



Boletín informativo

No.125 / 20 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 21 de septiembre de 2021 hasta el 27 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,320,000,000	183,762
CEMARGOS	2,580,000,000	485,320
CORFICOLCF	2,540,000,000	85,363
ECOPETROL	67,970,000,000	26,785,094
GEB	2,120,000,000	813,219
GRUPOARGOS	1,740,000,000	163,986
GRUPOSURA	4,670,000,000	240,100
ISA	7,590,000,000	333,912
NUTRESA	2,070,000,000	94,896
PFAVAL	10,430,000,000	9,868,399
PFBCOLOM	42,200,000,000	1,437,302
PFDAVVNDA	3,220,000,000	106,337
PFGRUPSURA	560,000,000	32,555
ICOLCAP	5,950,000,000	453,951

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 21 de septiembre de 2021 hasta el 27 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	77,959,603
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,266,651
BAC	1,000,000,000,000	47,125,115
BBVACOL	10,000,000	18,009
BCOLOMBIA	5,320,000,000	183,762
BMC	-	80
BOGOTA	400,000,000	5,589
BSANTANDCO	28,170,000,000	147,970,387
BVC	300,000,000	29,398
C	1,000,000,000,000	18,755,191
CAPCO	21,100,000,000	364,737





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CARTON	-	-
CELSIA	570,000,000	137,253
CEMARGOS	2,580,000,000	485,320
CENCOSUDCO	22,730,000,000	3,177,905
CFMITNIPCO	-	1
CHILECO	28,950,000,000	80,259,168
CLH	30,000,000	8,094
CNEC	750,000,000	76,411
COLTEJER	-	179
CONCONCRET	80,000,000	200,094
COPECO	15,850,000,000	462,872
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,540,000,000	85,363
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
CSPX	-	1
ECOPETROL	67,970,000,000	26,785,094
EIMI	-	16
ELCONDOR	30,000,000	34,803
ENELAMCO	14,150,000,000	40,274,499
ENKA	60,000,000	3,690,296
ESTRA	-	-
ETB	30,000,000	171,447
EXITO	150,000,000	12,023
FABRICATO	10,000,000	2,779,617
FALABELLCO	52,430,000,000	3,598,889
FAMILIA	-	131
FB	1,000,000,000,000	13,571,805
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	8,257,343
GEB	2,120,000,000	813,219
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,254
GRUPOARGOS	1,740,000,000	163,986
GRUPOAVAL	70,000,000	71,911
GRUPOSURA	4,670,000,000	240,100
HCOLSEL	1,970,000,000	162,105
ICOLCAP	5,950,000,000	453,951



**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
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,590,000,000	333,912
ISAC	-	6
IUFS	-	24
IUIT	-	19
JNJ	1,000,000,000,000	5,910,840
JPEA	-	13
JPM	1,000,000,000,000	12,229,451
JPM	1,000,000,000,000	12,229,451
MINEROS	320,000,000	83,625
MOAT	93,970,000,000	374,380
NUTRESA	2,070,000,000	94,896
OCCIDENTE	10,000,000	228
PARAUCOCO	7,200,000,000	1,465,151
PAZRIO	-	217
PFAVAL	10,430,000,000	9,868,399
PFAVH	70,000,000	408,201
PFBBVACOL	-	12
PFBCOLOM	42,200,000,000	1,437,302
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	140,000,000	35,033
PFCORFICOL	170,000,000	7,384
PFDVVNDA	3,220,000,000	106,337
PFE	1,000,000,000,000	29,219,329
PFGRUPOARG	230,000,000	26,742
PFGRUPSURA	560,000,000	32,555
PFVILLA051	-	1
PFVILLA053	-	7
PFVILLAS	-	67
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	210,000,000	29,492
PROTECCION	-	8
SANFELIPE	-	-



**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
SDHA	-	51
SQMBCO	30,000,000	154
SUAS	-	26
TERPEL	100,000,000	13,372
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	175
VILLAS	-	1,148

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 21 de septiembre de 2021 hasta el 27 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	77,959,603
AGROCHAL	-
AMZN	3,266,651
BAC	47,125,115
BBVACOL	18,009
BCOLOMBIA	183,762
BMC	80
BOGOTA	5,589
BSANTANDCO	147,970,387
BVC	29,398
C	18,755,191
CAPCO	364,737
CARTON	-
CELSIA	137,253
CEMARGOS	485,320
CENCOSUDCO	3,177,905
CFMITNIPCO	1
CHILECO	80,259,168
CLH	8,094
CNEC	76,411
COLTEJER	179
CONCRET	200,094
COPECO	462,872



**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
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	85,363
CREDIFAMI	26,070
CSPX	1
ECOPETROL	26,785,094
EIMI	16
ELCONDOR	34,803
ENELAMCO	40,274,499
ENKA	3,690,296
ESTRA	-
ETB	171,447
EXITO	12,023
FABRICATO	2,779,617
FALABELLCO	3,598,889
FAMILIA	131
FB	13,571,805
GASNATURAL	-
GE	8,257,343
GEB	813,219
GRUBOLIVAR	2,254
GRUPOARGOS	163,986
GRUPOAVAL	71,911
GRUPOSURA	240,100
HCOLSEL	162,105
ICOLCAP	453,951
INESA	-
INVENSA	-
ISA	333,912
ISAC	6
IUFS	24
IUIT	19
JNJ	5,910,840
JPEA	13
JPM	12,229,451
JPM	12,229,451



**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
MINEROS	83,625
MOAT	374,380
NUTRESA	94,896
OCCIDENTE	228
PARAUCOCO	1,465,151
PAZRIO	217
PFAVAL	9,868,399
PFAVH	408,201
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,437,302
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	35,033
PFCORFICOL	7,384
PFDVVNDA	106,337
PFE	29,219,329
PFGRUPOARG	26,742
PFGRUPSURA	32,555
PVILLA051	1
PVILLA053	7
PVILLAS	67
PVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	29,492
PROTECCION	8
SANFELIPE	-
SDHA	51
SQMBCO	154
SUAS	26
TERPEL	13,372
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	175
VILLAS	1,148





Boletín informativo

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías