



Boletín informativo

No.052 / Abril 05 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 06 de abril 2021 hasta el 12 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,394,000,000	257,198
CELSIA	1,003,000,000	215,680
CEMARGOS	2,008,000,000	389,832
CORFICOLCF	2,100,000,000	64,153
ECOPETROL	76,993,000,000	32,541,363
GEB	4,959,000,000	1,843,321
GRUPOARGOS	1,984,000,000	168,449
GRUPOSURA	5,937,000,000	273,607
ISA	7,226,000,000	321,175
NUTRESA	3,081,000,000	132,971
PFAVAL	8,853,000,000	7,738,971
PFBCOLOM	43,012,000,000	1,474,008
PFDVVNDA	3,925,000,000	131,489
PFGRUPSURA	1,047,000,000	55,299
ICOLCAP	7,470,000,000	554,578

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 06 de abril 2021 hasta el 12 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	90,378,176
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,529,104
BAC	1,000,000,000,000	54,242,832
BBVACOL	19,000,000	64,290
BCOLOMBIA	7,394,000,000	257,198
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	459,000,000	5,889



**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	483,000,000	40,201
C	1,000,000,000,000	20,164,731
CARTON	26,000,000	2,664
CELSIA	1,003,000,000	215,680
CEMARGOS	2,008,000,000	389,832
CLH	152,000,000	38,112
CNEC	1,382,000,000	132,651
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	242,000,000	510,027
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,100,000,000	64,153
CREDIFAMI	873,000,000	327,479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	76,993,000,000	32,541,363
ELCONDOR	48,000,000	45,907
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	103,000,000	6,667,919
ESTRA	-	-
ETB	206,000,000	934,204
EXITO	152,000,000	11,141
FABRICATO	12,000,000	2,576,885
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-



**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
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	84,521,000
GEB	4,959,000,000	1,843,321
GRUBOLIVAR	177,000,000	2,719
GRUPOARGOS	1,984,000,000	168,449
GRUPOAVAL	75,000,000	63,122
GRUPOSURA	5,937,000,000	273,607
HCOLSEL	4,087,000,000	331,493
ICOLCAP	7,470,000,000	554,578
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,226,000,000	321,175
JNJ	1,000,000,000,000	7,388,255
JPM	1,000,000,000,000	14,674,958
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	544,000,000	122,827
MOAT	87,437,000,000	343,183
NUTRESA	3,081,000,000	132,971
OCCIDENTE	50,000,000	1,479
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	197,651
PFAVAL	8,853,000,000	7,738,971
PFAVH	20,000,000	126,607
PFBVACOL	-	-
PFBCELOM	43,012,000,000	1,474,008
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCMARGOS	220,000,000	53,932
PFCORFICOL	181,000,000	6,699



**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
PFDVVVDA	3,925,000,000	131,489
PFE	1,000,000,000,000	31,862,622
PFGRUPOARG	240,000,000	25,295
PFGRUPSURA	1,047,000,000	55,299
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,550
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	6,000,000	1,483
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	325,000,000	43,326
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	99,000,000	12,764
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,943
VILLAS	22,000,000	4,425

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 06 de abril 2021 hasta el 12 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	90,378,176
AGROCHAL	-
AMZN	3,529,104





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
BAC	54,242,832
BBVACOL	64,290
BCOLOMBIA	257,198
BMC	2,266
BOGOTA	5,889
BVC	40,201
C	20,164,731
CARTON	2,664
CELSIA	215,680
CEMARGOS	389,832
CLH	38,112
CNEC	132,651
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	510,027
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,153
CREDIFAMI	327,479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	32,541,363
ELCONDOR	45,907
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,667,919
ESTRA	-
ETB	934,204
EXITO	11,141



**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
FABRICATO	2,576,885
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	84,521,000
GEB	1,843,321
GRUBOLIVAR	2,719
GRUPOARGOS	168,449
GRUPOAVAL	63,122
GRUPOSURA	273,607
HCOLSEL	331,493
ICOLCAP	554,578
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	321,175
JNJ	7,388,255
JPM	14,674,958
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	122,827
MOAT	343,183
NUTRESA	132,971
OCCIDENTE	1,479
ORBIS	-
PAZRIO	197,651
PFAVAL	7,738,971
PFAVH	126,607
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,474,008



**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
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	53,932
PFCORFICOL	6,699
PFDVVVND	131,489
PFE	31,862,622
PFGRUPOARG	25,295
PFGRUPSURA	55,299
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,550
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,483
POPULAR	35,307
PROMIGAS	43,326
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	12,764
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,943
VILLAS	4,425

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías