



Boletín informativo

No.145 / 02 de noviembre 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 noviembre de 2021 hasta el 08 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMDEfectivo	VMDacciones
BCOLOMBIA	4,320,000,000	137,171
CEMARGOS	2,610,000,000	457,761
CORFICOLCF	2,940,000,000	98,482
ECOPETROL	67,820,000,000	25,753,457
GEB	2,600,000,000	944,817
GRUPOARGOS	2,250,000,000	197,154
GRUPOSURA	4,580,000,000	230,136
ISA	7,630,000,000	335,689
NUTRESA	2,680,000,000	123,419
PFAVAL	10,390,000,000	9,586,072
PFBCOLOM	47,200,000,000	1,561,665
PFDVVDA	3,320,000,000	104,079
PFGRUPSURA	790,000,000	44,154
ICOLCAP	5,880,000,000	444,741

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 03 de noviembre de 2021 hasta el 08 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2,000,000,000,000	71,459,691
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	2,919,408
BAC	2,000,000,000,000	44,720,511
BBVACOL	10,000,000	29,733
BCOLOMBIA	4,320,000,000	137,171
BMC	-	78
BOGOTA	550,000,000	7,569
BVC	310,000,000	31,424
C	2,000,000,000,000	17,365,922
CARTON	-	-
CELSIA	600,000,000	140,572





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CEMARGOS	2,610,000,000	457,761
CENCOSUDCO	24,100,000,000	3,701,287
CFMITNIPCO	4,010,000,000	316,452
CHILECO	26,720,000,000	78,699,267
CLH	70,000,000	18,523
CNEC	1,150,000,000	111,054
COLTEJER	-	195
CONCRET	120,000,000	355,490
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,940,000,000	98,482
CREDIFAMI	-	-
CSPX	72,940,000,000	42,188
ECOPETROL	67,820,000,000	25,753,457
EIMI	61,620,000,000	438,858
ELCONDOR	30,000,000	34,230
ENELAMCO	20,400,000,000	42,631,225
ENKA	50,000,000	3,060,815
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	244,099
EXITO	160,000,000	13,755
FABRICATO	20,000,000	3,017,818
FALABELLCO	44,000,000,000	3,699,122
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	2,000,000,000,000	7,792,998
GEB	2,600,000,000	944,817
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,396
GRUPOARGOS	2,250,000,000	197,154
GRUPOAVAL	50,000,000	43,320
GRUPOSURA	4,580,000,000	230,136
HCOLSEL	2,010,000,000	158,284
ICOLCAP	5,880,000,000	444,741
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,630,000,000	335,689



**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
ISAC	17,350,000,000	63,402
IUFS	9,970,000,000	244,617
IUIT	8,170,000,000	109,330
JNJ	2,000,000,000,000	5,747,491
JPEA	10,770,000,000	474,020
JPM	2,000,000,000,000	10,253,670
JPM	2,000,000,000,000	10,253,670
MINEROS	320,000,000	84,868
NUTRESA	2,680,000,000	123,419
OCCIDENTE	10,000,000	339
PAZRIO	-	3,325
PFAVAL	10,390,000,000	9,586,072
PFAVH	60,000,000	440,375
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	47,200,000,000	1,561,665
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	160,000,000	41,659
PFCORFICOL	150,000,000	6,698
PFDVVNDA	3,320,000,000	104,079
PFE	2,000,000,000,000	23,370,032
PFGRUPOARG	270,000,000	32,710
PFGRUPSURA	790,000,000	44,154
PVVILLA051	-	1
PVVILLA053	-	7
PVVILLAS	-	67
PVVILLASCA	-	3
POPULAR	-	51
PROMIGAS	220,000,000	30,003
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	2,390,000,000	108,192
SQMBCO	30,000,000	169
SUAS	18,550,000,000	386,742
TERPEL	150,000,000	19,798
TGLSC	-	-



**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
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	197
VILLAS	10,000,000	2,562

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 03 de noviembre de 2021 hasta el 08 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	71,459,691
AGROCHAL	-
AMZN	2,919,408
BAC	44,720,511
BBVACOL	29,733
BCOLOMBIA	137,171
BMC	78
BOGOTA	7,569
BVC	31,424
C	17,365,922
CARTON	-
CELSIA	140,572
CEMARGOS	457,761
CENCOSUDCO	3,701,287
CFMITNIPCO	316,452
CHILECO	78,699,267
CLH	18,523
CNEC	111,054
COLTEJER	195
CONCRET	355,490
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	98,482
CREDIFAMI	-
CSPX	42,188
ECOPETROL	25,753,457
EIMI	438,858
ELCONDOR	34,230





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ENELAMCO	42,631,225
ENKA	3,060,815
ESTRA	-
ETB	244,099
EXITO	13,755
FABRICATO	3,017,818
FALABELLCO	3,699,122
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	7,792,998
GEB	944,817
GRUBOLIVAR	2,396
GRUPOARGOS	197,154
GRUPOAVAL	43,320
GRUPOSURA	230,136
HCOLSEL	158,284
ICOLCAP	444,741
INESA	-
INVENSA	-
ISA	335,689
ISAC	63,402
IUFS	244,617
IUIT	109,330
JNJ	5,747,491
JPEA	474,020
JPM	10,253,670
JPM	10,253,670
MINEROS	84,868
NUTRESA	123,419
OCCIDENTE	339
PAZRIO	3,325
PFAVAL	9,586,072
PFAVH	440,375
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,561,665



**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	-
PFCEMARGOS	41,659
PFCORFICOL	6,698
PFDVVNDA	104,079
PFE	23,370,032
PFGRUPOARG	32,710
PFGRUPSURA	44,154
PVVILLA051	1
PVVILLA053	7
PVVILLAS	67
PVVILLASCA	3
POPULAR	51
PROMIGAS	30,003
PROTECCION	9
SANFELIPE	-
SDHA	108,192
SQMBCO	169
SUAS	386,742
TERPEL	19,798
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	197
VILLAS	2,562

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías

