



## Boletín informativo

**No.087 / 28 de junio 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 29 de junio de 2021 hasta el 5 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,292,000,000	263,442
CELSIA	887,000,000	210,648
CEMARGOS	2,430,000,000	444,309
CORFICOLCF	1,966,000,000	65,674
ECOPETROL	76,025,000,000	27,445,779
GEB	4,207,000,000	1,661,548
GRUPOARGOS	1,816,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,000,000,000	252,537
ISA	7,603,000,000	338,532
NUTRESA	3,234,000,000	144,389
PFAVAL	6,895,000,000	6,161,485
PFBCOLOM	41,263,000,000	1,492,860
PFDAVVNDA	3,896,000,000	132,193
PFGRUPSURA	857,000,000	48,312
ICOLCAP	7,257,000,000	558,408

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de junio de 2021 hasta el 5 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	83,281,007
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,481,014
BAC	1,000,000,000,000	45,767,082
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,292,000,000	263,442
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	419,000,000	5,948
BVC	515,000,000	45,469
C	1,000,000,000,000	19,476,669
CARTON	41,000,000	4,185



**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	887,000,000	210,648
CEMARGOS	2,430,000,000	444,309
CLH	84,000,000	22,834
CNEC	1,111,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,611
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	126,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,966,000,000	65,674
CREDIFAMI	527,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	76,025,000,000	27,445,779
ELCONDOR	36,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	102,000,000	7,001,277
ESTRA	-	-
ETB	123,000,000	587,480
EXITO	154,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	58,202,096
GEB	4,207,000,000	1,661,548
GRUBOLIVAR	425,000,000	6,068
GRUPOARGOS	1,816,000,000	168,187
GRUPOAVAL	42,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,000,000,000	252,537
HCOLSEL	4,852,000,000	397,099
ICOLCAP	7,257,000,000	558,408





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,603,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,016,714
JPM	1,000,000,000,000	14,160,802
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	592,000,000	145,071
MOAT	103,620,000,000	373,039
NUTRESA	3,234,000,000	144,389
OCCIDENTE	85,000,000	2,505
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	319,147
PFAVAL	6,895,000,000	6,161,485
PFAVH	96,000,000	322,900
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	41,263,000,000	1,492,860
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	189,000,000	48,346
PFCORFICOL	215,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,896,000,000	132,193
PFE	1,000,000,000,000	26,648,518
PFGRUPOARG	215,000,000	24,701
PFGRUPSURA	857,000,000	48,312
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	12,000,000	2,614
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	424,000,000	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	85,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8,000,000	1,805
VILLAS	14,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de junio de 2021 hasta el 5 de julio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83,281,007
AGROCHAL	-
AMZN	3,481,014
BAC	45,767,082
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	263,442
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	45,469
C	19,476,669
CARTON	4,185
CELSIA	210,648
CEMARGOS	444,309
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,611
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	65,674
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	27,445,779
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,001,277
ESTRA	-
ETB	587,480
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	58,202,096
GEB	1,661,548
GRUBOLIVAR	6,068
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	252,537
HCOLSEL	397,099
ICOLCAP	558,408
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,016,714
JPM	14,160,802
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	145,071
MOAT	373,039
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
ORBIS	-
PAZRIO	319,147
PFAVAL	6,161,485
PFAVH	322,900
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,492,860
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDVVNDA	132,193
PFE	26,648,518
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	48,312
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	2,614
PVILLAS00	-
PVILLASCA	-
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