



Boletín informativo

No.115 / 30 de agosto 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 31 de agosto de 2021 hasta el 06 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,944,000,000	190,080
CELSIA	655,000,000	153,385
CEMARGOS	2,848,000,000	489,421
CORFICOLCF	2,196,000,000	73,453
ECOPETROL	67,438,000,000	26,592,268
GEB	2,604,000,000	964,487
GRUPOARGOS	1,350,000,000	121,621
GRUPOSURA	4,300,000,000	220,501
ISA	6,386,000,000	272,315
NUTRESA	2,110,000,000	92,124
PFAVAL	11,205,000,000	10,013,733
PFBCOLOM	45,486,000,000	1,450,458
PFDVVNDA	3,062,000,000	94,287
PFGRUPSURA	587,000,000	32,638
ICOLCAP	5,829,000,000	432,194

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 31 de agosto de 2021 hasta el 06 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	74,017,188
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,229,963
BAC	1,000,000,000,000	46,211,159
BBVACOL	10,000,000	32,010
BCOLOMBIA	5,944,000,000	190,080
BMC	7,000,000	4,051
BOGOTA	550,000,000	7,592
BVC	366,000,000	35,891
C	1,000,000,000,000	19,446,977
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	655,000,000	153,385
CEMARGOS	2,848,000,000	489,421
CLH	34,000,000	9,492
CNEC	748,000,000	80,902
COLTEJER	2,000,000	1,458
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	75,000,000	195,356
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,196,000,000	73,453
CREDIFAMI	966,000,000	386,443
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	67,438,000,000	26,592,268
ELCONDOR	50,000,000	55,692
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	59,000,000	3,471,120
ESTRA	1,000,000	11,697
ETB	32,000,000	163,650
EXITO	172,000,000	13,726
FABRICATO	31,000,000	5,140,563
FAMILIA	-	-
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	32,183,624
GEB	2,604,000,000	964,487
GRUBOLIVAR	189,000,000	2,701
GRUPOARGOS	1,350,000,000	121,621
GRUPOAVAL	98,000,000	88,654
GRUPOSURA	4,300,000,000	220,501
HCOLSEL	2,221,000,000	176,584
ICOLCAP	5,829,000,000	432,194



**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	6,386,000,000	272,315
JNJ	1,000,000,000,000	5,987,725
JPM	1,000,000,000,000	12,853,829
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	403,000,000	104,912
MOAT	-	374,835
NUTRESA	2,110,000,000	92,124
OCCIDENTE	-	-
ORBIS	-	-
PAZRIO	1,000,000	86,864
PFAVAL	11,205,000,000	10,013,733
PFAVH	81,000,000	339,149
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	45,486,000,000	1,450,458
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	152,000,000	36,832
PFCORFICOL	187,000,000	7,848
PFDAVVNDA	3,062,000,000	94,287
PFE	1,000,000,000,000	29,832,623
PFGRUPOARG	191,000,000	22,170
PFGRUPSURA	587,000,000	32,638
PFVILLA051	1,000,000	215
PFVILLA053	3,000,000	1,794
PFVILLAS	5,000,000	1,371
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	1,000,000	166
POPULAR	3,000,000	9,279
PROMIGAS	295,000,000	39,902
PROTECCION	61,000,000	503
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	104,000,000	13,559
TGLSC	-	-
TITAN	57,000,000	3,362
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	16,000,000	2,450
VILLAS	29,000,000	6,791

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 31 de agosto de 2021 hasta el 06 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías