



## Boletín informativo

**No.139 / 19 de octubre 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 20 de octubre de 2021 hasta el 25 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMDEfectivo	VMDacciones
BCOLOMBIA	5,390,000,000	178,473
CEMARGOS	2,590,000,000	476,506
CORFICOLCF	2,860,000,000	95,868
ECOPETROL	67,430,000,000	26,115,999
GEB	2,470,000,000	906,686
GRUPOARGO	2,200,000,000	195,638
GRUPOSURA	4,550,000,000	229,930
ISA	7,160,000,000	315,170
NUTRESA	2,430,000,000	112,119
PFAVAL	10,480,000,000	9,742,369
PFBCOLOM	46,350,000,000	1,556,564
PFDAVVNDA	3,480,000,000	112,345
PFGRUPSURA	770,000,000	43,156
ICOLCAP	5,850,000,000	435,870

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de octubre de 2021 hasta el 25 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	75,798,917
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,040,366
BAC	1,000,000,000,000	46,283,715
BBVACOL	10,000,000	29,312
BCOLOMBIA	5,390,000,000	178,473
BMC	-	80
BOGOTA	500,000,000	6,996
BVC	310,000,000	31,286





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
C	1,000,000,000,000	17,957,183
CARTON	-	-
CELSIA	630,000,000	150,417
CEMARGOS	2,590,000,000	476,506
CENCOSUDCO	21,510,000,000	3,098,145
CFMITNIPCO	2,950,000,000	220,362
CHILECO	28,020,000,000	79,221,486
CLH	50,000,000	13,430
CNEC	1,180,000,000	114,326
COLTEJER	-	194
CONCONCRET	120,000,000	327,663
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,860,000,000	95,868
CREDIFAMI	70,000,000	26,070
CSPX	71,990,000,000	41,740
ECOPETROL	67,430,000,000	26,115,999
EIMI	64,600,000,000	461,183
ELCONDOR	30,000,000	30,603
ENELAMCO	17,950,000,000	36,553,062
ENKA	60,000,000	4,202,371
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	225,979
EXITO	150,000,000	12,876
FABRICATO	20,000,000	2,911,508
FALABELLCO	52,930,000,000	3,622,213
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	8,010,964
GEB	2,470,000,000	906,686
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,330
GRUPOARGOS	2,200,000,000	195,638



**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
GRUPOAVAL	40,000,000	39,431
GRUPOSURA	4,550,000,000	229,930
HCOLSEL	1,750,000,000	138,672
ICOLCAP	5,850,000,000	435,870
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,160,000,000	315,170
ISAC	14,720,000,000	58,414
IUFS	9,660,000,000	240,396
IUIT	8,640,000,000	115,998
JNJ	1,000,000,000,000	5,771,167
JPEA	11,110,000,000	484,135
JPM	1,000,000,000,000	10,811,851
JPM	1,000,000,000,000	10,811,851
MINEROS	310,000,000	82,104
NUTRESA	2,430,000,000	112,119
OCCIDENTE	10,000,000	382
PAZRIO	-	217
PFAVAL	10,480,000,000	9,742,369
PFAVH	60,000,000	408,365
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	46,350,000,000	1,556,564
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	170,000,000	42,983
PFCORFICOL	180,000,000	7,787
PFDVVNDA	3,480,000,000	112,345
PFE	1,000,000,000,000	28,652,177
PFGRUPOARG	260,000,000	31,582
PFGRUPSURA	770,000,000	43,156
PFVILLA051	-	1
PFVILLA053	-	7
PFVILLAS	-	67



**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
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	-
PROMIGAS	200,000,000	27,911
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	2,890,000,000	129,368
SQMBCO	30,000,000	169
SUAS	15,440,000,000	358,221
TERPEL	150,000,000	19,503
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	201
VILLAS	10,000,000	2,294

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de octubre de 2021 hasta el 25 de octubre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	75,798,917
AGROCHAL	-
AMZN	3,040,366
BAC	46,283,715
BBVACOL	29,312
BCOLOMBIA	178,473
BMC	80
BOGOTA	6,996
BVC	31,286
C	17,957,183
CARTON	-
CELSIA	150,417
CEMARGOS	476,506
CENCOSUDCO	3,098,145





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CFMITNIPCO	220,362
CHILECO	79,221,486
CLH	13,430
CNEC	114,326
COLTEJER	194
CONCONCRET	327,663
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	95,868
CREDIFAMI	26,070
CSPX	41,740
ECOPETROL	26,115,999
EIMI	461,183
ELCONDOR	30,603
ENELAMCO	36,553,062
ENKA	4,202,371
ESTRA	-
ETB	225,979
EXITO	12,876
FABRICATO	2,911,508
FALABELLCO	3,622,213
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	8,010,964
GEB	906,686
GRUBOLIVAR	2,330
GRUPOARGOS	195,638
GRUPOAVAL	39,431
GRUPOSURA	229,930
HCOLSEL	138,672
ICOLCAP	435,870
INESA	-



**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
INVENSA	-
ISA	315,170
ISAC	58,414
IUFS	240,396
IUIT	115,998
JNJ	5,771,167
JPEA	484,135
JPM	10,811,851
JPM	10,811,851
MINEROS	82,104
NUTRESA	112,119
OCCIDENTE	382
PAZRIO	217
PFAVAL	9,742,369
PFAVH	408,365
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,556,564
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	42,983
PFCORFICOL	7,787
PFDAVVNDA	112,345
PFE	28,652,177
PFGRUPOARG	31,582
PFGRUPSURA	43,156
PFVILLA051	1
PFVILLA053	7
PFVILLAS	67
PFVILLASCA	3
POPULAR	-
PROMIGAS	27,911
PROTECCION	9



**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
SANFELIPE	-
SDHA	129,368
SQMBCO	169
SUAS	358,221
TERPEL	19,503
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	201
VILLAS	2,294

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías