



Boletín informativo

No.164 / 06 de diciembre 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 diciembre de 2021 hasta el 13 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.320.000.000	163.636
CEMARGOS	2.740.000.000	484.207
CORFICOLCF	3.030.000.000	101.294
ECOPETROL	67.280.000.000	24.652.711
GEB	2.540.000.000	965.229
GRUPOARGO	2.610.000.000	217.802
GRUPOSURA	5.870.000.000	280.442
ISA	7.410.000.000	328.674
NUTRESA	2.850.000.000	123.455
PFAVAL	8.810.000.000	7.925.202
PFBCOLOM	49.180.000.000	1.592.537
PFDVVNDA	2.930.000.000	93.236
PFGRUPSURA	1.000.000.000	52.058
ICOLCAP	5.590.000.000	403.303

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de diciembre de 2021 hasta el 13 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2.000.000.000.000	77.809.408
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.120.684
BAC	1.000.000.000.000	44.591.958
BBVACOL	10.000.000	23.041
BCOLOMBIA	5.320.000.000	163.636
BMC	-	26
BOGOTA	570.000.000	7.867
BVC	200.000.000	20.460





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
C	1.000.000.000.000	19.478.434
CARTON	-	-
CELSIA	740.000.000	174.704
CEMARGOS	2.740.000.000	484.207
CENCOSUDCO	32.910.000.000	5.014.757
CFMITNIPCO	4.550.000.000	339.421
CHILECO	36.860.000.000	101.570.513
CLH	80.000.000	24.877
CNEC	1.070.000.000	103.263
COLTEJER	-	196
CONCONCRET	120.000.000	369.242
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	3.030.000.000	101.294
CREDIFAMI	-	16
CSPX	75.750.000.000	43.937
ECOPETROL	67.280.000.000	24.652.711
EIMI	57.220.000.000	410.628
ELCONDOR	30.000.000	39.519
ENELAMCO	31.490.000.000	63.104.109
ENKA	50.000.000	2.560.961
ESTRA	-	-
ETB	40.000.000	204.125
EXITO	170.000.000	13.385
FABRICATO	20.000.000	3.447.202
FALABELLCO	58.140.000.000	3.998.221
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	1.000.000.000.000	7.877.510
GEB	2.540.000.000	965.229
GRUBOLIVAR	350.000.000	5.070
GRUPOARGOS	2.610.000.000	217.802



**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
GRUPOAVAL	50.000.000	44.628
GRUPOSURA	5.870.000.000	280.442
HCOLSEL	2.310.000.000	185.093
ICOLCAP	5.590.000.000	403.303
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.410.000.000	328.674
ISAC	17.290.000.000	66.477
IUFS	10.960.000.000	264.565
IUIT	8.830.000.000	117.909
JNJ	1.000.000.000.000	6.385.883
JPEA	10.090.000.000	440.920
JPM	1.000.000.000.000	10.509.503
JPM	1.000.000.000.000	10.509.503
MINEROS	470.000.000	123.833
NUTRESA	2.850.000.000	123.455
OCCIDENTE	10.000.000	341
PAZRIO	-	121.947
PFAVAL	8.810.000.000	7.925.202
PFAVH	60.000.000	427.424
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	49.180.000.000	1.592.537
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	170.000.000	41.206
PFCORFICOL	110.000.000	4.588
PFDVVNDA	2.930.000.000	93.236
PFE	2.000.000.000.000	31.386.926
PFGRUPOARG	340.000.000	36.816
PFGRUPSURA	1.000.000.000	52.058
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	10



**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
PFVILLASCA	-	1
POPULAR	-	272
PROMIGAS	200.000.000	27.260
PROTECCION	-	4
SANFELIPE	-	-
SDHA	2.600.000.000	115.852
SQMBCO	40.000.000	207
SUAS	17.500.000.000	390.608
TERPEL	140.000.000	17.976
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	116
VILLAS	20.000.000	3.496

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de diciembre de 2021 hasta el 13 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	77.809.408
AGROCHAL	-
AMZN	3.120.684
BAC	44.591.958
BBVACOL	23.041
BCOLOMBIA	163.636
BMC	26
BOGOTA	7.867
BVC	20.460
C	19.478.434
CARTON	-
CELSIA	174.704
CEMARGOS	484.207
CENCOSUDCO	5.014.757





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CFMITNIPCO	339.421
CHILECO	101.570.513
CLH	24.877
CNEC	103.263
COLTEJER	196
CONCONCRET	369.242
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	101.294
CREDIFAMI	16
CSPX	43.937
ECOPETROL	24.652.711
EIMI	410.628
ELCONDOR	39.519
ENELAMCO	63.104.109
ENKA	2.560.961
ESTRA	-
ETB	204.125
EXITO	13.385
FABRICATO	3.447.202
FALABELLCO	3.998.221
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	7.877.510
GEB	965.229
GRUBOLIVAR	5.070
GRUPOARGOS	217.802
GRUPOAVAL	44.628
GRUPOSURA	280.442
HCOLSEL	185.093
ICOLCAP	403.303
INESA	-



**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
INVENSA	-
ISA	328.674
ISAC	66.477
IUFS	264.565
IUIT	117.909
JNJ	6.385.883
JPEA	440.920
JPM	10.509.503
JPM	10.509.503
MINEROS	123.833
NUTRESA	123.455
OCCIDENTE	341
PAZRIO	121.947
PFAVAL	7.925.202
PFAVH	427.424
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1.592.537
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	41.206
PFCORFICOL	4.588
PFDAVVNDA	93.236
PFE	31.386.926
PFGRUPOARG	36.816
PFGRUPSURA	52.058
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	10
PFVILLASCA	1
POPULAR	272
PROMIGAS	27.260
PROTECCION	4





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
SANFELIPE	-
SDHA	115.852
SQMBCO	207
SUAS	390.608
TERPEL	17.976
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	116
VILLAS	3.496

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías