



## Boletín informativo

**No.142 / 25 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 26 de octubre de 2021 hasta el 02 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMDEfectivo	VM Dacciones
BCOLOMBIA	4,830,000,000	157,570
CEMARGOS	2,630,000,000	481,374
CORFICOLCF	2,850,000,000	95,676
ECOPETROL	66,990,000,000	25,222,075
GEB	2,450,000,000	892,155
GRUPOARGO	2,260,000,000	197,754
GRUPOSURA	4,560,000,000	229,578
ISA	7,040,000,000	309,988
NUTRESA	2,580,000,000	119,158
PFAVAL	10,480,000,000	9,713,627
PFBCOLOM	46,750,000,000	1,559,190
PFDAVVNDA	3,400,000,000	107,686
PFGRUPSURA	770,000,000	43,594
ICOLCAP	6,120,000,000	453,834

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de octubre de 2021 hasta el 02 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	74,050,240
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	2,979,955
BAC	1,000,000,000,000	45,255,935
BBVACOL	10,000,000	29,713
BCOLOMBIA	4,830,000,000	157,570
BMC	-	71
BOGOTA	510,000,000	7,040
BVC	310,000,000	31,263



**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
C	1,000,000,000,000	17,490,665
CARTON	-	-
CELSIA	630,000,000	148,890
CEMARGOS	2,630,000,000	481,374
CENCOSUDCO	22,950,000,000	3,423,799
CFMITNIPCO	3,570,000,000	276,575
CHILECO	28,720,000,000	82,015,479
CLH	60,000,000	17,240
CNEC	1,160,000,000	112,244
COLTEJER	-	194
CONCONCRET	130,000,000	369,863
CORFERIAS	-	7
CORFICOLCF	2,850,000,000	95,676
CREDIFAMI	-	66
CSPX	72,900,000,000	42,177
ECOPETROL	66,990,000,000	25,222,075
EIMI	64,190,000,000	457,895
ELCONDOR	30,000,000	31,904
ENELAMCO	19,720,000,000	40,770,578
ENKA	50,000,000	2,915,105
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	234,979
EXITO	150,000,000	12,656
FABRICATO	20,000,000	2,915,260
FALABELLCO	53,390,000,000	3,661,757
FAMILIA	-	131
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,978,173
GEB	2,450,000,000	892,155
GRUBOLIVAR	160,000,000	2,361
GRUPOARGOS	2,260,000,000	197,754



**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	50,000,000	41,513
GRUPOSURA	4,560,000,000	229,578
HCOLSEL	1,860,000,000	146,876
ICOLCAP	6,120,000,000	453,834
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,040,000,000	309,988
ISAC	15,000,000,000	59,360
IUFS	10,160,000,000	250,703
IUIT	8,950,000,000	119,851
JNJ	1,000,000,000,000	5,739,768
JPEA	10,840,000,000	477,798
JPM	1,000,000,000,000	10,421,648
JPM	1,000,000,000,000	10,421,648
MINEROS	310,000,000	83,677
NUTRESA	2,580,000,000	119,158
OCCIDENTE	10,000,000	326
PAZRIO	-	434
PFAVAL	10,480,000,000	9,713,627
PFAVH	60,000,000	408,558
PFBBVACOL	-	44
PFBCOLOM	46,750,000,000	1,559,190
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	170,000,000	42,110
PFCORFICOL	160,000,000	7,059
PFDVVNDA	3,400,000,000	107,686
PFE	1,000,000,000,000	28,212,238
PFGRUPOARG	270,000,000	32,073
PFGRUPSURA	770,000,000	43,594
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

PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	51
PROMIGAS	210,000,000	29,166
PROTECCION	-	9
SANFELIPE	-	-
SDHA	2,910,000,000	130,284
SQMBCO	30,000,000	169
SUAS	15,550,000,000	360,121
TERPEL	150,000,000	19,527
TGLSC	-	-
TITAN	-	68
VALSIMESA	-	201
VILLAS	10,000,000	2,527

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de octubre de 2021 hasta el 02 de noviembre de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	74,050,240
AGROCHAL	-
AMZN	2,979,955
BAC	45,255,935
BBVACOL	29,713
BCOLOMBIA	157,570
BMC	71
BOGOTA	7,040
BVC	31,263
C	17,490,665
CARTON	-
CELSIA	148,890
CEMARGOS	481,374
CENCOSUDCO	3,423,799
CFMITNIPCO	276,575





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CHILECO	82,015,479
CLH	17,240
CNEC	112,244
COLTEJER	194
CONCRET	369,863
CORFERIAS	7
CORFICOLCF	95,676
CREDIFAMI	66
CSPX	42,177
ECOPETROL	25,222,075
EIMI	457,895
ELCONDOR	31,904
ENELAMCO	40,770,578
ENKA	2,915,105
ESTRA	-
ETB	234,979
EXITO	12,656
FABRICATO	2,915,260
FALABELLCO	3,661,757
FAMILIA	131
GASNATURAL	-
GE	7,978,173
GEB	892,155
GRUBOLIVAR	2,361
GRUPOARGOS	197,754
GRUPOAVAL	41,513
GRUPOSURA	229,578
HCOLSEL	146,876
ICOLCAP	453,834
INESA	-
INVENSA	-
ISA	309,988



**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
ISAC	59,360
IUFS	250,703
IUIT	119,851
JNJ	5,739,768
JPEA	477,798
JPM	10,421,648
JPM	10,421,648
MINEROS	83,677
NUTRESA	119,158
OCCIDENTE	326
PAZRIO	434
PFAVAL	9,713,627
PFAVH	408,558
PFBBVACOL	44
PFBCOLOM	1,559,190
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	42,110
PFCORFICOL	7,059
PFDAVVNDA	107,686
PFE	28,212,238
PFGRUPOARG	32,073
PFGRUPSURA	43,594
PVILLA051	1
PVILLA053	7
PVILLAS	67
PVILLASCA	3
POPULAR	51
PROMIGAS	29,166
PROTECCION	9
SANFELIPE	-
SDHA	130,284







## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
SQMBCO	169
SUAS	360,121
TERPEL	19,527
TGLSC	-
TITAN	68
VALSIMESA	201
VILLAS	2,527

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías