



Boletín informativo

No.002 / 03 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 04 de enero de 2022 hasta el 11 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,280,000,000	159,779
CEMARGOS	2,600,000,000	444,359
CORFICOLCF	2,760,000,000	94,105
ECOPETROL	58,830,000,000	21,294,321
GEB	2,210,000,000	822,985
GRUPOARGOS	2,530,000,000	210,487





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	5,960,000,000	270,104
ISA	7,080,000,000	315,308
NUTRESA	3,460,000,000	141,242
PFAVAL	8,290,000,000	7,542,554
PFBCOLOM	46,790,000,000	1,515,543
PFDVVNDA	2,370,000,000	73,087
PFGRUPSURA	1,120,000,000	56,440
ICOLCAP	5,070,000,000	361,332

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de enero de 2022 hasta el 11 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	82,624,951
AGROCHAL	-	-
AMZN	2,000,000,000,000	3,022,477
BAC	2,000,000,000,000	44,419,585
BBVACOL	10,000,000	23,155
BCOLOMBIA	5,280,000,000	159,779
BMC	-	54
BOGOTA	470,000,000	6,480
BVC	180,000,000	18,199
C	1,000,000,000,000	19,547,628



**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	630,000,000	150,066
CEMARGOS	2,600,000,000	444,359
CENCOSUDCO	32,000,000,000	5,025,555
CFMITNIPCO	4,610,000,000	353,380
CHILECO	38,790,000,000	103,939,218
CLH	90,000,000	28,393
CNEC	1,050,000,000	101,272
COLTEJER	-	107
CONCRET	160,000,000	503,587
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,760,000,000	94,105
CREDIFAMI	-	16
CSPX	79,350,000,000	44,746
ECOPETROL	58,830,000,000	21,294,321
EIMI	46,050,000,000	331,586
ELCONDOR	30,000,000	35,460
ENELAMCO	29,700,000,000	60,311,423
ENKA	30,000,000	1,120,270
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	214,852
EXITO	160,000,000	12,949
FABRICATO	20,000,000	3,413,013
FALABELLCO	58,990,000,000	4,068,279
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	#N/D	#N/D
GE	1,000,000,000,000	6,809,825
GEB	2,210,000,000	822,985
GRUBOLIVAR	400,000,000	5,620
GRUPOARGOS	2,530,000,000	210,487
GRUPOAVAL	60,000,000	52,986



**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	5,960,000,000	270,104
HCOLSEL	2,070,000,000	163,374
ICOLCAP	5,070,000,000	361,332
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,080,000,000	315,308
ISAC	21,240,000,000	74,866
IUFS	9,880,000,000	230,312
IUIT	9,360,000,000	119,963
JNJ	1,000,000,000,000	6,480,588
JPEA	10,050,000,000	435,612
JPM	1,000,000,000,000	10,585,078
JPM	1,000,000,000,000	10,585,078
MINEROS	390,000,000	104,990
NUTRESA	3,460,000,000	141,242
OCCIDENTE	-	49
PAZRIO	-	157,535
PFAVAL	8,290,000,000	7,542,554
PFAVH	10,000,000	234,221
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	46,790,000,000	1,515,543
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	160,000,000	38,649
PFCORFICOL	100,000,000	4,330
PFDAVVNDA	2,370,000,000	73,087
PFE	2,000,000,000,000	35,102,327
PFGRUPOARG	320,000,000	35,577
PFGRUPSURA	1,120,000,000	56,440
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	5
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	-	1,698
PROMIGAS	170,000,000	23,130
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,120,000,000	137,758
SQMBCO	40,000,000	221
SUAS	18,190,000,000	396,468
TERPEL	140,000,000	17,328
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	86
VILLAS	20,000,000	3,605

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de enero de 2022 hasta el 11 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	82,624,951
AGROCHAL	#N/D
AMZN	3,022,477
BAC	44,419,585
BBVACOL	23,155
BCOLOMBIA	159,779
BMC	54
BOGOTA	6,480
BVC	18,199
C	19,547,628
CARTON	-
CELSIA	150,066
CEMARGOS	444,359
CENCOSUDCO	5,025,555
CFMITNIPCO	353,380



**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	103,939,218
CLH	28,393
CNEC	101,272
COLTEJER	107
CONCRET	503,587
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	94,105
CREDIFAMI	16
CSPX	44,746
ECOPETROL	21,294,321
EIMI	331,586
ELCONDOR	35,460
ENELAMCO	60,311,423
ENKA	1,120,270
ESTRA	-
ETB	214,852
EXITO	12,949
FABRICATO	3,413,013
FALABELLCO	4,068,279
FAMILIA	-
GASNATURAL	#N/D
GE	6,809,825
GEB	822,985
GRUBOLIVAR	5,620
GRUPOARGOS	210,487
GRUPOAVAL	52,986
GRUPOSURA	270,104
HCOLSEL	163,374
ICOLCAP	361,332
INESA	-
INVENSA	-
ISA	315,308



**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	74,866
IUFS	230,312
IUIT	119,963
JNJ	6,480,588
JPEA	435,612
JPM	10,585,078
JPM	10,585,078
MINEROS	104,990
NUTRESA	141,242
OCCIDENTE	49
PAZRIO	157,535
PFAVAL	7,542,554
PFAVH	234,221
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,515,543
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	38,649
PFCORFICOL	4,330
PFDAVVNDA	73,087
PFE	35,102,327
PFGRUPOARG	35,577
PFGRUPSURA	56,440
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	5
PVILLASCA	0
POPULAR	1,698
PROMIGAS	23,130
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	137,758





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
SQMBCO	221
SUAS	396,468
TERPEL	17,328
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	86
VILLAS	3,605

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías