



## Boletín informativo

**No.038 / Marzo 15 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 16 de marzo 2021 hasta el 22 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,438,000,000	243,723
CELSIA	915,000,000	189,772
CEMARGOS	2,120,000,000	386,852
CORFICOLCF	2,146,000,000	66,266
ECOPETROL	78,561,000,000	33,036,609
GEB	3,368,000,000	1,323,302
GRUPOARGOS	2,136,000,000	166,364
GRUPOSURA	6,142,000,000	271,759
ISA	7,773,000,000	326,876
NUTRESA	2,750,000,000	117,755
PFAVAL	9,609,000,000	8,255,183
PFBCOLOM	48,372,000,000	1,566,451
PFDVVNDA	3,630,000,000	116,353
PFGRUPSURA	1,457,000,000	73,577
ICOLCAP	7,639,000,000	557,939

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de marzo 2021 hasta el 22 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	88,552,177
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,631,106
BAC	1,000,000,000,000	51,405,781
BBVACOL	20,000,000	65,694
BCOLOMBIA	7,438,000,000	243,723
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	473,000,000	5,991



**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	39,008
C	1,000,000,000,000	19,981,765
CARTON	30,000,000	3,076
CELSIA	915,000,000	189,772
CEMARGOS	2,120,000,000	386,852
CLH	277,000,000	68,277
CNEC	1,282,000,000	123,850
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	246,000,000	512,085
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,146,000,000	66,266
CREDIFAMI	873,000,000	327,479
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	78,561,000,000	33,036,609
ELCONDOR	52,000,000	49,055
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	99,000,000	6,611,680
ESTRA	-	-
ETB	203,000,000	932,283
EXITO	119,000,000	8,634
FABRICATO	10,000,000	2,158,512
FAMILIA	24,000,000	5,257
FB	1,000,000,000,000	18,920,757
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	84,464,581
GEB	3,368,000,000	1,323,302
GRUBOLIVAR	194,000,000	3,002
GRUPOARGOS	2,136,000,000	166,364
GRUPOAVAL	68,000,000	58,513
GRUPOSURA	6,142,000,000	271,759
HCOLSEL	4,147,000,000	327,280
ICOLCAP	7,639,000,000	557,939
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,773,000,000	326,876
JNJ	1,000,000,000,000	7,403,767
JPM	1,000,000,000,000	13,865,269
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	530,000,000	127,405
MOAT	82,528,000,000	336,386
NUTRESA	2,750,000,000	117,755
OCCIDENTE	50,000,000	1,479
ORBIS	-	-
PAZRIO	2,000,000	213,168
PFAVAL	9,609,000,000	8,255,183
PFAVH	27,000,000	159,046
PFBVACOL	-	-
PFBCELOM	48,372,000,000	1,566,451
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCMARGOS	297,000,000	71,333



**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	256,000,000	9,922
PFDVVVDA	3,630,000,000	116,353
PFE	1,000,000,000,000	32,668,731
PFGRUPOARG	361,000,000	36,755
PFGRUPSURA	1,457,000,000	73,577
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	11,000,000	2,550
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	6,000,000	1,483
POPULAR	10,000,000	35,307
PROMIGAS	384,000,000	49,177
PROTECCION	42,000,000	346
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	114,000,000	14,109
TGLSC	-	-
TITAN	119,000,000	7,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10,000,000	2,196
VILLAS	47,000,000	9,412

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de marzo 2021 hasta el 22 de marzo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	88,552,177
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	3,631,106
BAC	51,405,781
BBVACOL	65,694
BCOLOMBIA	243,723
BMC	2,266
BOGOTA	5,991
BVC	39,008
C	19,981,765
CARTON	3,076
CELSIA	189,772
CEMARGOS	386,852
CLH	68,277
CNEC	123,850
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	512,085
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	66,266
CREDIFAMI	327,479
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	33,036,609
ELCONDOR	49,055
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	6,611,680
ESTRA	-
ETB	932,283



**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	8,634
FABRICATO	2,158,512
FAMILIA	5,257
FB	18,920,757
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	84,464,581
GEB	1,323,302
GRUBOLIVAR	3,002
GRUPOARGOS	166,364
GRUPOAVAL	58,513
GRUPOSURA	271,759
HCOLSEL	327,280
ICOLCAP	557,939
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	326,876
JNJ	7,403,767
JPM	13,865,269
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	127,405
MOAT	336,386
NUTRESA	117,755
OCCIDENTE	1,479
ORBIS	-
PAZRIO	213,168
PFAVAL	8,255,183
PFAVH	159,046



**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
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,566,451
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	71,333
PFCORFICOL	9,922
PFDVVNDA	116,353
PFE	32,668,731
PFGRUPOARG	36,755
PFGRUPSURA	73,577
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,550
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	1,483
POPULAR	35,307
PROMIGAS	49,177
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	14,109
TGLSC	-
TITAN	7,000
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2,196
VILLAS	9,412

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías