



Boletín informativo

No.090 / 06 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 07 de julio de 2021 hasta el 12 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,228,000,000	262,821
CELSIA	873,000,000	209,326
CEMARGOS	2,404,000,000	437,113
CORFICOLCF	1,925,000,000	64,745
ECOPETROL	77,419,000,000	27,155,058
GEB	4,228,000,000	1,663,828
GRUPOARGOS	1,766,000,000	168,187
GRUPOSURA	4,823,000,000	255,328
ISA	7,956,000,000	338,532
NUTRESA	3,269,000,000	144,389
PFAVAL	6,907,000,000	6,325,017
PFBCOLOM	41,960,000,000	1,498,561
PFDAVVNDA	3,804,000,000	132,443
PFGRUPSURA	809,000,000	47,563
ICOLCAP	7,483,000,000	572,528

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de julio de 2021 hasta el 12 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	81,009,926
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,432,426
BAC	1,000,000,000,000	44,071,371
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,228,000,000	262,821
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	419,000,000	5,948
BVC	491,000,000	43,472
C	1,000,000,000,000	19,586,603
CARTON	41,000,000	4,185



**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	873,000,000	209,326
CEMARGOS	2,404,000,000	437,113
CLH	84,000,000	22,834
CNEC	1,094,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,585
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	119,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,925,000,000	64,745
CREDIFAMI	527,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	77,419,000,000	27,155,058
ELCONDOR	37,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	100,000,000	6,863,869
ESTRA	-	-
ETB	119,000,000	572,520
EXITO	144,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	58,063,850
GEB	4,228,000,000	1,663,828
GRUBOLIVAR	425,000,000	6,068
GRUPOARGOS	1,766,000,000	168,187
GRUPOAVAL	40,000,000	38,515
GRUPOSURA	4,823,000,000	255,328
HCOLSEL	4,868,000,000	396,190
ICOLCAP	7,483,000,000	572,528



**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	7,956,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	6,983,738
JPM	1,000,000,000,000	13,913,862
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	579,000,000	143,947
MOAT	105,463,000,000	373,128
NUTRESA	3,269,000,000	144,389
OCCIDENTE	85,000,000	2,505
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	319,147
PFAVAL	6,907,000,000	6,325,017
PFAVH	84,000,000	314,046
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	41,960,000,000	1,498,561
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	187,000,000	48,346
PFCORFICOL	218,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,804,000,000	132,443
PFE	1,000,000,000,000	25,957,202
PFGRUPOARG	205,000,000	24,701
PFGRUPSURA	809,000,000	47,563
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	12,000,000	2,614
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	429,000,000	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	86,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,880
VILLAS	14,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de julio de 2021 hasta el 12 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,009,926
AGROCHAL	-
AMZN	3,432,426
BAC	44,071,371
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	262,821
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	43,472
C	19,586,603
CARTON	4,185
CELSIA	209,326
CEMARGOS	437,113
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,585
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,745
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	27,155,058
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,863,869
ESTRA	-
ETB	572,520
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	58,063,850
GEB	1,663,828
GRUBOLIVAR	6,068
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	255,328
HCOLSEL	396,190
ICOLCAP	572,528
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	6,983,738
JPM	13,913,862
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	143,947
MOAT	373,128
NUTRESA	144,389
OCCIDENTE	2,505





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ORBIS	-
PAZRIO	319,147
PFAVAL	6,325,017
PFAVH	314,046
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,498,561
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDAVVNDA	132,443
PFE	25,957,202
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	47,563
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,614
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	62,888
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,880
VILLAS	3,328

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías