



## Boletín informativo

### No.014 / 31 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](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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de febrero de 2022 hasta el 07 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,590,000,000	193,969
CEMARGOS	2,770,000,000	481,396
CORFICOLCF	2,480,000,000	84,651
ECOPETROL	63,210,000,000	22,769,793
GEB	2,940,000,000	1,099,008
GRUPOARGOS	3,060,000,000	243,508





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6,260,000,000	278,229
ISA	7,790,000,000	343,257
NUTRESA	3,680,000,000	145,795
PFAVAL	7,530,000,000	6,933,513
PFBCOLOM	49,480,000,000	1,595,545
PFDVVNDA	2,840,000,000	87,434
PFGRUPSURA	1,770,000,000	80,257
ICOLCAP	6,970,000,000	491,654

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de febrero de 2022 hasta el 07 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	83,474,817
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,144,572
BAC	1,000,000,000,000	46,327,146
BBVACOL	10,000,000	17,075
BCOLOMBIA	6,590,000,000	193,969
BMC	-	98
BOGOTA	600,000,000	8,219
BVC	220,000,000	22,177
C	1,000,000,000,000	19,993,578



**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	820,000,000	189,956
CEMARGOS	2,770,000,000	481,396
CENCOSUDCO	34,170,000,000	5,363,009
CFMITNIPCO	4,230,000,000	327,973
CHILECO	40,340,000,000	108,060,250
CLH	80,000,000	24,124
CNEC	1,410,000,000	137,484
COLTEJER	-	54
CONCRET	170,000,000	474,024
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,480,000,000	84,651
CREDIFAMI	-	16
CSPX	87,340,000,000	48,418
ECOPETROL	63,210,000,000	22,769,793
EIMI	47,320,000,000	336,806
ELCONDOR	30,000,000	34,715
ENELAMCO	29,220,000,000	60,917,594
ENKA	30,000,000	1,499,048
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	265,716
EXITO	160,000,000	13,791
FABRICATO	20,000,000	3,763,498
FALABELLCO	59,050,000,000	4,074,107
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,765,208
GEB	2,940,000,000	1,099,008
GRUBOLIVAR	450,000,000	6,224
GRUPOARGOS	3,060,000,000	243,508
GRUPOAVAL	60,000,000	55,583



**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	6,260,000,000	278,229
HCOLSEL	2,080,000,000	162,173
ICOLCAP	6,970,000,000	491,654
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,790,000,000	343,257
ISAC	20,380,000,000	75,682
IUFS	10,720,000,000	255,421
IUIT	10,170,000,000	131,945
JNJ	1,000,000,000,000	6,638,798
JPEA	9,210,000,000	395,801
JPM	1,000,000,000,000	11,392,837
JPM	1,000,000,000,000	11,392,837
MINEROS	440,000,000	118,500
NUTRESA	3,680,000,000	145,795
OCCIDENTE	10,000,000	428
PAZRIO	-	595,598
PFAVAL	7,530,000,000	6,933,513
PFAVH	10,000,000	124,829
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	49,480,000,000	1,595,545
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	53,842
PFCORFICOL	170,000,000	7,314
PFDAVVNDA	2,840,000,000	87,434
PFE	1,000,000,000,000	32,640,529
PFGRUPOARG	540,000,000	53,003
PFGRUPSURA	1,770,000,000	80,257
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	155
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	-	2,034
PROMIGAS	250,000,000	34,470
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,150,000,000	138,806
SQMBCO	50,000,000	211
SUAS	19,230,000,000	409,379
TERPEL	190,000,000	21,605
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	20,000,000	3,827

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de febrero de 2022 hasta el 07 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83,474,817
AGROCHAL	-
AMZN	3,144,572
BAC	46,327,146
BBVACOL	17,075
BCOLOMBIA	193,969
BMC	98
BOGOTA	8,219
BVC	22,177
C	19,993,578
CARTON	-
CELSIA	189,956
CEMARGOS	481,396
CENCOSUDCO	5,363,009
CFMITNIPCO	327,973





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CHILECO	108,060,250
CLH	24,124
CNEC	137,484
COLTEJER	54
CONCONCRET	474,024
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	84,651
CREDIFAMI	16
CSPX	48,418
ECOPETROL	22,769,793
EIMI	336,806
ELCONDOR	34,715
ENELAMCO	60,917,594
ENKA	1,499,048
ESTRA	-
ETB	265,716
EXITO	13,791
FABRICATO	3,763,498
FALABELLCO	4,074,107
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,765,208
GEB	1,099,008
GRUBOLIVAR	6,224
GRUPOARGOS	243,508
GRUPOAVAL	55,583
GRUPOSURA	278,229
HCOLSEL	162,173
ICOLCAP	491,654
INESA	-
INVENSA	-
ISA	343,257



**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	75,682
IUFS	255,421
IUIT	131,945
JNJ	6,638,798
JPEA	395,801
JPM	11,392,837
JPM	11,392,837
MINEROS	118,500
NUTRESA	145,795
OCCIDENTE	428
PAZRIO	595,598
PFAVAL	6,933,513
PFAVH	124,829
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,595,545
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	53,842
PFCORFICOL	7,314
PFDAVVNDA	87,434
PFE	32,640,529
PFGRUPOARG	53,003
PFGRUPSURA	80,257
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	155
PVILLASCA	0
POPULAR	2,034
PROMIGAS	34,470
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	138,806





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
SQMBCO	211
SUAS	409,379
TERPEL	21,605
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	-
VILLAS	3,827

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías