



## Boletín informativo

### No.118 / 06 de septiembre 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 07 de septiembre de 2021 hasta el 13 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5,290,000,000	185,718
CELSIA	540,000,000	128,763
CEMARGOS	2,610,000,000	481,024
CORFICOLCF	2,240,000,000	74,931
ECOPETROL	68,060,000,000	26,455,801
GEB	2,190,000,000	859,837
GRUPOARGOS	1,320,000,000	125,519
GRUPOSURA	4,340,000,000	226,417
ISA	6,840,000,000	301,191
NUTRESA	1,980,000,000	90,359
PFAVAL	10,480,000,000	9,988,343
PFBCOLOM	42,930,000,000	1,487,062
PFDAVVNDA	2,610,000,000	87,596
PFGRUPSURA	530,000,000	30,913
ICOLCAP	5,790,000,000	445,467

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de septiembre de 2021 hasta el 13 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	75,475,909
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,302,770
BAC	1,000,000,000,000	47,165,959
BBVACOL	-	9,188
BCOLOMBIA	5,290,000,000	185,718
BMC	-	80
BOGOTA	510,000,000	7,261
BSANTANDCO	29,680,000,000	155,803,018
BVC	380,000,000	35,813
C	1,000,000,000,000	19,334,232



**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
CAPCO	20,530,000,000	341,336
CARTON	-	-
CELSIA	540,000,000	128,763
CEMARGOS	2,610,000,000	481,024
CENCOSUDCO	27,780,000,000	3,858,394
FALABELLCO	20,000,000	1,320
CHILECO	28,620,000,000	79,423,881
CLH	30,000,000	7,341
CNEC	780,000,000	79,638
COLTEJER	-	136
CONCRET	70,000,000	187,691
COPECO	18,030,000,000	519,280
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,240,000,000	74,931
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
ECOPETROL	68,060,000,000	26,455,801
ELCONDOR	40,000,000	37,549
ENELAMCO	15,910,000,000	43,990,787
ENKA	50,000,000	2,985,041
ESTRA	-	46
ETB	30,000,000	155,620
EXITO	130,000,000	10,994
FABRICATO	10,000,000	2,572,536
FALABELLCO	20,000,000	1,320
FAMILIA	-	-
FB	1,000,000,000,000	13,838,331
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,809,983
GEB	2,190,000,000	859,837
GRUBOLIVAR	170,000,000	2,390
GRUPOARGOS	1,320,000,000	125,519
GRUPOAVAL	70,000,000	72,543
GRUPOSURA	4,340,000,000	226,417
HCOLSEL	1,530,000,000	127,878
ICOLCAP	5,790,000,000	445,467



**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
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	6,840,000,000	301,191
JNJ	1,000,000,000,000	5,987,187
JPM	1,000,000,000,000	12,805,822
MINEROS	340,000,000	88,749
MOAT	93,260,000,000	375,569
NUTRESA	1,980,000,000	90,359
OCCIDENTE	10,000,000	213
PARAUCOCO	9,910,000,000	1,985,106
PAZRIO	-	4,072
PFAVAL	10,480,000,000	9,988,343
PFAVH	80,000,000	408,554
PFBBVACOL	-	12
PFBCOLOM	42,930,000,000	1,487,062
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	120,000,000	31,305
PFCORFICOL	180,000,000	8,017
PFDAVVNDA	2,610,000,000	87,596
PFE	1,000,000,000,000	29,913,353
PFGRUPOARG	220,000,000	25,449
PFGRUPSURA	530,000,000	30,913
PFVILLA051	-	1
PFVILLA053	-	7
PFVILLAS	-	67
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	160,000,000	24,059
PROTECCION	-	8
SANFELIPE	-	-
SQMBCO	20,000,000	104
TERPEL	100,000,000	13,737
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	175



**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
VILLAS	10,000,000	2,282

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de septiembre de 2021 hasta el 13 de septiembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	75,475,909
AGROCHAL	-
AMZN	3,302,770
BAC	47,165,959
BBVACOL	9,188
BCOLOMBIA	185,718
BMC	80
BOGOTA	7,261
BSANTANDCO	155,803,018
BVC	35,813
C	19,334,232
CAPCO	341,336
CARTON	-
CELSIA	128,763
CEMARGOS	481,024
CENCOSUDCO	3,858,394
FALABELLCO	1,320
CHILECO	79,423,881
CLH	7,341
CNEC	79,638
COLTEJER	136
CONCRET	187,691
COPECO	519,280
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	74,931
CREDIFAMI	26,070
ECOPETROL	26,455,801
ELCONDOR	37,549
ENELAMCO	43,990,787





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ENKA	2,985,041
ESTRA	46
ETB	155,620
EXITO	10,994
FABRICATO	2,572,536
FALABELLCO	1,320
FAMILIA	-
FB	13,838,331
GASNATURAL	-
GE	7,809,983
GEB	859,837
GRUBOLIVAR	2,390
GRUPOARGOS	125,519
GRUPOAVAL	72,543
GRUPOSURA	226,417
HCOLSEL	127,878
ICOLCAP	445,467
INESA	-
INVENSA	-
ISA	301,191
JNJ	5,987,187
JPM	12,805,822
MINEROS	88,749
MOAT	375,569
NUTRESA	90,359
OCCIDENTE	213
PARAUCOCO	1,985,106
PAZRIO	4,072
PFAVAL	9,988,343
PFAVH	408,554
PFBBVACOL	12
PFBCOLOM	1,487,062
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	31,305
PFCORFICOL	8,017



**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
PFDVVNDA	87,596
PFE	29,913,353
PFGRUPOARG	25,449
PFGRUPSURA	30,913
PFVILLA051	1
PFVILLA053	7
PFVILLAS	67
PFVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	24,059
PROTECCION	8
SANFELIPE	-
SQMBCO	104
TERPEL	13,737
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	175
VILLAS	2,282

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías

