



## Boletín informativo

**No.011 / Enero 25 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](mailto: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 26 de enero 2021 hasta el 01 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.554.000.000	242.411
CELSIA	933.000.000	194.365
CEMARGOS	3.003.000.000	500.526
CORFICOLCF	2.190.000.000	67.421
ECOPETROL	71.438.000.000	30.347.643
GEB	2.735.000.000	963.166
GRUPOARGOS	2.875.000.000	206.825
GRUPOSURA	6.639.000.000	272.527
ISA	7.848.000.000	301.839
NUTRESA	3.304.000.000	132.214
PFAVAL	9.858.000.000	8.535.278
PFBCOLOM	51.772.000.000	1.628.056
PFDVVNDA	3.999.000.000	123.801
PFGRUPSURA	2.032.000.000	92.820
ICOLCAP	7.148.000.000	495.100

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de enero 2021 hasta el 01 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	79.453.507
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.972.699
BAC	1.000.000.000.000	55.529.141
BBVACOL	21.000.000	70.292
BCOLOMBIA	7.554.000.000	242.411
BMC	1.000.000	695
BOGOTA	592.000.000	7.266



**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
BVC	386.000.000	30.403
C	1.000.000.000.000	22.620.664
CARTON	6.000.000	597
CELSIA	933.000.000	194.365
CEMARGOS	3.003.000.000	500.526
CLH	2.846.000.000	606.717
CNEC	1.799.000.000	175.559
COLTEJER	1.000.000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	242.000.000	479.427
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2.190.000.000	67.421
CREDIFAMI	1.293.000.000	517.118
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	71.438.000.000	30.347.643
ELCONDOR	83.000.000	69.449
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	70.000.000	5.685.139
ESTRA	-	-
ETB	197.000.000	919.559
EXITO	214.000.000	15.742
FABRICATO	16.000.000	3.016.066
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	18.563.515
FGNTOLIMA	-	-



**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
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	92.044.039
GEB	2.735.000.000	963.166
GRUBOLIVAR	231.000.000	3.447
GRUPOARGOS	2.875.000.000	206.825
GRUPOAVAL	81.000.000	70.084
GRUPOSURA	6.639.000.000	272.527
HCOLSEL	4.802.000.000	358.934
ICOLCAP	7.148.000.000	495.100
INCASTILLA	-	-
INESA	11.000.000	26.662
INVENSA	34.000.000	66.935
ISA	7.848.000.000	301.839
JNJ	1.000.000.000.000	6.601.983
JPM	1.000.000.000.000	14.738.849
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	537.000.000	122.989
MOAT	73.835.000.000	326.242
NUTRESA	3.304.000.000	132.214
OCCIDENTE	109.000.000	3.208
ORBIS	-	-
PAZRIO	1.000.000	168.900
PFAVAL	9.858.000.000	8.535.278
PFAVH	35.000.000	191.415
PFBBVACOL	-	-
PFBCELOM	51.772.000.000	1.628.056
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	372.000.000	80.590





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	589.000.000	22.225
PFDVVVDA	3.999.000.000	123.801
PFE	1.000.000.000.000	32.623.313
PFGRUPOARG	500.000.000	47.182
PFGRUPSURA	2.032.000.000	92.820
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	9.000.000	1.960
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	10.000.000	34.035
PROMIGAS	177.000.000	21.831
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4.000.000	7.395
TERPEL	343.000.000	40.504
TGLSC	-	1.520
TITAN	51.000.000	3.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6.000.000	1.300
VILLAS	59.000.000	11.152

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de enero 2021 hasta el 01 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	79.453.507
AGROCHAL	-



**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
AMZN	3.972.699
BAC	55.529.141
BBVACOL	70.292
BCOLOMBIA	242.411
BMC	695
BOGOTA	7.266
BVC	30.403
C	22.620.664
CARTON	597
CELSIA	194.365
CEMARGOS	500.526
CLH	606.717
CNEC	175.559
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	479.427
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	67.421
CREDIFAMI	517.118
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	30.347.643
ELCONDOR	69.449
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.685.139
ESTRA	-
ETB	919.559



**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
EXITO	15.742
FABRICATO	3.016.066
FAMILIA	-
FB	18.563.515
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	92.044.039
GEB	963.166
GRUBOLIVAR	3.447
GRUPOARGOS	206.825
GRUPOAVAL	70.084
GRUPOSURA	272.527
HCOLSEL	358.934
ICOLCAP	495.100
INCASTILLA	-
INESA	26.662
INVENSA	66.935
ISA	301.839
JNJ	6.601.983
JPM	14.738.849
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	122.989
MOAT	326.242
NUTRESA	132.214
OCCIDENTE	3.208
ORBIS	-
PAZRIO	168.900
PFAVAL	8.535.278
PFAVH	191.415





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.628.056
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	80.590
PFCORFICOL	22.225
PFDVVNDA	123.801
PFE	32.623.313
PFGRUPOARG	47.182
PFGRUPSURA	92.820
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.960
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	34.035
PROMIGAS	21.831
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7.395
TERPEL	40.504
TGLSC	1.520
TITAN	3.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.300
VILLAS	11.152

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías



**CÁMARA  
DE RIESGO**  
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de  
las transacciones generando  
seguridad y transparencia al  
mercado de capitales colombiano.*