



Boletín informativo

No.071 / Mayo 18 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 19 de mayo de 2021 hasta el 24 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,766,000,000	268,167
CELSIA	954,000,000	216,715
CEMARGOS	2,415,000,000	446,775
CORFICOLCF	2,005,000,000	65,310
ECOPETROL	73,982,000,000	30,993,715
GEB	4,791,000,000	1,814,885
GRUPOARGOS	1,897,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,161,000,000	260,913
ISA	7,278,000,000	338,532
NUTRESA	3,216,000,000	141,672
PFAVAL	8,034,000,000	7,205,091
PFBCOLOM	43,884,000,000	1,497,742
PFDAVVNDA	4,044,000,000	129,606
PFGRUPSURA	893,000,000	49,627
ICOLCAP	7,997,000,000	610,454

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de mayo de 2021 hasta el 24 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	96,885,489
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,620,551
BAC	1,000,000,000,000	50,535,833
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,766,000,000	268,167
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	443,000,000	5,948
BVC	497,000,000	42,469
C	1,000,000,000,000	19,236,589
CARTON	35,000,000	3,566



**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	954,000,000	216,715
CEMARGOS	2,415,000,000	446,775
CLH	88,000,000	22,834
CNEC	1,082,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	130,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,005,000,000	65,310
CREDIFAMI	529,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	73,982,000,000	30,993,715
ELCONDOR	39,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	125,000,000	7,733,344
ESTRA	-	-
ETB	174,000,000	809,430
EXITO	133,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	77,028,987
GEB	4,791,000,000	1,814,885
GRUBOLIVAR	322,000,000	4,273
GRUPOARGOS	1,897,000,000	168,187
GRUPOAVAL	43,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,161,000,000	260,913
HCOLSEL	4,934,000,000	409,112
ICOLCAP	7,997,000,000	610,454



**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	7,278,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,142,773
JPM	1,000,000,000,000	13,949,868
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	566,000,000	131,177
MOAT	100,585,000,000	375,009
NUTRESA	3,216,000,000	141,672
OCCIDENTE	100,000,000	2,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	386,830
PFAVAL	8,034,000,000	7,205,091
PFAVH	29,000,000	222,918
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	43,884,000,000	1,497,742
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	190,000,000	48,346
PFCORFICOL	237,000,000	9,271
PFDVVNDA	4,044,000,000	129,606
PFE	1,000,000,000,000	30,201,438
PFGRUPOARG	220,000,000	24,701
PFGRUPSURA	893,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,459
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	289,000,000	39,304
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	93,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,805
VILLAS	15,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de mayo de 2021 hasta el 24 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	96,885,489
AGROCHAL	-
AMZN	3,620,551
BAC	50,535,833
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	268,167
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	42,469
C	19,236,589
CARTON	3,566
CELSIA	216,715
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	65,310
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	30,993,715
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,733,344
ESTRA	-
ETB	809,430
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	77,028,987
GEB	1,814,885
GRUBOLIVAR	4,273
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	409,112
ICOLCAP	610,454
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,142,773
JPM	13,949,868
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	131,177
MOAT	375,009
NUTRESA	141,672
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	386,830
PFAVAL	7,205,091
PFAVH	222,918
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,497,742
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDAVVNDA	129,606
PFE	30,201,438
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,459
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	39,304
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,805
VILLAS	3,328

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías