



Boletín informativo

No.149 / 08 de noviembre 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 09 de noviembre de 2021 hasta el 16 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMDEfectivo	VMDacciones
BCOLOMBIA	4.350.000.000	136.938
CEMARGOS	2.660.000.000	473.319
CORFICOLCF	2.980.000.000	99.688
ECOPETROL	67.570.000.000	25.311.317
GEB	2.810.000.000	1.021.636
GRUPOARGO	2.220.000.000	196.039
GRUPOSURA	4.540.000.000	227.293
ISA	7.730.000.000	344.072
NUTRESA	2.730.000.000	125.006
PFAVAL	10.380.000.000	9.542.672
PFBCOLOM	47.240.000.000	1.556.110
PFDAVVNDA	3.310.000.000	102.642
PFGRUPSURA	780.000.000	43.434
ICOLCAP	5.890.000.000	444.979

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de noviembre de 2021 hasta el 16 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2.000.000.000.000	69.961.148
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	2.789.986
BAC	2.000.000.000.000	42.696.975
BBVACOL	10.000.000	30.453
BCOLOMBIA	4.350.000.000	136.938
BMC	-	78
BOGOTA	550.000.000	7.606
BVC	300.000.000	30.834





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
C	2.000.000.000.000	17.624.829
CARTON	-	-
CELSIA	610.000.000	143.605
CEMARGOS	2.660.000.000	473.319
CENCOSUDCO	25.580.000.000	3.995.940
CFMITNIPCO	4.130.000.000	326.030
CHILECO	25.430.000.000	75.918.156
CLH	70.000.000	18.429
CNEC	1.260.000.000	120.401
COLTEJER	-	195
CONCONCRET	120.000.000	355.480
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2.980.000.000	99.688
CREDIFAMI	-	16
CSPX	72.060.000.000	41.734
ECOPETROL	67.570.000.000	25.311.317
EIMI	59.960.000.000	427.189
ELCONDOR	30.000.000	34.858
ENELAMCO	22.540.000.000	47.638.203
ENKA	50.000.000	3.069.219
ESTRA	-	-
ETB	50.000.000	243.693
EXITO	170.000.000	14.142
FABRICATO	20.000.000	3.213.956
FALABELLCO	46.770.000.000	3.595.195
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	2.000.000.000.000	7.111.959
GEB	2.810.000.000	1.021.636
GRUBOLIVAR	160.000.000	2.371
GRUPOARGOS	2.220.000.000	196.039



**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
GRUPOAVAL	50.000.000	44.112
GRUPOSURA	4.540.000.000	227.293
HCOLSEL	1.950.000.000	151.146
ICOLCAP	5.890.000.000	444.979
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.730.000.000	344.072
ISAC	17.760.000.000	64.752
IUFS	9.950.000.000	243.491
IUIT	7.740.000.000	103.357
JNJ	2.000.000.000.000	5.873.296
JPEA	10.700.000.000	469.911
JPM	2.000.000.000.000	10.085.050
JPM	2.000.000.000.000	10.085.050
MINEROS	310.000.000	82.765
NUTRESA	2.730.000.000	125.006
OCCIDENTE	10.000.000	339
PAZRIO	-	3.325
PFAVAL	10.380.000.000	9.542.672
PFAVH	60.000.000	439.141
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	47.240.000.000	1.556.110
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	170.000.000	41.799
PFCORFICOL	140.000.000	6.048
PFDVVNDA	3.310.000.000	102.642
PFE	2.000.000.000.000	24.203.215
PFGRUPOARG	270.000.000	32.853
PFGRUPSURA	780.000.000	43.434
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	49



**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
PFVILLASCA	-	1
POPULAR	-	298
PROMIGAS	210.000.000	29.318
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	2.440.000.000	110.457
SQMBCO	30.000.000	179
SUAS	18.210.000.000	375.292
TERPEL	150.000.000	19.438
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	197
VILLAS	10.000.000	2.478

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de noviembre de 2021 hasta el 16 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	69.961.148
AGROCHAL	-
AMZN	2.789.986
BAC	42.696.975
BBVACOL	30.453
BCOLOMBIA	136.938
BMC	78
BOGOTA	7.606
BVC	30.834
C	17.624.829
CARTON	-
CELSIA	143.605
CEMARGOS	473.319
CENCOSUDCO	3.995.940





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CFMITNIPCO	326.030
CHILECO	75.918.156
CLH	18.429
CNEC	120.401
COLTEJER	195
CONCONCRET	355.480
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	99.688
CREDIFAMI	16
CSPX	41.734
ECOPETROL	25.311.317
EIMI	427.189
ELCONDOR	34.858
ENELAMCO	47.638.203
ENKA	3.069.219
ESTRA	-
ETB	243.693
EXITO	14.142
FABRICATO	3.213.956
FALABELLCO	3.595.195
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	7.111.959
GEB	1.021.636
GRUBOLIVAR	2.371
GRUPOARGOS	196.039
GRUPOAVAL	44.112
GRUPOSURA	227.293
HCOLSEL	151.146
ICOLCAP	444.979
INESA	-



**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
INVENSA	-
ISA	344.072
ISAC	64.752
IUFS	243.491
IUIT	103.357
JNJ	5.873.296
JPEA	469.911
JPM	10.085.050
JPM	10.085.050
MINEROS	82.765
NUTRESA	125.006
OCCIDENTE	339
PAZRIO	3.325
PFAVAL	9.542.672
PFAVH	439.141
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1.556.110
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	41.799
PFCORFICOL	6.048
PFDAVVNDA	102.642
PFE	24.203.215
PFGRUPOARG	32.853
PFGRUPSURA	43.434
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	49
PFVILLASCA	1
POPULAR	298
PROMIGAS	29.318
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 acciones
SANFELIPE	-
SDHA	110.457
SQMBCO	179
SUAS	375.292
TERPEL	19.438
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	197
VILLAS	2.478

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías