



Boletín informativo

No.092 / 12 de julio 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 13 de julio de 2021 hasta el 19 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,419,000,000	264,020
CELSIA	756,000,000	181,788
CEMARGOS	2,514,000,000	447,403
CORFICOLCF	1,812,000,000	60,597
ECOPETROL	74,881,000,000	27,121,044
GEB	3,392,000,000	1,347,822
GRUPOARGOS	1,787,000,000	171,504
GRUPOSURA	4,498,000,000	230,544
ISA	8,157,000,000	349,331
NUTRESA	3,434,000,000	155,182
PFAVAL	7,180,000,000	6,526,821
PFBCOLOM	43,742,000,000	1,518,297
PFDAVVNDA	3,601,000,000	121,852
PFGRUPSURA	720,000,000	41,435
ICOLCAP	7,737,000,000	588,000

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de julio de 2021 hasta el 19 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	81,858,272
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,529,290
BAC	1,000,000,000,000	44,147,049
BBVACOL	21,000,000	71,145
BCOLOMBIA	7,419,000,000	264,020
BMC	-	-
BOGOTA	1,018,000,000	14,350
BVC	478,000,000	42,891
C	1,000,000,000,000	19,734,053
CARTON	-	-



**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	756,000,000	181,788
CEMARGOS	2,514,000,000	447,403
CLH	43,000,000	12,293
CNEC	1,445,000,000	140,332
COLTEJER	2,000,000	1,276
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	94,000,000	236,794
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,812,000,000	60,597
CREDIFAMI	942,000,000	355,851
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	74,881,000,000	27,121,044
ELCONDOR	48,000,000	53,404
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	101,000,000	6,900,319
ESTRA	1,000,000	11,697
ETB	44,000,000	221,175
EXITO	201,000,000	16,013
FABRICATO	18,000,000	4,173,517
FAMILIA	-	-
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	58,624,288
GEB	3,392,000,000	1,347,822
GRUBOLIVAR	777,000,000	11,103
GRUPOARGOS	1,787,000,000	171,504
GRUPOAVAL	81,000,000	74,315
GRUPOSURA	4,498,000,000	230,544
HCOLSEL	4,927,000,000	399,982
ICOLCAP	7,737,000,000	588,000



**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	8,157,000,000	349,331
JNJ	1,000,000,000,000	7,014,509
JPM	1,000,000,000,000	13,993,488
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	574,000,000	143,063
MOAT	107,556,000,000	374,236
NUTRESA	3,434,000,000	155,182
OCCIDENTE	85,000,000	2,505
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	319,147
PFAVAL	7,180,000,000	6,526,821
PFAVH	96,000,000	318,742
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	43,742,000,000	1,518,297
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	176,000,000	45,201
PFCORFICOL	239,000,000	10,055
PFDVVNDA	3,601,000,000	121,852
PFE	1,000,000,000,000	25,835,634
PFGRUPOARG	224,000,000	26,522
PFGRUPSURA	720,000,000	41,435
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	6,000,000	1,255
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	3,000,000	10,661
PROMIGAS	459,000,000	66,305
PROTECCION	-	-
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	83,000,000	11,520
TGLSC	-	-
TITAN	24,000,000	1,544
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	5,000,000	983
VILLAS	28,000,000	6,604

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 13 de julio de 2021 hasta el 19 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,858,272
AGROCHAL	-
AMZN	3,529,290
BAC	44,147,049
BBVACOL	71,145
BCOLOMBIA	264,020
BMC	-
BOGOTA	14,350
BVC	42,891
C	19,734,053
CARTON	-
CELSIA	181,788
CEMARGOS	447,403
CLH	12,293
CNEC	140,332
COLTEJER	1,276
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	236,794
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	60,597
CREDIFAMI	355,851



**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	27,121,044
ELCONDOR	53,404
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,900,319
ESTRA	11,697
ETB	221,175
EXITO	16,013
FABRICATO	4,173,517
FAMILIA	-
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	58,624,288
GEB	1,347,822
GRUBOLIVAR	11,103
GRUPOARGOS	171,504
GRUPOAVAL	74,315
GRUPOSURA	230,544
HCOLSEL	399,982
ICOLCAP	588,000
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	349,331
JNJ	7,014,509
JPM	13,993,488
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	143,063
MOAT	374,236
NUTRESA	155,182
OCCIDENTE	2,505





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ORBIS	-
PAZRIO	319,147
PFAVAL	6,526,821
PFAVH	318,742
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,518,297
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	45,201
PFCORFICOL	10,055
PFDAVVNDA	121,852
PFE	25,835,634
PFGRUPOARG	26,522
PFGRUPSURA	41,435
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1,255
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	10,661
PROMIGAS	66,305
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,520
TGLSC	-
TITAN	1,544
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	983
VILLAS	6,604

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías