



Boletín Informativo

No.004 / 11 de enero de 2022

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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de enero de 2022 hasta el 17 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.090.000.000	153.607
CEMARGOS	2.570.000.000	439.525
CORFICOLCF	2.290.000.000	78.472
ECOPETROL	54.260.000.000	19.654.717
GEB	2.130.000.000	788.674
GRUPOARGOS	2.530.000.000	210.165





Boletín Informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6.030.000.000	271.465
ISA	6.890.000.000	310.737
NUTRESA	3.680.000.000	150.021
PFAVAL	7.590.000.000	6.932.289
PFBCOLOM	46.500.000.000	1.508.796
PFDVVNDA	2.180.000.000	67.462
PFGRUPSURA	1.100.000.000	55.378
ICOLCAP	4.740.000.000	336.003

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de enero de 2022 hasta el 17 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2.000.000.000.000	83.267.369
AGROCHAL	-	-
AMZN	2.000.000.000.000	2.843.934
BAC	2.000.000.000.000	44.615.563
BBVACOL	10.000.000	19.789
BCOLOMBIA	5.090.000.000	153.607
BMC	-	54
BOGOTA	460.000.000	6.384
BVC	170.000.000	17.333
C	2.000.000.000.000	19.775.191



**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
CARTON	-	-
CELSIA	620.000.000	146.973
CEMARGOS	2.570.000.000	439.525
CENCOSUDCO	31.780.000.000	5.018.869
CFMITNIPCO	4.520.000.000	348.002
CHILECO	42.300.000.000	119.009.760
CLH	100.000.000	28.852
CNEC	1.040.000.000	101.003
COLTEJER	-	64
CONCRET	150.000.000	483.167
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2.290.000.000	78.472
CREDIFAMI	-	16
CSPX	80.070.000.000	44.793
ECOPETROL	54.260.000.000	19.654.717
EIMI	44.930.000.000	322.153
ELCONDOR	30.000.000	31.620
ENELAMCO	28.540.000.000	58.680.125
ENKA	30.000.000	1.444.149
ESTRA	-	-
ETB	40.000.000	217.665
EXITO	160.000.000	12.896
FABRICATO	20.000.000	3.408.848
FALABELLCO	48.900.000.000	3.882.407
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	2.000.000.000.000	5.774.074
GEB	2.130.000.000	788.674
GRUBOLIVAR	370.000.000	5.307
GRUPOARGOS	2.530.000.000	210.165
GRUPOAVAL	60.000.000	57.363



**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
GRUPOSURA	6.030.000.000	271.465
HCOLSEL	2.070.000.000	163.381
ICOLCAP	4.740.000.000	336.003
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	6.890.000.000	310.737
ISAC	21.730.000.000	76.266
IUFS	9.410.000.000	216.947
IUIT	9.430.000.000	118.547
JNJ	2.000.000.000.000	6.442.027
JPEA	7.210.000.000	310.625
JPM	2.000.000.000.000	10.776.216
JPM	2.000.000.000.000	10.776.216
MINEROS	390.000.000	104.778
NUTRESA	3.680.000.000	150.021
OCCIDENTE	-	49
PAZRIO	-	218.067
PFAVAL	7.590.000.000	6.932.289
PFAVH	10.000.000	204.551
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	46.500.000.000	1.508.796
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	170.000.000	39.668
PFCORFICOL	90.000.000	3.678
PFDAVVNDA	2.180.000.000	67.462
PFE	2.000.000.000.000	36.173.826
PFGRUPOARG	330.000.000	35.850
PFGRUPSURA	1.100.000.000	55.378
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	9
PFVILLASCA	-	0



**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
POPULAR	-	1.727
PROMIGAS	160.000.000	22.819
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	2.990.000.000	131.678
SQMBCO	40.000.000	205
SUAS	21.140.000.000	407.038
TERPEL	140.000.000	17.558
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	55
VILLAS	20.000.000	3.464

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de enero de 2022 hasta el 17 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83.267.369
AGROCHAL	-
AMZN	2.843.934
BAC	44.615.563
BBVACOL	19.789
BCOLOMBIA	153.607
BMC	54
BOGOTA	6.384
BVC	17.333
C	19.775.191
CARTON	-
CELSIA	146.973
CEMARGOS	439.525
CENCOSUDCO	5.018.869
CFMITNIPCO	348.002



**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
CHILECO	119.009.760
CLH	28.852
CNEC	101.003
COLTEJER	64
CONCRET	483.167
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	78.472
CREDIFAMI	16
CSPX	44.793
ECOPETROL	19.654.717
EIMI	322.153
ELCONDOR	31.620
ENELAMCO	58.680.125
ENKA	1.444.149
ESTRA	-
ETB	217.665
EXITO	12.896
FABRICATO	3.408.848
FALABELLCO	3.882.407
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	5.774.074
GEB	788.674
GRUBOLIVAR	5.307
GRUPOARGOS	210.165
GRUPOAVAL	57.363
GRUPOSURA	271.465
HCOLSEL	163.381
ICOLCAP	336.003
INESA	-
INVENSA	-
ISA	310.737



**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
ISAC	76.266
IUFS	216.947
IUIT	118.547
JNJ	6.442.027
JPEA	310.625
JPM	10.776.216
JPM	10.776.216
MINEROS	104.778
NUTRESA	150.021
OCCIDENTE	49
PAZRIO	218.067
PFAVAL	6.932.289
PFAVH	204.551
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1.508.796
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	39.668
PFCORFICOL	3.678
PFDAVVNDA	67.462
PFE	36.173.826
PFGRUPOARG	35.850
PFGRUPSURA	55.378
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	9
PVILLASCA	0
POPULAR	1.727
PROMIGAS	22.819
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	131.678



**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
SQMBCO	205
SUAS	407.038
TERPEL	17.558
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	55
VILLAS	3.464

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías