



## Boletín informativo

**No.074 / Mayo 24 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 25 de mayo de 2021 hasta el 31 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,431,000,000	268,167
CELSIA	943,000,000	216,184
CEMARGOS	2,330,000,000	446,775
CORFICOLCF	1,939,000,000	65,832
ECOPETROL	70,841,000,000	31,002,628
GEB	4,544,000,000	1,814,742
GRUPOARGOS	1,813,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,174,000,000	260,913
ISA	7,106,000,000	338,532
NUTRESA	3,028,000,000	139,044
PFAVAL	7,563,000,000	6,844,791
PFBCOLOM	42,826,000,000	1,546,076
PFDAVVNDA	3,998,000,000	132,880
PFGRUPSURA	880,000,000	49,627
ICOLCAP	7,857,000,000	618,042

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de mayo de 2021 hasta el 31 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	97,937,480
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,616,370
BAC	1,000,000,000,000	50,286,974
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,431,000,000	268,167
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	419,000,000	5,948
BVC	501,000,000	42,866
C	1,000,000,000,000	19,488,987
CARTON	35,000,000	3,566



**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	943,000,000	216,184
CEMARGOS	2,330,000,000	446,775
CLH	86,000,000	22,834
CNEC	1,079,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,517
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	119,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,939,000,000	65,832
CREDIFAMI	529,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	70,841,000,000	31,002,628
ELCONDOR	39,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	119,000,000	7,646,643
ESTRA	-	-
ETB	140,000,000	667,444
EXITO	128,000,000	10,820
FABRICATO	13,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	77,482,463
GEB	4,544,000,000	1,814,742
GRUBOLIVAR	401,000,000	5,012
GRUPOARGOS	1,813,000,000	168,187
GRUPOAVAL	40,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,174,000,000	260,913
HCOLSEL	5,037,000,000	431,603
ICOLCAP	7,857,000,000	618,042



**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	7,106,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,117,315
JPM	1,000,000,000,000	13,908,580
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	551,000,000	131,109
MOAT	101,627,000,000	373,231
NUTRESA	3,028,000,000	139,044
OCCIDENTE	96,000,000	2,831
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	386,830
PFAVAL	7,563,000,000	6,844,791
PFAVH	28,000,000	219,243
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	42,826,000,000	1,546,076
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	185,000,000	48,346
PFCORFICOL	236,000,000	9,271
PFDVVNDA	3,998,000,000	132,880
PFE	1,000,000,000,000	30,177,720
PFGRUPOARG	213,000,000	24,701
PFGRUPSURA	880,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,459
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	280,000,000	38,887
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	93,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9,000,000	1,805
VILLAS	15,000,000	3,328

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de mayo de 2021 hasta el 31 de mayo de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	97,937,480
AGROCHAL	-
AMZN	3,616,370
BAC	50,286,974
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	268,167
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	42,866
C	19,488,987
CARTON	3,566
CELSIA	216,184
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,517
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	65,832
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	31,002,628
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,646,643
ESTRA	-
ETB	667,444
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	77,482,463
GEB	1,814,742
GRUBOLIVAR	5,012
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	431,603
ICOLCAP	618,042
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,117,315
JPM	13,908,580
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	131,109
MOAT	373,231
NUTRESA	139,044
OCCIDENTE	2,831





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
DESCAUCANO	-
PAZRIO	386,830
PFAVAL	6,844,791
PFAVH	219,243
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,546,076
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDAVVNDA	132,880
PFE	30,177,720
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,459
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	38,887
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