



## Boletín informativo

**No.084 / Junio 21 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 22 de junio de 2021 hasta el 28 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,455,000,000	268,167
CELSIA	900,000,000	211,936
CEMARGOS	2,388,000,000	443,392
CORFICOLCF	1,921,000,000	64,034
ECOPETROL	66,053,000,000	27,556,709
GEB	4,529,000,000	1,856,941
GRUPOARGOS	1,766,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,280,000,000	257,038
ISA	7,793,000,000	338,532
NUTRESA	3,249,000,000	144,389
PFAVAL	7,242,000,000	6,583,478
PFBCOLOM	41,931,000,000	1,508,839
PFDAVVNDA	3,828,000,000	132,450
PFGRUPSURA	903,000,000	49,627
ICOLCAP	7,145,000,000	560,312

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de junio de 2021 hasta el 28 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	86,572,957
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,501,639
BAC	1,000,000,000,000	47,078,071
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,455,000,000	268,167
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	418,000,000	5,948
BVC	521,000,000	45,981
C	1,000,000,000,000	19,028,500
CARTON	35,000,000	3,566



**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
CELSIA	900,000,000	211,936
CEMARGOS	2,388,000,000	443,392
CLH	87,000,000	22,834
CNEC	1,075,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,611
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	127,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,921,000,000	64,034
CREDIFAMI	527,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	66,053,000,000	27,556,709
ELCONDOR	37,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	104,000,000	7,118,377
ESTRA	-	-
ETB	122,000,000	611,669
EXITO	129,000,000	10,820
FABRICATO	13,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	60,034,738
GEB	4,529,000,000	1,856,941
GRUBOLIVAR	437,000,000	6,068
GRUPOARGOS	1,766,000,000	168,187
GRUPOAVAL	40,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,280,000,000	257,038
HCOLSEL	4,683,000,000	393,144
ICOLCAP	7,145,000,000	560,312



**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
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,793,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,051,996
JPM	1,000,000,000,000	14,326,833
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	580,000,000	145,739
MOAT	103,456,000,000	377,748
NUTRESA	3,249,000,000	144,389
OCCIDENTE	85,000,000	2,505
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	319,147
PFAVAL	7,242,000,000	6,583,478
PFAVH	87,000,000	311,615
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	41,931,000,000	1,508,839
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	179,000,000	48,346
PFCORFICOL	218,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,828,000,000	132,450
PFE	1,000,000,000,000	27,598,957
PFGRUPOARG	210,000,000	24,701
PFGRUPSURA	903,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	12,000,000	2,614
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	422,000,000	62,888
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-



**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
SANFELIPE	-	-
TERPEL	87,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8,000,000	1,805
VILLAS	14,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de junio de 2021 hasta el 28 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	86,572,957
AGROCHAL	-
AMZN	3,501,639
BAC	47,078,071
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	268,167
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	45,981
C	19,028,500
CARTON	3,566
CELSIA	211,936
CEMARGOS	443,392
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,611
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,034
CREDIFAMI	199,159



**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
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	27,556,709
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,118,377
ESTRA	-
ETB	611,669
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	60,034,738
GEB	1,856,941
GRUBOLIVAR	6,068
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	257,038
HCOLSEL	393,144
ICOLCAP	560,312
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,051,996
JPM	14,326,833
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	145,739
MOAT	377,748
NUTRESA	144,389
OCCIDENTE	2,505



**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
DESCAUCANO	-
PAZRIO	319,147
PFAVAL	6,583,478
PFAVH	311,615
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,508,839
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDVVNDA	132,450
PFE	27,598,957
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,614
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	62,888
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,805
VILLAS	3,328

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.*