



Boletín informativo

No.121 / 13 de septiembre 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 14 de septiembre de 2021 hasta el 20 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,130,000,000	179,638
CELSIA	490,000,000	117,148
CEMARGOS	2,550,000,000	470,618
CORFICOLCF	2,240,000,000	74,768
ECOPETROL	67,040,000,000	25,850,444
GEB	2,160,000,000	840,192
GRUPOARGOS	1,250,000,000	118,234
GRUPOSURA	4,210,000,000	220,237
ISA	6,420,000,000	281,889
NUTRESA	1,920,000,000	87,611
PFAVAL	10,410,000,000	9,886,055
PFBCOLOM	41,460,000,000	1,426,159
PFDVVNDA	2,780,000,000	92,553
PFGRUPSURA	500,000,000	29,187
ICOLCAP	5,600,000,000	428,319

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de septiembre de 2021 hasta el 20 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	75,505,854
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,277,727
BAC	1,000,000,000,000	46,438,807
BBVACOL	10,000,000	17,918
BCOLOMBIA	5,130,000,000	179,638
BMC	-	80
BOGOTA	480,000,000	6,833
BSANTANDCO	28,390,000,000	149,267,767
BVC	320,000,000	30,948
C	1,000,000,000,000	18,844,806



**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
CAPCO	20,930,000,000	363,890
CARTON	-	-
CELSIA	490,000,000	117,148
CEMARGOS	2,550,000,000	470,618
CENCOSUDCO	24,190,000,000	3,372,561
FALABELLCO	52,160,000,000	3,584,655
CHILECO	28,930,000,000	80,323,719
CLH	30,000,000	7,333
CNEC	780,000,000	79,208
COLTEJER	-	179
CONCRET	80,000,000	203,393
COPECO	17,320,000,000	501,632
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,240,000,000	74,768
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
ECOPETROL	67,040,000,000	25,850,444
ELCONDOR	40,000,000	37,330
ENELAMCO	15,300,000,000	42,761,609
ENKA	60,000,000	3,709,309
ESTRA	-	-
ETB	30,000,000	162,698
EXITO	140,000,000	11,660
FABRICATO	10,000,000	2,770,353
FALABELLCO	52,160,000,000	3,584,655
FAMILIA	-	-
FB	1,000,000,000,000	13,503,989
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,954,320
GEB	2,160,000,000	840,192
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,236
GRUPOARGOS	1,250,000,000	118,234
GRUPOAVAL	70,000,000	71,879
GRUPOSURA	4,210,000,000	220,237
HCOLSEL	1,740,000,000	144,344



**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
ICOLCAP	5,600,000,000	428,319
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	6,420,000,000	281,889
JNJ	1,000,000,000,000	5,799,868
JPM	1,000,000,000,000	12,511,721
MINEROS	320,000,000	83,930
MOAT	93,620,000,000	375,354
NUTRESA	1,920,000,000	87,611
OCCIDENTE	10,000,000	228
PARAUCOCO	8,940,000,000	1,829,635
PAZRIO	-	2,885
PFAVAL	10,410,000,000	9,886,055
PFAVH	70,000,000	393,946
PFBVACOL	-	12
PFBCELOM	41,460,000,000	1,426,159
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	130,000,000	31,831
PFCORFICOL	180,000,000	7,824
PFDVVNDA	2,780,000,000	92,553
PFE	1,000,000,000,000	29,143,724
PFGRUPOARG	220,000,000	26,482
PFGRUPSURA	500,000,000	29,187
PVVILLA051	-	1
PVVILLA053	-	7
PVVILLAS	-	67
PVVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	160,000,000	23,853
PROTECCION	-	8
SANFELIPE	-	-
SQMBCO	30,000,000	138
TERPEL	100,000,000	13,822
TGLSC	-	-
TITAN	-	68



**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
VALSIMESA	-	175
VILLAS	10,000,000	1,206

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de septiembre de 2021 hasta el 20 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	75,505,854
AGROCHAL	-
AMZN	3,277,727
BAC	46,438,807
BBVACOL	17,918
BCOLOMBIA	179,638
BMC	80
BOGOTA	6,833
BSANTANDCO	149,267,767
BVC	30,948
C	18,844,806
CAPCO	363,890
CARTON	-
CELSIA	117,148
CEMARGOS	470,618
CENCOSUDCO	3,372,561
FALABELLCO	3,584,655
CHILECO	80,323,719
CLH	7,333
CNEC	79,208
COLTEJER	179
CONCONCRET	203,393
COPECO	501,632
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	74,768
CREDIFAMI	26,070
ECOPETROL	25,850,444
ELCONDOR	37,330
ENELAMCO	42,761,609



**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
ENKA	3,709,309
ESTRA	-
ETB	162,698
EXITO	11,660
FABRICATO	2,770,353
FALABELLCO	3,584,655
FAMILIA	-
FB	13,503,989
GASNATURAL	-
GE	7,954,320
GEB	840,192
GRUBOLIVAR	2,236
GRUPOARGOS	118,234
GRUPOAVAL	71,879
GRUPOSURA	220,237
HCOLSEL	144,344
ICOLCAP	428,319
INESA	-
INVENSA	-
ISA	281,889
JNJ	5,799,868
JPM	12,511,721
MINEROS	83,930
MOAT	375,354
NUTRESA	87,611
OCCIDENTE	228
PARAUCOCO	1,829,635
PAZRIO	2,885
PFAVAL	9,886,055
PFAVH	393,946
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,426,159
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	31,831



**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
PFCORFICOL	7,824
PFDAVVNDA	92,553
PFE	29,143,724
PFGRUPOARG	26,482
PFGRUPSURA	29,187
PFVILLA051	1
PFVILLA053	7
PFVILLAS	67
PFVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	23,853
PROTECCION	8
SANFELIPE	-
SQMBCO	138
TERPEL	13,822
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	175
VILLAS	1,206

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías