



Boletín informativo

No.129 / 27 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 28 de septiembre de 2021 hasta el 04 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,330,000,000	182,930
CEMARGOS	2,580,000,000	484,046
CORFICOLCF	2,630,000,000	88,338
ECOPETROL	66,530,000,000	26,026,279
GEB	2,020,000,000	767,171
GRUPOARGOS	1,730,000,000	162,764
GRUPOSURA	4,410,000,000	229,380
ISA	7,150,000,000	314,397
NUTRESA	2,090,000,000	96,392
PFAVAL	10,090,000,000	9,483,812
PFBCOLOM	42,040,000,000	1,421,152
PFDVVNDA	3,470,000,000	113,500
PFGRUPSURA	560,000,000	32,241
ICOLCAP	5,990,000,000	455,688

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de septiembre de 2021 hasta el 04 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	77,548,621
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,181,296
BAC	1,000,000,000,000	46,442,918
BBVACOL	10,000,000	24,583
BCOLOMBIA	5,330,000,000	182,930
BMC	-	80
BOGOTA	390,000,000	5,487
BSANTANDCO	26,980,000,000	141,886,377
BVC	290,000,000	29,227
C	1,000,000,000,000	18,613,888
CAPCO	20,770,000,000	384,624





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CARTON	-	-
CELSIA	570,000,000	136,282
CEMARGOS	2,580,000,000	484,046
CENCOSUDCO	21,630,000,000	3,048,210
CFMITNIPCO	-	1
CHILECO	28,570,000,000	79,293,750
CLH	30,000,000	9,224
CNEC	830,000,000	84,183
COLTEJER	-	179
CONCRET	80,000,000	208,986
COPECO	15,300,000,000	452,519
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,630,000,000	88,338
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
CSPX	-	1
ECOPETROL	66,530,000,000	26,026,279
EIMI	10,000,000	72
ELCONDOR	30,000,000	31,357
ENELAMCO	13,090,000,000	38,646,898
ENKA	60,000,000	3,965,514
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	176,531
EXITO	150,000,000	11,987
FABRICATO	10,000,000	2,703,238
FALABELLCO	50,790,000,000	3,446,554
FAMILIA	-	131
FB	1,000,000,000,000	14,095,892
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	8,000,002
GEB	2,020,000,000	767,171
GRUBOLIVAR	150,000,000	2,216
GRUPOARGOS	1,730,000,000	162,764
GRUPOAVAL	70,000,000	71,735
GRUPOSURA	4,410,000,000	229,380
HCOLSEL	1,500,000,000	122,878



**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	5,990,000,000	455,688
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,150,000,000	314,397
ISAC	-	7
IUFS	-	27
IUIT	-	25
JNJ	1,000,000,000,000	5,803,343
JPEA	-	26
JPM	1,000,000,000,000	11,284,563
JPM	1,000,000,000,000	11,284,563
MINEROS	290,000,000	75,904
MOAT	90,890,000,000	356,752
NUTRESA	2,090,000,000	96,392
OCCIDENTE	10,000,000	381
PARAUCOCO	7,160,000,000	1,476,496
PAZRIO	-	217
PFAVAL	10,090,000,000	9,483,812
PFAVH	70,000,000	411,305
PFBBVACOL	-	12
PFBCELOM	42,040,000,000	1,421,152
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	140,000,000	34,347
PFCORFICOL	180,000,000	7,652
PFDVVNDA	3,470,000,000	113,500
PFE	1,000,000,000,000	29,169,457
PFGRUPOARG	230,000,000	27,255
PFGRUPSURA	560,000,000	32,241
PVVILLA051	-	1
PVVILLA053	-	7
PVVILLAS	-	67
PVVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	160,000,000	23,130
PROTECCION	-	9



**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
SANFELIPE	-	-
SDHA	-	51
SQMBCO	30,000,000	154
SUAS	-	33
TERPEL	100,000,000	12,936
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	179
VILLAS	10,000,000	1,427

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de septiembre de 2021 hasta el 04 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	77,548,621
AGROCHAL	-
AMZN	3,181,296
BAC	46,442,918
BBVACOL	24,583
BCOLOMBIA	182,930
BMC	80
BOGOTA	5,487
BSANTANDCO	141,886,377
BVC	29,227
C	18,613,888
CAPCO	384,624
CARTON	-
CELSIA	136,282
CEMARGOS	484,046
CENCOSUDCO	3,048,210
CFMITNIPCO	1
CHILECO	79,293,750
CLH	9,224
CNEC	84,183
COLTEJER	179
CONCRET	208,986



**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 acciones
COPECO	452,519
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	88,338
CREDIFAMI	26,070
CSPX	1
ECOPETROL	26,026,279
EIMI	72
ELCONDOR	31,357
ENELAMCO	38,646,898
ENKA	3,965,514
ESTRA	-
ETB	176,531
EXITO	11,987
FABRICATO	2,703,238
FALABELLCO	3,446,554
FAMILIA	131
FB	14,095,892
GASNATURAL	-
GE	8,000,002
GEB	767,171
GRUBOLIVAR	2,216
GRUPOARGOS	162,764
GRUPOAVAL	71,735
GRUPOSURA	229,380
HCOLSEL	122,878
ICOLCAP	455,688
INESA	-
INVENSA	-
ISA	314,397
ISAC	7
IUFS	27
IUIT	25
JNJ	5,803,343
JPEA	26
JPM	11,284,563



**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
JPM	11,284,563
MINEROS	75,904
MOAT	356,752
NUTRESA	96,392
OCCIDENTE	381
PARAUCOCO	1,476,496
PAZRIO	217
PFAVAL	9,483,812
PFAVH	411,305
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,421,152
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	34,347
PFCORFICOL	7,652
PFDVVNDA	113,500
PFE	29,169,457
PFGRUPOARG	27,255
PFGRUPSURA	32,241
PVVILLA051	1
PVVILLA053	7
PVVILLAS	67
PVVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	23,130
PROTECCION	9
SANFELIPE	-
SDHA	51
SQMBCO	154
SUAS	33
TERPEL	12,936
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	179
VILLAS	1,427





Boletín informativo

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías