



Boletín informativo

No.006 / 17 de enero de 2022

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 18 de enero de 2022 hasta el 24 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,640,000,000	176,123
CEMARGOS	2,560,000,000	416,654
CORFICOLCF	2,060,000,000	70,583
ECOPETROL	53,700,000,000	19,498,551
GEB	2,170,000,000	817,800
GRUPOARGOS	2,620,000,000	216,399





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6,550,000,000	290,029
ISA	7,180,000,000	321,134
NUTRESA	3,680,000,000	149,964
PFAVAL	7,010,000,000	6,446,445
PFBCOLOM	47,550,000,000	1,542,162
PFDVVNDA	2,210,000,000	68,533
PFGRUPSURA	1,220,000,000	60,361
ICOLCAP	5,120,000,000	360,925

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 18 de enero de 2022 hasta el 24 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	82,277,332
AGROCHAL	-	-
AMZN	2,000,000,000,000	2,818,357
BAC	2,000,000,000,000	44,399,922
BBVACOL	-	15,028
BCOLOMBIA	5,640,000,000	176,123
BMC	-	54
BOGOTA	460,000,000	6,334
BVC	170,000,000	17,480
C	2,000,000,000,000	19,861,376



**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	630,000,000	149,918
CEMARGOS	2,560,000,000	416,654
CENCOSUDCO	33,040,000,000	5,212,829
CFMITNIPCO	4,430,000,000	341,633
CHILECO	43,480,000,000	122,110,222
CLH	90,000,000	24,890
CNEC	1,050,000,000	99,814
COLTEJER	-	58
CONCRET	160,000,000	489,409
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,060,000,000	70,583
CREDIFAMI	-	16
CSPX	79,380,000,000	44,172
ECOPETROL	53,700,000,000	19,498,551
EIMI	42,840,000,000	305,259
ELCONDOR	30,000,000	31,884
ENELAMCO	28,960,000,000	60,017,706
ENKA	30,000,000	1,222,297
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	209,017
EXITO	120,000,000	10,439
FABRICATO	20,000,000	3,389,550
FALABELLCO	50,580,000,000	4,054,029
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,418,346
GEB	2,170,000,000	817,800
GRUBOLIVAR	390,000,000	5,568
GRUPOARGOS	2,620,000,000	216,399
GRUPOAVAL	60,000,000	53,968



**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	6,550,000,000	290,029
HCOLSEL	2,000,000,000	157,503
ICOLCAP	5,120,000,000	360,925
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,180,000,000	321,134
ISAC	21,780,000,000	76,264
IUFS	9,540,000,000	218,640
IUIT	9,680,000,000	123,260
JNJ	1,000,000,000,000	6,452,251
JPEA	8,060,000,000	346,953
JPM	1,000,000,000,000	11,084,209
JPM	1,000,000,000,000	11,084,209
MINEROS	400,000,000	106,226
NUTRESA	3,680,000,000	149,964
OCCIDENTE	-	51
PAZRIO	-	383,769
PFAVAL	7,010,000,000	6,446,445
PFAVH	10,000,000	180,134
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	47,550,000,000	1,542,162
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	190,000,000	45,593
PFCORFICOL	90,000,000	3,810
PFDAVVNDA	2,210,000,000	68,533
PFE	2,000,000,000,000	36,320,156
PFGRUPOARG	360,000,000	39,185
PFGRUPSURA	1,220,000,000	60,361
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	9
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	-	1,727
PROMIGAS	150,000,000	21,170
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,100,000,000	136,602
SQMBCO	40,000,000	205
SUAS	20,960,000,000	408,186
TERPEL	150,000,000	17,943
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	55
VILLAS	20,000,000	3,411

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 18 de enero de 2022 hasta el 24 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	82,277,332
AGROCHAL	-
AMZN	2,818,357
BAC	44,399,922
BBVACOL	15,028
BCOLOMBIA	176,123
BMC	54
BOGOTA	6,334
BVC	17,480
C	19,861,376
CARTON	-
CELSIA	149,918
CEMARGOS	416,654
CENCOSUDCO	5,212,829
CFMITNIPCO	341,633





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CHILECO	122,110,222
CLH	24,890
CNEC	99,814
COLTEJER	58
CONCRET	489,409
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	70,583
CREDIFAMI	16
CSPX	44,172
ECOPETROL	19,498,551
EIMI	305,259
ELCONDOR	31,884
ENELAMCO	60,017,706
ENKA	1,222,297
ESTRA	-
ETB	209,017
EXITO	10,439
FABRICATO	3,389,550
FALABELLCO	4,054,029
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,418,346
GEB	817,800
GRUBOLIVAR	5,568
GRUPOARGOS	216,399
GRUPOAVAL	53,968
GRUPOSURA	290,029
HCOLSEL	157,503
ICOLCAP	360,925
INESA	-
INVENSA	-
ISA	321,134



**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	76,264
IUFS	218,640
IUIT	123,260
JNJ	6,452,251
JPEA	346,953
JPM	11,084,209
JPM	11,084,209
MINEROS	106,226
NUTRESA	149,964
OCCIDENTE	51
PAZRIO	383,769
PFAVAL	6,446,445
PFAVH	180,134
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,542,162
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	45,593
PFCORFICOL	3,810
PFDAVVNDA	68,533
PFE	36,320,156
PFGRUPOARG	39,185
PFGRUPSURA	60,361
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	9
PVILLASCA	0
POPULAR	1,727
PROMIGAS	21,170
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	136,602



**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	205
SUAS	408,186
TERPEL	17,943
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	55
VILLAS	3,411

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías