



## Boletín informativo

**No.033 / Marzo 08 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 09 de marzo 2021 hasta el 15 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.337.000.000	244.556
CELSIA	872.000.000	188.643
CEMARGOS	2.342.000.000	433.213
CORFICOLCF	2.200.000.000	68.440
ECOPETROL	78.647.000.000	32.769.589
GEB	3.318.000.000	1.291.083
GRUPOARGOS	2.237.000.000	180.364
GRUPOSURA	6.157.000.000	274.856
ISA	7.672.000.000	325.085
NUTRESA	2.679.000.000	115.617
PFAVAL	10.177.000.000	8.811.409
PFBCOLOM	48.759.000.000	1.606.026
PFDVVNDA	3.683.000.000	113.108
PFGRUPSURA	1.667.000.000	85.026
ICOLCAP	7.206.000.000	528.096

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de marzo 2021 hasta el 15 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	87.652.133
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.633.645
BAC	1.000.000.000.000	50.961.402
BBVACOL	22.000.000	72.239
BCOLOMBIA	7.337.000.000	244.556
BMC	3.000.000	2.266
BOGOTA	531.000.000	6.779



**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	474.000.000	38.895
C	1.000.000.000.000	20.111.444
CARTON	27.000.000	2.782
CELSIA	872.000.000	188.643
CEMARGOS	2.342.000.000	433.213
CLH	317.000.000	82.337
CNEC	1.373.000.000	133.036
COLTEJER	1.000.000	870
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	246.000.000	511.752
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32.000.000	63.215
CORFICOLCF	2.200.000.000	68.440
CREDIFAMI	873.000.000	327.479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	78.647.000.000	32.769.589
ELCONDOR	62.000.000	57.936
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	92.000.000	6.367.674
ESTRA	-	-
ETB	224.000.000	935.238
EXITO	134.000.000	9.873
FABRICATO	11.000.000	2.447.331
FAMILIA	24.000.000	5.257
FB	1.000.000.000.000	18.829.068
FGNTOLIMA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	77.362.629
GEB	3.318.000.000	1.291.083
GRUBOLIVAR	190.000.000	2.976
GRUPOARGOS	2.237.000.000	180.364
GRUPOAVAL	65.000.000	55.204
GRUPOSURA	6.157.000.000	274.856
HCOLSEL	4.054.000.000	323.518
ICOLCAP	7.206.000.000	528.096
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.672.000.000	325.085
JNJ	1.000.000.000.000	7.290.078
JPM	1.000.000.000.000	13.664.908
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	534.000.000	129.572
MOAT	79.383.000.000	327.241
NUTRESA	2.679.000.000	115.617
OCCIDENTE	84.000.000	2.504
ORBIS	-	-
PAZRIO	2.000.000	202.479
PFAVAL	10.177.000.000	8.811.409
PFAVH	28.000.000	171.361
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	48.759.000.000	1.606.026
PFCARPAK	10.000.000	1.887
PFCEMARGOS	304.000.000	73.924



**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
PFCORFICOL	349.000.000	13.109
PFDVVVDA	3.683.000.000	113.108
PFE	1.000.000.000.000	33.145.740
PFGRUPOARG	371.000.000	38.289
PFGRUPSURA	1.667.000.000	85.026
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11.000.000	2.436
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6.000.000	1.483
POPULAR	10.000.000	35.307
PROMIGAS	393.000.000	50.722
PROTECCION	42.000.000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	117.000.000	14.780
TGLSC	-	-
TITAN	119.000.000	7.000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	11.000.000	2.162
VILLAS	51.000.000	10.226

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de marzo 2021 hasta el 15 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	87.652.133
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	3.633.645
BAC	50.961.402
BBVACOL	72.239
BCOLOMBIA	244.556
BMC	2.266
BOGOTA	6.779
BVC	38.895
C	20.111.444
CARTON	2.782
CELSIA	188.643
CEMARGOS	433.213
CLH	82.337
CNEC	133.036
COLTEJER	870
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	511.752
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63.215
CORFICOLCF	68.440
CREDIFAMI	327.479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	32.769.589
ELCONDOR	57.936
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6.367.674
ESTRA	-
ETB	935.238



**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	9.873
FABRICATO	2.447.331
FAMILIA	5.257
FB	18.829.068
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	77.362.629
GEB	1.291.083
GRUBOLIVAR	2.976
GRUPOARGOS	180.364
GRUPOAVAL	55.204
GRUPOSURA	274.856
HCOLSEL	323.518
ICOLCAP	528.096
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	325.085
JNJ	7.290.078
JPM	13.664.908
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	129.572
MOAT	327.241
NUTRESA	115.617
OCCIDENTE	2.504
ORBIS	-
PAZRIO	202.479
PFAVAL	8.811.409
PFAVH	171.361





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.606.026
PFCARPAK	1.887
PFCEMARGOS	73.924
PFCORFICOL	13.109
PFDVVNDA	113.108
PFE	33.145.740
PFGRUPOARG	38.289
PFGRUPSURA	85.026
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.436
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1.483
POPULAR	35.307
PROMIGAS	50.722
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	14.780
TGLSC	-
TITAN	7.000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2.162
VILLAS	10.226

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías