



Boletín informativo

No.076 / Mayo 31 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 01 de junio de 2021 hasta el 07 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,321,000,000	268,167
CELSIA	966,000,000	231,376
CEMARGOS	2,270,000,000	446,775
CORFICOLCF	1,919,000,000	67,149
ECOPETROL	68,318,000,000	30,899,331
GEB	4,314,000,000	1,875,667
GRUPOARGOS	1,727,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,310,000,000	260,913
ISA	6,991,000,000	338,532
NUTRESA	3,035,000,000	144,389
PFAVAL	6,669,000,000	6,256,406
PFBCOLOM	40,094,000,000	1,434,991
PFDAVVNDA	3,962,000,000	137,110
PFGRUPSURA	866,000,000	49,627
ICOLCAP	7,569,000,000	615,246

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de junio de 2021 hasta el 07 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	98,221,163
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,603,695
BAC	1,000,000,000,000	50,351,779
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,321,000,000	268,167
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	415,000,000	5,948
BVC	521,000,000	45,356
C	1,000,000,000,000	18,896,504
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	966,000,000	231,376
CEMARGOS	2,270,000,000	446,775
CLH	84,000,000	22,834
CNEC	1,075,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,517
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	118,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,919,000,000	67,149
CREDIFAMI	527,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	68,318,000,000	30,899,331
ELCONDOR	39,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	116,000,000	7,530,513
ESTRA	-	-
ETB	144,000,000	690,540
EXITO	130,000,000	10,820
FABRICATO	13,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	77,112,700
GEB	4,314,000,000	1,875,667
GRUBOLIVAR	455,000,000	6,068
GRUPOARGOS	1,727,000,000	168,187
GRUPOAVAL	40,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,310,000,000	260,913
HCOLSEL	4,769,000,000	419,133
ICOLCAP	7,569,000,000	615,246



**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	6,991,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,110,778
JPM	1,000,000,000,000	13,991,885
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	554,000,000	139,747
MOAT	103,328,000,000	379,527
NUTRESA	3,035,000,000	144,389
OCCIDENTE	96,000,000	2,831
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	386,626
PFAVAL	6,669,000,000	6,256,406
PFAVH	32,000,000	216,236
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	40,094,000,000	1,434,991
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	172,000,000	48,346
PFCORFICOL	214,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,962,000,000	137,110
PFE	1,000,000,000,000	29,258,140
PFGRUPOARG	197,000,000	24,701
PFGRUPSURA	866,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,448
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	409,000,000	62,888
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	8,000,000	1,805
VILLAS	13,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de junio de 2021 hasta el 07 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	98,221,163
AGROCHAL	-
AMZN	3,603,695
BAC	50,351,779
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	268,167
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	45,356
C	18,896,504
CARTON	3,566
CELSIA	231,376
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,517
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	67,149
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	30,899,331
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,530,513
ESTRA	-
ETB	690,540
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	77,112,700
GEB	1,875,667
GRUBOLIVAR	6,068
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	419,133
ICOLCAP	615,246
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,110,778
JPM	13,991,885
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	139,747
MOAT	379,527
NUTRESA	144,389
OCCIDENTE	2,831



**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	386,626
PFAVAL	6,256,406
PFAVH	216,236
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,434,991
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDAVVNDA	137,110
PFE	29,258,140
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,448
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	62,888
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