



## Boletín informativo

**No.105 / 09 de agosto 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 10 de agosto de 2021 hasta el 17 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.795.000.000	249.365
CELSIA	680.000.000	166.668
CEMARGOS	2.544.000.000	472.786
CORFICOLCF	1.846.000.000	64.765
ECOPETROL	67.606.000.000	26.543.483
GEB	2.950.000.000	1.150.414
GRUPOARGOS	1.442.000.000	145.804
GRUPOSURA	3.795.000.000	214.395
ISA	7.138.000.000	330.486
NUTRESA	2.974.000.000	143.684
PFAVAL	8.695.000.000	8.450.180
PFBCOLOM	40.341.000.000	1.464.797
PFDAVVNDA	3.295.000.000	115.943
PFGRUPSURA	548.000.000	33.418
ICOLCAP	5.076.000.000	407.159

Los volúmenes Medios Diarios aplicables el 10 de agosto de 2021 hasta el 17 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	78.833.191
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	3.433.876
BAC	1.000.000.000.000	45.317.366
BBVACOL	21.000.000	72.590
BCOLOMBIA	6.795.000.000	249.365
BMC	-	-
BOGOTA	943.000.000	13.599
BVC	428.000.000	41.993
C	1.000.000.000.000	19.649.791
CARTON	-	-



**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	680.000.000	166.668
CEMARGOS	2.544.000.000	472.786
CLH	38.000.000	10.249
CNEC	1.253.000.000	126.621
COLTEJER	1.000.000	1.135
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	66.000.000	181.043
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.846.000.000	64.765
CREDIFAMI	934.000.000	373.737
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	67.606.000.000	26.543.483
ELCONDOR	48.000.000	54.014
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	37.000.000	2.735.746
ESTRA	1.000.000	11.697
ETB	42.000.000	215.671
EXITO	179.000.000	14.287
FABRICATO	22.000.000	4.339.394
FAMILIA	-	-
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	45.446.914
GEB	2.950.000.000	1.150.414
GRUBOLIVAR	747.000.000	11.224
GRUPOARGOS	1.442.000.000	145.804
GRUPOAVAL	85.000.000	84.587
GRUPOSURA	3.795.000.000	214.395
HCOLSEL	2.942.000.000	253.548
ICOLCAP	5.076.000.000	407.159



**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 Efectivo	VMD acciones
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.138.000.000	330.486
JNJ	1.000.000.000.000	6.241.090
JPM	1.000.000.000.000	13.741.215
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	426.000.000	114.000
MOAT	-	365.696
NUTRESA	2.974.000.000	143.684
OCCIDENTE	7.000.000	212
ORBIS	-	-
PAZRIO	3.000.000	343.624
PFAVAL	8.695.000.000	8.450.180
PFAVH	84.000.000	327.954
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	40.341.000.000	1.464.797
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	141.000.000	37.194
PFCORFICOL	240.000.000	10.672
PFDAVVNDA	3.295.000.000	115.943
PFE	1.000.000.000.000	23.886.201
PFGRUPOARG	171.000.000	21.709
PFGRUPSURA	548.000.000	33.418
PFVILLA051	1.000.000	215
PFVILLA053	3.000.000	1.794
PFVILLAS	5.000.000	1.406
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	1.000.000	166
POPULAR	3.000.000	9.492
PROMIGAS	389.000.000	58.384
PROTECCION	-	-
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	80.000.000	11.563
TGLSC	-	-
TITAN	57.000.000	3.362
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	8.000.000	1.435
VILLAS	25.000.000	5.898

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 10 de agosto de 2021 hasta el 17 de agosto de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	78.833.191
AGROCHAL	-
AMZN	3.433.876
BAC	45.317.366
BBVACOL	72.590
BCOLOMBIA	249.365
BMC	-
BOGOTA	13.599
BVC	41.993
C	19.649.791
CARTON	-
CELSIA	166.668
CEMARGOS	472.786
CLH	10.249
CNEC	126.621
COLTEJER	1.135
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	181.043
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	64.765
CREDIFAMI	373.737



**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	26.543.483
ELCONDOR	54.014
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	2.735.746
ESTRA	11.697
ETB	215.671
EXITO	14.287
FABRICATO	4.339.394
FAMILIA	-
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	45.446.914
GEB	1.150.414
GRUBOLIVAR	11.224
GRUPOARGOS	145.804
GRUPOAVAL	84.587
GRUPOSURA	214.395
HCOLSEL	253.548
ICOLCAP	407.159
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	330.486
JNJ	6.241.090
JPM	13.741.215
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	114.000
MOAT	365.696
NUTRESA	143.684
OCCIDENTE	212



**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	343.624
PFAVAL	8.450.180
PFAVH	327.954
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.464.797
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	37.194
PFCORFICOL	10.672
PFDAVVNDA	115.943
PFE	23.886.201
PFGRUPOARG	21.709
PFGRUPSURA	33.418
PFVILLA051	215
PFVILLA053	1.794
PFVILLAS	1.406
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	166
POPULAR	9.492
PROMIGAS	58.384
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	11.563
TGLSC	-
TITAN	3.362
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.435
VILLAS	5.898

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías