



## Boletín informativo

**No.079 / Junio 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 junio de 2021 hasta el 15 de junio de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,455,000,000	268,167
CELSIA	941,000,000	221,395
CEMARGOS	2,317,000,000	446,775
CORFICOLCF	1,907,000,000	66,766
ECOPETROL	71,257,000,000	30,257,931
GEB	4,492,000,000	1,855,573
GRUPOARGOS	1,719,000,000	168,187
GRUPOSURA	5,231,000,000	260,913
ISA	7,685,000,000	338,532
NUTRESA	3,132,000,000	144,389
PFAVAL	5,883,000,000	5,397,071
PFBCOLOM	41,118,000,000	1,458,076
PFDAVVNDA	4,152,000,000	136,624
PFGRUPSURA	868,000,000	49,627
ICOLCAP	7,574,000,000	599,528

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

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	92,905,086
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,467,199
BAC	1,000,000,000,000	48,243,286
BBVACOL	14,000,000	48,693
BCOLOMBIA	7,455,000,000	268,167
BMC	3,000,000	2,266
BOGOTA	423,000,000	5,948
BVC	527,000,000	46,224
C	1,000,000,000,000	18,041,199
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	941,000,000	221,395
CEMARGOS	2,317,000,000	446,775
CLH	87,000,000	22,834
CNEC	1,079,000,000	106,838
COLTEJER	2,000,000	1,707
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	126,000,000	314,473
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	32,000,000	63,215
CORFICOLCF	1,907,000,000	66,766
CREDIFAMI	527,000,000	199,159
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	71,257,000,000	30,257,931
ELCONDOR	39,000,000	39,345
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	114,000,000	7,537,386
ESTRA	-	-
ETB	141,000,000	659,695
EXITO	130,000,000	10,820
FABRICATO	13,000,000	2,542,936
FAMILIA	17,000,000	3,781
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1,000,000,000,000	72,509,410
GEB	4,492,000,000	1,855,573
GRUBOLIVAR	443,000,000	6,068
GRUPOARGOS	1,719,000,000	168,187
GRUPOAVAL	41,000,000	38,515
GRUPOSURA	5,231,000,000	260,913
HCOLSEL	4,718,000,000	400,828
ICOLCAP	7,574,000,000	599,528



**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	7,685,000,000	338,532
JNJ	1,000,000,000,000	7,087,477
JPM	1,000,000,000,000	13,805,274
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	562,000,000	139,814
MOAT	101,241,000,000	378,911
NUTRESA	3,132,000,000	144,389
OCCIDENTE	99,000,000	2,918
ORBIS	-	-
PAZRIO	3,000,000	347,021
PFAVAL	5,883,000,000	5,397,071
PFAVH	37,000,000	216,772
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	41,118,000,000	1,458,076
PFCARPAK	10,000,000	1,887
PFCEMARGOS	179,000,000	48,346
PFCORFICOL	211,000,000	9,271
PFDVVNDA	4,152,000,000	136,624
PFE	1,000,000,000,000	27,664,867
PFGRUPOARG	200,000,000	24,701
PFGRUPSURA	868,000,000	49,627
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	11,000,000	2,448
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	9,000,000	31,320
PROMIGAS	420,000,000	62,888
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	88,000,000	11,785
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8,000,000	1,805
VILLAS	13,000,000	3,328

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

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	92,905,086
AGROCHAL	-
AMZN	3,467,199
BAC	48,243,286
BBVACOL	48,693
BCOLOMBIA	268,167
BMC	2,266
BOGOTA	5,948
BVC	46,224
C	18,041,199
CARTON	3,566
CELSIA	221,395
CEMARGOS	446,775
CLH	22,834
CNEC	106,838
COLTEJER	1,707
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	314,473
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	63,215
CORFICOLCF	66,766
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	30,257,931
ELCONDOR	39,345
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	7,537,386
ESTRA	-
ETB	659,695
EXITO	10,820
FABRICATO	2,542,936
FAMILIA	3,781
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	72,509,410
GEB	1,855,573
GRUBOLIVAR	6,068
GRUPOARGOS	168,187
GRUPOAVAL	38,515
GRUPOSURA	260,913
HCOLSEL	400,828
ICOLCAP	599,528
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	338,532
JNJ	7,087,477
JPM	13,805,274
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	139,814
MOAT	378,911
NUTRESA	144,389
OCCIDENTE	2,918



**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
DESCAUCANO	-
PAZRIO	347,021
PFAVAL	5,397,071
PFAVH	216,772
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,458,076
PFCARPAK	1,887
PFCEMARGOS	48,346
PFCORFICOL	9,271
PFDVVNDA	136,624
PFE	27,664,867
PFGRUPOARG	24,701
PFGRUPSURA	49,627
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2,448
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	31,320
PROMIGAS	62,888
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