



Boletín informativo

No.136 / 11 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 12 de octubre de 2021 hasta el 19 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,350,000,000	179,753
CEMARGOS	2,530,000,000	468,313
CORFICOLCF	2,810,000,000	94,349
ECOPETROL	67,580,000,000	26,807,800
GEB	2,370,000,000	878,506
GRUPOARGO	2,000,000,000	185,835
GRUPOSURA	4,520,000,000	230,319
ISA	7,250,000,000	318,887
NUTRESA	2,430,000,000	112,390
PFAVAL	10,490,000,000	9,792,666
PFBCOLOM	45,280,000,000	1,532,172
PFDVVNDA	3,370,000,000	108,248
PFGRUPSURA	710,000,000	40,364
ICOLCAP	5,630,000,000	421,624

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de octubre de 2021 hasta el 19 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	78,248,760
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,088,442
BAC	1,000,000,000,000	45,962,400
BBVACOL	10,000,000	28,917
BCOLOMBIA	5,350,000,000	179,753
BMC	-	80
BOGOTA	480,000,000	6,689
BSANTANDCO	26,860,000,000	141,295,254





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	290,000,000	29,570
C	1,000,000,000,000	18,113,250
CAPCO	21,630,000,000	404,861
CARTON	-	-
CELSIA	550,000,000	130,803
CEMARGOS	2,530,000,000	468,313
CENCOSUDCO	21,090,000,000	2,985,706
CFMITNIPCO	2,680,000,000	192,145
CHILECO	27,690,000,000	77,542,090
CLH	50,000,000	12,538
CNEC	1,100,000,000	108,499
COLTEJER	-	194
CONCRET	90,000,000	241,057
COPECO	15,760,000,000	474,121
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,810,000,000	94,349
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
CSPX	74,030,000,000	42,892
ECOPETROL	67,580,000,000	26,807,800
EIMI	66,160,000,000	472,748
ELCONDOR	30,000,000	30,478
ENELAMCO	17,710,000,000	35,081,224
ENKA	60,000,000	4,209,398
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	214,152
EXITO	150,000,000	12,385
FABRICATO	20,000,000	2,916,053
FALABELLCO	52,790,000,000	3,608,892
FAMILIA	-	131
FB	1,000,000,000,000	13,943,021
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,997,487



**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
GEB	2,370,000,000	878,506
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,280
GRUPOARGOS	2,000,000,000	185,835
GRUPOAVAL	80,000,000	72,008
GRUPOSURA	4,520,000,000	230,319
HCOLSEL	1,360,000,000	110,262
ICOLCAP	5,630,000,000	421,624
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,250,000,000	318,887
ISAC	14,520,000,000	57,769
IUFS	9,950,000,000	248,848
IUIT	8,920,000,000	119,713
JNJ	1,000,000,000,000	5,806,830
JPEA	11,300,000,000	495,931
JPM	1,000,000,000,000	10,891,222
JPM	1,000,000,000,000	10,891,222
MINEROS	310,000,000	81,695
MOAT	96,050,000,000	377,834
NUTRESA	2,430,000,000	112,390
OCCIDENTE	10,000,000	382
PARAUCOCO	6,890,000,000	1,455,163
PAZRIO	-	217
PFAVAL	10,490,000,000	9,792,666
PFAVH	70,000,000	410,974
PFBBVACOL	-	12
PFBCOLOM	45,280,000,000	1,532,172
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	150,000,000	36,702
PFCORFICOL	200,000,000	8,515



**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	3,370,000,000	108,248
PFE	1,000,000,000,000	28,846,420
PFGRUPOARG	260,000,000	30,499
PFGRUPSURA	710,000,000	40,364
PFVILLA051	-	1
PFVILLA053	-	7
PFVILLAS	-	67
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	180,000,000	25,254
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,260,000,000	154,181
SQMBCO	30,000,000	169
SUAS	15,320,000,000	356,777
TERPEL	140,000,000	18,909
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	187
VILLAS	10,000,000	2,076

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de octubre de 2021 hasta el 19 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	78,248,760
AGROCHAL	-
AMZN	3,088,442
BAC	45,962,400
BBVACOL	28,917
BCOLOMBIA	179,753
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	6,689
BSANTANDCO	141,295,254
BVC	29,570
C	18,113,250
CAPCO	404,861
CARTON	-
CELSIA	130,803
CEMARGOS	468,313
CENCOSUDCO	2,985,706
CFMITNIPCO	192,145
CHILECO	77,542,090
CLH	12,538
CNEC	108,499
COLTEJER	194
CONCRET	241,057
COPECO	474,121
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	94,349
CREDIFAMI	26,070
CSPX	42,892
ECOPETROL	26,807,800
EIMI	472,748
ELCONDOR	30,478
ENELAMCO	35,081,224
ENKA	4,209,398
ESTRA	-
ETB	214,152
EXITO	12,385
FABRICATO	2,916,053
FALABELLCO	3,608,892
FAMILIA	131
FB	13,943,021



**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
GASNATURAL	-
GE	7,997,487
GEB	878,506
GRUBOLIVAR	2,280
GRUPOARGOS	185,835
GRUPOAVAL	72,008
GRUPOSURA	230,319
HCOLSEL	110,262
ICOLCAP	421,624
INESA	-
INVENSA	-
ISA	318,887
ISAC	57,769
IUFS	248,848
IUIT	119,713
JNJ	5,806,830
JPEA	495,931
JPM	10,891,222
JPM	10,891,222
MINEROS	81,695
MOAT	377,834
NUTRESA	112,390
OCCIDENTE	382
PARAUCOCO	1,455,163
PAZRIO	217
PFAVAL	9,792,666
PFAVH	410,974
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,532,172
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	36,702



**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	8,515
PFDVVVDA	108,248
PFE	28,846,420
PFGRUPOARG	30,499
PFGRUPSURA	40,364
PVVILLA051	1
PVVILLA053	7
PVVILLAS	67
PVVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	25,254
PROTECCION	9
SANFELIPE	-
SDHA	154,181
SQMBCO	169
SUAS	356,777
TERPEL	18,909
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	187
VILLAS	2,076

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías