



## Boletín informativo

**No.062 / Abril 26 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 27 de abril 2021 hasta el 03 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,458,000,000	258,954
CELSIA	954,000,000	216,478
CEMARGOS	2,339,000,000	446,775
CORFICOLCF	2,080,000,000	64,310
ECOPETROL	70,053,000,000	31,442,237
GEB	4,716,000,000	1,800,537
GRUPOARGOS	1,897,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,380,000,000	260,913
ISA	7,241,000,000	324,716
NUTRESA	3,049,000,000	138,728
PFAVAL	8,383,000,000	7,353,218
PFBCOLOM	42,473,000,000	1,474,741
PFDAVVNDA	3,840,000,000	127,821
PFGRUPSURA	892,000,000	49,627
ICOLCAP	7,883,000,000	601,298

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 27 de abril 2021 hasta el 03 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	93,296,486
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,420,974
BAC	1,000,000,000,000	53,489,925
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,458,000,000	258,954
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	449,000,000	5,948
BVC	526,000,000	42,156
C	1,000,000,000,000	19,079,023
CARTON	29,000,000	2,989



**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	954,000,000	216,478
CEMARGOS	2,339,000,000	446,775
CLH	89,000,000	22,834
CNEC	1,088,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,684
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	127,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	2,080,000,000	64,310
CREDIFAMI	499,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	70,053,000,000	31,442,237
ELCONDOR	41,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	118,000,000	7,747,732
ESTRA	-	-
ETB	182,000,000	842,975
EXITO	128,000,000	10,820
FABRICATO	11,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	79,978,552
GEB	4,716,000,000	1,800,537
GRUBOLIVAR	282,000,000	3,948
GRUPOARGOS	1,897,000,000	168,187
GRUPOAVAL	43,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,380,000,000	260,913
HCOLSEL	5,171,000,000	428,378
ICOLCAP	7,883,000,000	601,298



**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	7,241,000,000	324,716
JNJ	1,000,000,000,000	7,170,333
JPM	1,000,000,000,000	14,440,776
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	548,000,000	129,316
MOAT	97,816,000,000	372,652
NUTRESA	3,049,000,000	138,728
OCCIDENTE	100,000,000	2,951
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	334,485
PFAVAL	8,383,000,000	7,353,218
PFAVH	28,000,000	213,043
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	42,473,000,000	1,474,741
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	190,000,000	48,346
PFCORFICOL	248,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,840,000,000	127,821
PFE	1,000,000,000,000	31,449,459
PFGRUPOARG	224,000,000	24,701
PFGRUPSURA	892,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,481
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	324,000,000	43,751
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	91,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8,000,000	1,728
VILLAS	17,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 27 de abril 2021 hasta el 03 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	93,296,486
AGROCHAL	-
AMZN	3,420,974
BAC	53,489,925
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	258,954
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	42,156
C	19,079,023
CARTON	2,989
CELSIA	216,478
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,684
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	64,310
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	31,442,237
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,747,732
ESTRA	-
ETB	842,975
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	79,978,552
GEB	1,800,537
GRUBOLIVAR	3,948
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	428,378
ICOLCAP	601,298
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	324,716
JNJ	7,170,333
JPM	14,440,776
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	129,316
MOAT	372,652
NUTRESA	138,728
OCCIDENTE	2,951



**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	334,485
PFAVAL	7,353,218
PFAVH	213,043
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,474,741
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDVVNDA	127,821
PFE	31,449,459
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	2,481
PVILLAS00	-
PVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	43,751
PROTECCION	346
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11,785
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1,728
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.*