



Boletín informativo

No.133 / 04 de octubre 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 05 de octubre de 2021 hasta el 11 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,380,000,000	182,617
CEMARGOS	2,480,000,000	461,837
CORFICOLCF	2,720,000,000	91,443
ECOPETROL	66,480,000,000	26,470,099
GEB	2,160,000,000	809,408
GRUPOARGO	1,820,000,000	169,810
GRUPOSURA	4,560,000,000	230,511
ISA	7,110,000,000	312,192
NUTRESA	2,270,000,000	104,984
PFAVAL	10,220,000,000	9,580,867
PFBCOLOM	44,090,000,000	1,497,039
PFDVVNDA	3,540,000,000	116,994
PFGRUPSURA	640,000,000	36,877
ICOLCAP	5,950,000,000	450,098

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 05 de octubre de 2021 hasta el 11 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	79,298,596
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,209,295
BAC	1,000,000,000,000	46,226,512
BBVACOL	10,000,000	26,305
BCOLOMBIA	5,380,000,000	182,617
BMC	-	80
BOGOTA	390,000,000	5,522
BSANTANDCO	26,860,000,000	141,295,254





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	290,000,000	28,581
C	1,000,000,000,000	18,374,764
CAPCO	21,630,000,000	404,861
CARTON	-	-
CELSIA	560,000,000	134,222
CEMARGOS	2,480,000,000	461,837
CENCOSUDCO	21,510,000,000	3,043,244
CFMITNIPCO	-	1
CHILECO	27,850,000,000	77,632,608
CLH	30,000,000	8,703
CNEC	890,000,000	89,621
COLTEJER	-	180
CONCRET	90,000,000	227,998
COPECO	15,760,000,000	474,121
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,720,000,000	91,443
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
CSPX	-	2
ECOPETROL	66,480,000,000	26,470,099
EIMI	10,000,000	73
ELCONDOR	20,000,000	26,035
ENELAMCO	12,030,000,000	36,614,464
ENKA	60,000,000	3,977,059
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	202,268
EXITO	140,000,000	11,992
FABRICATO	10,000,000	2,823,222
FALABELLCO	52,640,000,000	3,600,061
FAMILIA	-	131
FB	1,000,000,000,000	13,943,021
GASNATURAL	-	-



**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
GE	1,000,000,000,000	8,026,615
GEB	2,160,000,000	809,408
GRUBOLIVAR	110,000,000	1,640
GRUPOARGOS	1,820,000,000	169,810
GRUPOAVAL	70,000,000	69,142
GRUPOSURA	4,560,000,000	230,511
HCOLSEL	1,440,000,000	117,664
ICOLCAP	5,950,000,000	450,098
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,110,000,000	312,192
ISAC	-	14
IUFS	10,000,000	125
IUIT	-	58
JNJ	1,000,000,000,000	5,850,771
JPEA	-	33
JPM	1,000,000,000,000	11,103,862
JPM	1,000,000,000,000	11,103,862
MINEROS	290,000,000	77,034
MOAT	96,050,000,000	377,834
NUTRESA	2,270,000,000	104,984
OCCIDENTE	10,000,000	382
PARAUCOCO	6,890,000,000	1,455,163
PAZRIO	-	217
PFAVAL	10,220,000,000	9,580,867
PFAVH	70,000,000	412,311
PFBBVACOL	-	12
PFBCELOM	44,090,000,000	1,497,039
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	130,000,000	31,258
PFCORFICOL	180,000,000	8,083



**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
PFDVVNDA	3,540,000,000	116,994
PFE	1,000,000,000,000	28,992,060
PFGRUPOARG	230,000,000	27,789
PFGRUPSURA	640,000,000	36,877
PFVILLA051	-	1
PFVILLA053	-	7
PFVILLAS	-	67
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	150,000,000	21,762
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	-	125
SQMBCO	30,000,000	169
SUAS	10,000,000	150
TERPEL	100,000,000	13,287
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	187
VILLAS	10,000,000	1,392

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 05 de octubre de 2021 hasta el 11 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	79,298,596
AGROCHAL	-
AMZN	3,209,295
BAC	46,226,512
BBVACOL	26,305
BCOLOMBIA	182,617
BMC	80



**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
BOGOTA	5,522
BSANTANDCO	141,295,254
BVC	28,581
C	18,374,764
CAPCO	404,861
CARTON	-
CELSIA	134,222
CEMARGOS	461,837
CENCOSUDCO	3,043,244
CFMITNIPCO	1
CHILECO	77,632,608
CLH	8,703
CNEC	89,621
COLTEJER	180
CONCRET	227,998
COPECO	474,121
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	91,443
CREDIFAMI	26,070
CSPX	2
ECOPETROL	26,470,099
EIMI	73
ELCONDOR	26,035
ENELAMCO	36,614,464
ENKA	3,977,059
ESTRA	-
ETB	202,268
EXITO	11,992
FABRICATO	2,823,222
FALABELLCO	3,600,061





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
FAMILIA	131
FB	13,943,021
GASNATURAL	-
GE	8,026,615
GEB	809,408
GRUBOLIVAR	1,640
GRUPOARGOS	169,810
GRUPOAVAL	69,142
GRUPOSURA	230,511
HCOLSEL	117,664
ICOLCAP	450,098
INESA	-
INVENSA	-
ISA	312,192
ISAC	14
IUFS	125
IUIT	58
JNJ	5,850,771
JPEA	33
JPM	11,103,862
JPM	11,103,862
MINEROS	77,034
MOAT	377,834
NUTRESA	104,984
OCCIDENTE	382
PARAUCOCO	1,455,163
PAZRIO	217
PFAVAL	9,580,867
PFAVH	412,311
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,497,039
PFCARPAK	-



**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
PFCEMARGOS	31,258
PFCORFICOL	8,083
PFDVVNDA	116,994
PFE	28,992,060
PFGRUPOARG	27,789
PFGRUPSURA	36,877
PVVILLA051	1
PVVILLA053	7
PVVILLAS	67
PVVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	21,762
PROTECCION	9
SANFELIPE	-
SDHA	125
SQMBCO	169
SUAS	150
TERPEL	13,287
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	187
VILLAS	1,392

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías

