



Boletín informativo

No.170 / 13 de diciembre 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 14 de diciembre de 2021 hasta el 20 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.410.000.000	173.573
CEMARGOS	2.740.000.000	482.352
CORFICOLCF	3.000.000.000	100.183
ECOPETROL	66.730.000.000	24.681.539
GEB	2.360.000.000	885.910
GRUPOARGO	2.680.000.000	222.217
GRUPOSURA	5.720.000.000	272.572
ISA	7.330.000.000	324.415
NUTRESA	3.190.000.000	134.486
PFAVAL	9.140.000.000	8.250.887
PFBCOLOM	49.340.000.000	1.594.876
PFDVVNDA	2.850.000.000	91.456
PFGRUPSURA	1.010.000.000	52.102
ICOLCAP	5.500.000.000	395.988

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de diciembre de 2021 hasta el 20 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2.000.000.000.000	79.498.379
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.180.935
BAC	1.000.000.000.000	45.120.308
BBVACOL	10.000.000	23.401
BCOLOMBIA	5.410.000.000	173.573
BMC	-	26
BOGOTA	550.000.000	7.694
BVC	200.000.000	20.121





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
C	1.000.000.000.000	19.703.904
CARTON	-	-
CELSIA	670.000.000	158.388
CEMARGOS	2.740.000.000	482.352
CENCOSUDCO	32.170.000.000	4.942.031
CFMITNIPCO	4.300.000.000	322.690
CHILECO	37.340.000.000	102.817.248
CLH	90.000.000	27.496
CNEC	1.050.000.000	101.820
COLTEJER	-	79
CONCONCRET	140.000.000	438.678
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	3.000.000.000	100.183
CREDIFAMI	-	16
CSPX	77.040.000.000	44.441
ECOPETROL	66.730.000.000	24.681.539
EIMI	54.110.000.000	389.537
ELCONDOR	30.000.000	38.197
ENELAMCO	31.060.000.000	62.305.025
ENKA	40.000.000	1.715.633
ESTRA	-	-
ETB	40.000.000	211.032
EXITO	170.000.000	13.460
FABRICATO	20.000.000	3.430.122
FALABELLCO	58.200.000.000	4.004.172
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	1.000.000.000.000	7.875.353
GEB	2.360.000.000	885.910
GRUBOLIVAR	350.000.000	4.999
GRUPOARGOS	2.680.000.000	222.217



**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	45.695
GRUPOSURA	5.720.000.000	272.572
HCOLSEL	2.280.000.000	182.116
ICOLCAP	5.500.000.000	395.988
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.330.000.000	324.415
ISAC	17.900.000.000	68.499
IUFS	11.120.000.000	267.939
IUIT	8.940.000.000	118.717
JNJ	1.000.000.000.000	6.460.058
JPEA	9.920.000.000	433.231
JPM	1.000.000.000.000	10.768.335
JPM	1.000.000.000.000	10.768.335
MINEROS	440.000.000	114.907
NUTRESA	3.190.000.000	134.486
OCCIDENTE	10.000.000	342
PAZRIO	-	126.052
PFAVAL	9.140.000.000	8.250.887
PFAVH	40.000.000	423.360
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	49.340.000.000	1.594.876
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	160.000.000	38.828
PFCORFICOL	110.000.000	4.718
PFDVVNDA	2.850.000.000	91.456
PFE	2.000.000.000.000	32.141.837
PFGRUPOARG	350.000.000	38.318
PFGRUPSURA	1.010.000.000	52.102
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	5



**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	-	0
POPULAR	-	181
PROMIGAS	180.000.000	25.243
PROTECCION	-	4
SANFELIPE	-	-
SDHA	2.650.000.000	118.098
SQMBCO	40.000.000	207
SUAS	18.010.000.000	399.177
TERPEL	140.000.000	17.829
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	116
VILLAS	20.000.000	3.974

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de diciembre de 2021 hasta el 20 de diciembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	79.498.379
AGROCHAL	-
AMZN	3.180.935
BAC	45.120.308
BBVACOL	23.401
BCOLOMBIA	173.573
BMC	26
BOGOTA	7.694
BVC	20.121
C	19.703.904
CARTON	-
CELSIA	158.388
CEMARGOS	482.352
CENCOSUDCO	4.942.031





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CFMITNIPCO	322.690
CHILECO	102.817.248
CLH	27.496
CNEC	101.820
COLTEJER	79
CONCONCRET	438.678
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	100.183
CREDIFAMI	16
CSPX	44.441
ECOPETROL	24.681.539
EIMI	389.537
ELCONDOR	38.197
ENELAMCO	62.305.025
ENKA	1.715.633
ESTRA	-
ETB	211.032
EXITO	13.460
FABRICATO	3.430.122
FALABELLCO	4.004.172
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	7.875.353
GEB	885.910
GRUBOLIVAR	4.999
GRUPOARGOS	222.217
GRUPOAVAL	45.695
GRUPOSURA	272.572
HCOLSEL	182.116
ICOLCAP	395.988
INESA	-





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	324.415
ISAC	68.499
IUFS	267.939
IUIT	118.717
JNJ	6.460.058
JPEA	433.231
JPM	10.768.335
JPM	10.768.335
MINEROS	114.907
NUTRESA	134.486
OCCIDENTE	342
PAZRIO	126.052
PFAVAL	8.250.887
PFAVH	423.360
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1.594.876
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	38.828
PFCORFICOL	4.718
PFDAVVNDA	91.456
PFE	32.141.837
PFGRUPOARG	38.318
PFGRUPSURA	52.102
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	5
PFVILLASCA	0
POPULAR	181
PROMIGAS	25.243
PROTECCION	4



**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	118.098
SQMBCO	207
SUAS	399.177
TERPEL	17.829
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	116
VILLAS	3.974

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías