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	123,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,137,000,000	64,802
CREDIFAMI	529,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	70,935,000,000	31,002,859
ELCONDOR	35,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	115,000,000	7,682,052
ESTRA	-	-
ETB	179,000,000	842,975
EXITO	136,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	75,905,396
GEB	4,675,000,000	1,809,969
GRUBOLIVAR	322,000,000	4,200
GRUPOARGOS	1,901,000,000	168,187
GRUPOAVAL	45,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,401,000,000	260,913
HCOLSEL	5,077,000,000	426,049
ICOLCAP	7,805,000,000	602,670



**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	7,190,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,119,443
JPM	1,000,000,000,000	14,315,476
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	563,000,000	131,883
MOAT	103,278,000,000	375,582
NUTRESA	3,177,000,000	141,206
OCCIDENTE	100,000,000	2,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	345,776
PFAVAL	7,942,000,000	7,285,848
PFAVH	29,000,000	227,635
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	41,346,000,000	1,429,187
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	192,000,000	48,346
PFCORFICOL	250,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,958,000,000	128,589
PFE	1,000,000,000,000	30,463,275
PFGRUPOARG	225,000,000	24,701
PFGRUPSURA	886,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,459
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	299,000,000	39,614
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	87,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,913
VILLAS	15,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 11 de mayo de 2021 hasta el 18 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	95,594,526
AGROCHAL	-
AMZN	3,546,275
BAC	51,823,883
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	259,540
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	40,228
C	18,763,179
CARTON	2,989
CELSIA	217,047
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,802
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	31,002,859
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,682,052
ESTRA	-
ETB	842,975
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	75,905,396
GEB	1,809,969
GRUBOLIVAR	4,200
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	426,049
ICOLCAP	602,670
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,119,443
JPM	14,315,476
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	131,883
MOAT	375,582
NUTRESA	141,206
OCCIDENTE	2,951





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
DESCAUCANO	-
PAZRIO	345,776
PFAVAL	7,285,848
PFAVH	227,635
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,429,187
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDAVVNDA	128,589
PFE	30,463,275
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,459
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	39,614
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,913
VILLAS	3,328

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías