



Boletín informativo

No.049 / Marzo 29 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 30 de marzo 2021 hasta el 05 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,551,000,000	255,980
CELSIA	1,024,000,000	216,378
CEMARGOS	2,036,000,000	405,483
CORFICOLCF	2,097,000,000	64,932
ECOPETROL	77,565,000,000	32,992,385
GEB	4,827,000,000	1,854,478
GRUPOARGOS	1,979,000,000	171,060
GRUPOSURA	5,968,000,000	274,370
ISA	7,153,000,000	320,754
NUTRESA	3,134,000,000	135,028
PFAVAL	9,067,000,000	7,911,688
PFBCELOM	43,678,000,000	1,475,110
PFDVVNDA	4,057,000,000	133,295
PFGROUPSURA	1,087,000,000	57,855
ICOLCAP	7,658,000,000	569,363

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 30 de marzo 2021 hasta el 05 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	89,789,266
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,620,769
BAC	1,000,000,000,000	53,273,443
BBVACOL	20,000,000	66,021
BCOLOMBIA	7,551,000,000	255,980
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	478,000,000	6,062



**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
BVC	458,000,000	37,754
C	1,000,000,000,000	19,956,907
CARTON	26,000,000	2,664
CELSIA	1,024,000,000	216,378
CEMARGOS	2,036,000,000	405,483
CLH	193,000,000	47,636
CNEC	1,179,000,000	113,870
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	244,000,000	509,885
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,097,000,000	64,932
CREDIFAMI	873,000,000	327,479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	77,565,000,000	32,992,385
ELCONDOR	49,000,000	46,875
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	104,000,000	6,705,832
ESTRA	-	-
ETB	207,000,000	949,032
EXITO	155,000,000	11,348
FABRICATO	11,000,000	2,350,654
FAMILIA	17,000,000	3,781
FB	-	18,924,589
FGNTOLIMA	-	-



**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
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	84,327,223
GEB	4,827,000,000	1,854,478
GRUBOLIVAR	129,000,000	2,024
GRUPOARGOS	1,979,000,000	171,060
GRUPOAVAL	71,000,000	62,602
GRUPOSURA	5,968,000,000	274,370
HCOLSEL	3,887,000,000	317,188
ICOLCAP	7,658,000,000	569,363
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,153,000,000	320,754
JNJ	1,000,000,000,000	7,483,405
JPM	1,000,000,000,000	14,553,478
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	532,000,000	124,383
MOAT	87,830,000,000	344,479
NUTRESA	3,134,000,000	135,028
OCCIDENTE	50,000,000	1,479
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	197,651
PFAVAL	9,067,000,000	7,911,688
PFAVH	23,000,000	141,072
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	43,678,000,000	1,475,110
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	247,000,000	61,703



**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
PFCORFICOL	182,000,000	6,779
PFDAVVNDA	4,057,000,000	133,295
PFE	1,000,000,000,000	31,915,542
PFGRUPOARG	266,000,000	28,289
PFGRUPSURA	1,087,000,000	57,855
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11,000,000	2,550
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6,000,000	1,483
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	329,000,000	43,249
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	102,000,000	13,167
TGLSC	-	-
TITAN	119,000,000	7,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10,000,000	2,196
VILLAS	21,000,000	4,290

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 30 de marzo 2021 hasta el 05 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	89,789,266
AGROCHAL	-



**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
AMZN	3,620,769
BAC	53,273,443
BBVACOL	66,021
BCOLOMBIA	255,980
BMC	2,266
BOGOTA	6,062
BVC	37,754
C	19,956,907
CARTON	2,664
CELSIA	216,378
CEMARGOS	405,483
CLH	47,636
CNEC	113,870
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	509,885
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,932
CREDIFAMI	327,479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	32,992,385
ELCONDOR	46,875
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,705,832
ESTRA	-
ETB	949,032



**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
EXITO	11,348
FABRICATO	2,350,654
FAMILIA	3,781
FB	18,924,589
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	84,327,223
GEB	1,854,478
GRUBOLIVAR	2,024
GRUPOARGOS	171,060
GRUPOAVAL	62,602
GRUPOSURA	274,370
HCOLSEL	317,188
ICOLCAP	569,363
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	320,754
JNJ	7,483,405
JPM	14,553,478
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	124,383
MOAT	344,479
NUTRESA	135,028
OCCIDENTE	1,479
ORBIS	-
PAZRIO	197,651
PFAVAL	7,911,688
PFAVH	141,072



**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
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,475,110
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	61,703
PFCORFICOL	6,779
PFDVVNDA	133,295
PFE	31,915,542
PFGRUPOARG	28,289
PFGRUPSURA	57,855
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,550
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,483
POPULAR	35,307
PROMIGAS	43,249
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	13,167
TGLSC	-
TITAN	7,000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2,196
VILLAS	4,290

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías



**CÁMARA
DE RIESGO**
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de
las transacciones generando
seguridad y transparencia al
mercado de capitales colombiano.*