



## Boletín informativo

**No.009 / 24 de enero de 2022**

**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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de enero de 2022 hasta el 31 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,850,000,000	205,834
CEMARGOS	2,690,000,000	469,089
CORFICOLCF	2,380,000,000	81,352
ECOPETROL	59,870,000,000	21,578,779
GEB	2,900,000,000	1,083,597
GRUPOARGOS	2,910,000,000	234,040





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6,340,000,000	281,320
ISA	7,750,000,000	342,151
NUTRESA	3,700,000,000	147,742
PFAVAL	7,250,000,000	6,665,072
PFBCOLOM	48,940,000,000	1,580,404
PFDAVVNDA	2,730,000,000	84,046
PFGRUPSURA	1,550,000,000	72,260
ICOLCAP	6,560,000,000	466,019

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de enero de 2022 hasta el 31 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	81,520,081
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,075,274
BAC	1,000,000,000,000	44,730,849
BBVACOL	10,000,000	19,473
BCOLOMBIA	6,850,000,000	205,834
BMC	-	101
BOGOTA	560,000,000	7,762
BVC	220,000,000	22,287
C	1,000,000,000,000	19,821,786



**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
CARTON	-	-
CELSIA	790,000,000	182,640
CEMARGOS	2,690,000,000	469,089
CENCOSUDCO	33,460,000,000	5,265,351
CFMITNIPCO	4,360,000,000	337,028
CHILECO	39,400,000,000	105,634,806
CLH	90,000,000	24,399
CNEC	1,220,000,000	118,259
COLTEJER	-	58
CONCRET	160,000,000	442,869
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,380,000,000	81,352
CREDIFAMI	-	16
CSPX	82,830,000,000	45,921
ECOPETROL	59,870,000,000	21,578,779
EIMI	44,230,000,000	313,730
ELCONDOR	30,000,000	34,730
ENELAMCO	29,110,000,000	60,502,921
ENKA	30,000,000	1,413,168
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	253,739
EXITO	160,000,000	13,835
FABRICATO	20,000,000	3,502,229
FALABELLCO	59,050,000,000	4,076,822
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,353,384
GEB	2,900,000,000	1,083,597
GRUBOLIVAR	440,000,000	6,157
GRUPOARGOS	2,910,000,000	234,040
GRUPOAVAL	60,000,000	53,220



**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
GRUPOSURA	6,340,000,000	281,320
HCOLSEL	1,990,000,000	156,197
ICOLCAP	6,560,000,000	466,019
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,750,000,000	342,151
ISAC	19,000,000,000	70,869
IUFS	10,480,000,000	250,786
IUIT	9,800,000,000	125,010
JNJ	1,000,000,000,000	6,443,124
JPEA	9,350,000,000	402,550
JPM	1,000,000,000,000	11,145,351
JPM	1,000,000,000,000	11,145,351
MINEROS	430,000,000	115,113
NUTRESA	3,700,000,000	147,742
OCCIDENTE	-	114
PAZRIO	-	553,212
PFAVAL	7,250,000,000	6,665,072
PFAVH	10,000,000	173,502
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	48,940,000,000	1,580,404
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	53,629
PFCORFICOL	170,000,000	7,061
PFDAVVNDA	2,730,000,000	84,046
PFE	1,000,000,000,000	32,343,523
PFGRUPOARG	510,000,000	50,529
PFGRUPSURA	1,550,000,000	72,260
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	155
PVVILLASCA	-	0



**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
POPULAR	-	1,755
PROMIGAS	230,000,000	31,705
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	2,970,000,000	131,145
SQMBCO	40,000,000	205
SUAS	18,950,000,000	406,990
TERPEL	180,000,000	20,869
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	20,000,000	3,765

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de enero de 2022 hasta el 31 de enero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,520,081
AGROCHAL	-
AMZN	3,075,274
BAC	44,730,849
BBVACOL	19,473
BCOLOMBIA	205,834
BMC	101
BOGOTA	7,762
BVC	22,287
C	19,821,786
CARTON	-
CELSIA	182,640
CEMARGOS	469,089
CENCOSUDCO	5,265,351
CFMITNIPCO	337,028



**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
CHILECO	105,634,806
CLH	24,399
CNEC	118,259
COLTEJER	58
CONCRET	442,869
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	81,352
CREDIFAMI	16
CSPX	45,921
ECOPETROL	21,578,779
EIMI	313,730
ELCONDOR	34,730
ENELAMCO	60,502,921
ENKA	1,413,168
ESTRA	-
ETB	253,739
EXITO	13,835
FABRICATO	3,502,229
FALABELLCO	4,076,822
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,353,384
GEB	1,083,597
GRUBOLIVAR	6,157
GRUPOARGOS	234,040
GRUPOAVAL	53,220
GRUPOSURA	281,320
HCOLSEL	156,197
ICOLCAP	466,019
INESA	-
INVENSA	-
ISA	342,151



**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	70,869
IUFS	250,786
IUIT	125,010
JNJ	6,443,124
JPEA	402,550
JPM	11,145,351
JPM	11,145,351
MINEROS	115,113
NUTRESA	147,742
OCCIDENTE	114
PAZRIO	553,212
PFAVAL	6,665,072
PFAVH	173,502
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,580,404
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	53,629
PFCORFICOL	7,061
PFDAVVNDA	84,046
PFE	32,343,523
PFGRUPOARG	50,529
PFGRUPSURA	72,260
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	155
PVILLASCA	0
POPULAR	1,755
PROMIGAS	31,705
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	131,145



**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
SQMBCO	205
SUAS	406,990
TERPEL	20,869
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	-
VILLAS	3,765

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías