



Boletín informativo

No.102 / 02 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 03 de agosto de 2021 hasta el 09 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,907,000,000	254,872
CELSIA	709,000,000	175,375
CEMARGOS	2,653,000,000	474,250
CORFICOLCF	1,846,000,000	63,053
ECOPETROL	69,947,000,000	26,565,376
GEB	3,204,000,000	1,266,841
GRUPOARGOS	1,563,000,000	154,894
GRUPOSURA	3,820,000,000	220,796
ISA	7,249,000,000	332,236
NUTRESA	3,040,000,000	146,864
PFAVAL	8,796,000,000	8,590,149
PFBCOLOM	40,693,000,000	1,463,791
PFDVVDA	3,393,000,000	118,223
PFGRUPSURA	551,000,000	33,816
ICOLCAP	5,314,000,000	422,143

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde 03 de agosto de 2021 hasta el 09 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	81,651,573
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,569,568
BAC	1,000,000,000,000	45,200,902
BBVACOL	21,000,000	73,394
BCOLOMBIA	6,907,000,000	254,872
BMC	-	-
BOGOTA	942,000,000	13,795
BVC	440,000,000	41,869
C	1,000,000,000,000	19,594,481
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	709,000,000	175,375
CEMARGOS	2,653,000,000	474,250
CLH	38,000,000	10,433
CNEC	1,253,000,000	127,056
COLTEJER	1,000,000	1,135
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	67,000,000	182,940
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,846,000,000	63,053
CREDIFAMI	934,000,000	373,737
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	69,947,000,000	26,565,376
ELCONDOR	45,000,000	52,793
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	42,000,000	2,980,783
ESTRA	1,000,000	11,697
ETB	43,000,000	224,220
EXITO	201,000,000	15,626
FABRICATO	18,000,000	4,021,961
FAMILIA	-	-
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	49,318,753
GEB	3,204,000,000	1,266,841
GRUBOLIVAR	757,000,000	11,131
GRUPOARGOS	1,563,000,000	154,894
GRUPOAVAL	87,000,000	84,921
GRUPOSURA	3,820,000,000	220,796
HCOLSEL	2,929,000,000	248,304
ICOLCAP	5,314,000,000	422,143



**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	7,249,000,000	332,236
JNJ	1,000,000,000,000	6,456,374
JPM	1,000,000,000,000	13,896,813
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	433,000,000	117,094
MOAT	-	365,803
NUTRESA	3,040,000,000	146,864
OCCIDENTE	7,000,000	212
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	343,624
PFAVAL	8,796,000,000	8,590,149
PFAVH	86,000,000	333,989
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	40,693,000,000	1,463,791
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	149,000,000	38,315
PFCORFICOL	243,000,000	10,456
PFDVVNDA	3,393,000,000	118,223
PFE	1,000,000,000,000	25,200,839
PFGRUPOARG	179,000,000	22,275
PFGRUPSURA	551,000,000	33,816
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	6,000,000	1,255
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	3,000,000	9,492
PROMIGAS	403,000,000	60,081
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	80,000,000	11,506
TGLSC	-	-
TITAN	57,000,000	3,362
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8,000,000	1,330
VILLAS	24,000,000	5,755

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 03 de agosto de 2021 hasta el 09 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,651,573
AGROCHAL	-
AMZN	3,569,568
BAC	45,200,902
BBVACOL	73,394
BCOLOMBIA	254,872
BMC	-
BOGOTA	13,795
BVC	41,869
C	19,594,481
CARTON	-
CELSIA	175,375
CEMARGOS	474,250
CLH	10,433
CNEC	127,056
COLTEJER	1,135
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	182,940
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	63,053
CREDIFAMI	373,737



**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	26,565,376
ELCONDOR	52,793
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	2,980,783
ESTRA	11,697
ETB	224,220
EXITO	15,626
FABRICATO	4,021,961
FAMILIA	-
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	49,318,753
GEB	1,266,841
GRUBOLIVAR	11,131
GRUPOARGOS	154,894
GRUPOAVAL	84,921
GRUPOSURA	220,796
HCOLSEL	248,304
ICOLCAP	422,143
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	332,236
JNJ	6,456,374
JPM	13,896,813
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	117,094
MOAT	365,803
NUTRESA	146,864
OCCIDENTE	212



**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
ORBIS	-
PAZRIO	343,624
PFAVAL	8,590,149
PFAVH	333,989
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,463,791
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	38,315
PFCORFICOL	10,456
PFDVVNDA	118,223
PFE	25,200,839
PFGRUPOARG	22,275
PFGRUPSURA	33,816
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1,255
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	9,492
PROMIGAS	60,081
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,506
TGLSC	-
TITAN	3,362
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,330
VILLAS	5,755

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.*