



Boletín informativo

No.177 / 27 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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de diciembre de 2021 hasta el 03 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,380,000,000	165,874
CEMARGOS	2,660,000,000	464,467
CORFICOLCF	2,920,000,000	97,577
ECOPETROL	61,880,000,000	22,469,967
GEB	2,260,000,000	845,403
GRUPOARGOS	2,610,000,000	216,423





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6,100,000,000	276,844
ISA	7,150,000,000	322,146
NUTRESA	3,510,000,000	144,189
PFAVAL	8,680,000,000	7,887,264
PFBCOLOM	47,760,000,000	1,541,985
PFDVVNDA	2,790,000,000	86,458
PFGRUPSURA	1,170,000,000	58,754
ICOLCAP	5,190,000,000	370,300

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de diciembre de 2021 hasta el 03 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	2,000,000,000,000	82,798,419
AGROCHAL	-	-
AMZN	2,000,000,000,000	3,155,113
BAC	2,000,000,000,000	45,599,124
BBVACOL	10,000,000	24,803
BCOLOMBIA	5,380,000,000	165,874
BMC	-	26
BOGOTA	490,000,000	6,766
BVC	190,000,000	19,459
C	1,000,000,000,000	19,702,250



**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
CARTON	-	-
CELSIA	650,000,000	153,766
CEMARGOS	2,660,000,000	464,467
CENCOSUDCO	32,230,000,000	5,040,822
CFMITNIPCO	4,710,000,000	359,816
CHILECO	38,720,000,000	103,577,270
CLH	90,000,000	27,791
CNEC	1,060,000,000	102,180
COLTEJER	-	107
CONCRET	160,000,000	491,209
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,920,000,000	97,577
CREDIFAMI	-	16
CSPX	79,520,000,000	45,144
ECOPETROL	61,880,000,000	22,469,967
EIMI	49,800,000,000	358,926
ELCONDOR	30,000,000	36,980
ENELAMCO	30,280,000,000	61,168,876
ENKA	30,000,000	1,370,312
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	216,892
EXITO	160,000,000	12,962
FABRICATO	20,000,000	3,426,830
FALABELLCO	59,350,000,000	4,098,801
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,172,556
GEB	2,260,000,000	845,403
GRUBOLIVAR	400,000,000	5,723
GRUPOARGOS	2,610,000,000	216,423
GRUPOAVAL	60,000,000	51,440



**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
GRUPOSURA	6,100,000,000	276,844
HCOLSEL	2,250,000,000	178,794
ICOLCAP	5,190,000,000	370,300
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,150,000,000	322,146
ISAC	18,430,000,000	70,004
IUFS	10,590,000,000	260,762
IUIT	9,170,000,000	119,259
JNJ	1,000,000,000,000	6,531,188
JPEA	10,220,000,000	443,392
JPM	1,000,000,000,000	10,913,461
JPM	1,000,000,000,000	10,913,461
MINEROS	400,000,000	105,750
NUTRESA	3,510,000,000	144,189
OCCIDENTE	-	68
PAZRIO	-	149,069
PFAVAL	8,680,000,000	7,887,264
PFAVH	20,000,000	259,782
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	47,760,000,000	1,541,985
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	160,000,000	39,537
PFCORFICOL	100,000,000	4,350
PFDVVNDA	2,790,000,000	86,458
PFE	2,000,000,000,000	34,889,016
PFGRUPOARG	340,000,000	36,847
PFGRUPSURA	1,170,000,000	58,754
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	5
PFVILLASCA	-	0



**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
POPULAR	-	1,698
PROMIGAS	180,000,000	24,379
PROTECCION	-	4
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,120,000,000	137,656
SQMBCO	40,000,000	211
SUAS	18,180,000,000	397,329
TERPEL	140,000,000	17,060
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	86
VILLAS	20,000,000	4,006

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de diciembre de 2021 hasta el 03 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	82,798,419
AGROCHAL	-
AMZN	3,155,113
BAC	45,599,124
BBVACOL	24,803
BCOLOMBIA	165,874
BMC	26
BOGOTA	6,766
BVC	19,459
C	19,702,250
CARTON	-
CELSIA	153,766
CEMARGOS	464,467
CENCOSUDCO	5,040,822
CFMITNIPCO	359,816



**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
CHILECO	103,577,270
CLH	27,791
CNEC	102,180
COLTEJER	107
CONCRET	491,209
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	97,577
CREDIFAMI	16
CSPX	45,144
ECOPETROL	22,469,967
EIMI	358,926
ELCONDOR	36,980
ENELAMCO	61,168,876
ENKA	1,370,312
ESTRA	-
ETB	216,892
EXITO	12,962
FABRICATO	3,426,830
FALABELLCO	4,098,801
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	7,172,556
GEB	845,403
GRUBOLIVAR	5,723
GRUPOARGOS	216,423
GRUPOAVAL	51,440
GRUPOSURA	276,844
HCOLSEL	178,794
ICOLCAP	370,300
INESA	-
INVENSA	-
ISA	322,146



**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
ISAC	70,004
IUFS	260,762
IUIT	119,259
JNJ	6,531,188
JPEA	443,392
JPM	10,913,461
JPM	10,913,461
MINEROS	105,750
NUTRESA	144,189
OCCIDENTE	68
PAZRIO	149,069
PFAVAL	7,887,264
PFAVH	259,782
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,541,985
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	39,537
PFCORFICOL	4,350
PFDAVVNDA	86,458
PFE	34,889,016
PFGRUPOARG	36,847
PFGRUPSURA	58,754
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	5
PVILLASCA	0
POPULAR	1,698
PROMIGAS	24,379
PROTECCION	4
SANFELIPE	-
SDHA	137,656



**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
SQMBCO	211
SUAS	397,329
TERPEL	17,060
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	86
VILLAS	4,006

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías