



## Boletín informativo

### No.018 / 07 de febrero 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 08 de febrero de 2022 hasta el 15 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,530,000,000	189,300
CEMARGOS	2,740,000,000	472,520
CORFICOLCF	2,090,000,000	71,349
ECOPETROL	61,750,000,000	22,247,051
GEB	2,980,000,000	1,111,221
GRUPOARGOS	3,190,000,000	252,256





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6,980,000,000	296,592
ISA	7,830,000,000	345,017
NUTRESA	3,700,000,000	147,440
PFAVAL	7,350,000,000	6,780,291
PFBCOLOM	48,690,000,000	1,568,997
PFDVVNDA	2,680,000,000	82,813
PFGRUPSURA	1,840,000,000	82,651
ICOLCAP	7,040,000,000	495,182

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de febrero de 2022 hasta el 15 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	83,086,656
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,186,048
BAC	1,000,000,000,000	46,150,090
BBVACOL	10,000,000	25,415
BCOLOMBIA	6,530,000,000	189,300
BMC	-	82
BOGOTA	610,000,000	8,297
BVC	220,000,000	21,626
C	1,000,000,000,000	19,906,650



**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	810,000,000	187,117
CEMARGOS	2,740,000,000	472,520
CENCOSUDCO	33,920,000,000	5,327,670
CFMITNIPCO	4,270,000,000	330,588
CHILECO	40,720,000,000	108,950,323
CLH	80,000,000	23,892
CNEC	1,370,000,000	133,474
COLTEJER	-	51
CONCRET	170,000,000	481,147
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2,090,000,000	71,349
CREDIFAMI	-	8
CSPX	87,690,000,000	48,709
ECOPETROL	61,750,000,000	22,247,051
EIMI	47,180,000,000	335,504
ELCONDOR	30,000,000	35,292
ENELAMCO	29,730,000,000	62,206,952
ENKA	30,000,000	1,286,002
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	265,316
EXITO	160,000,000	13,784
FABRICATO	30,000,000	3,891,989
FALABELLCO	52,990,000,000	4,062,230
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,625,706
GEB	2,980,000,000	1,111,221
GRUBOLIVAR	450,000,000	6,239
GRUPOARGOS	3,190,000,000	252,256
GRUPOAVAL	60,000,000	56,781



**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	6,980,000,000	296,592
HCOLSEL	2,210,000,000	170,891
ICOLCAP	7,040,000,000	495,182
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7,830,000,000	345,017
ISAC	20,660,000,000	76,519
IUFS	10,860,000,000	258,030
IUIT	10,350,000,000	131,412
JNJ	1,000,000,000,000	6,654,084
JPEA	9,080,000,000	390,060
JPM	1,000,000,000,000	11,472,423
JPM	1,000,000,000,000	11,472,423
MINEROS	440,000,000	117,209
NUTRESA	3,700,000,000	147,440
OCCIDENTE	10,000,000	421
PAZRIO	-	583,646
PFAVAL	7,350,000,000	6,780,291
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	48,690,000,000	1,568,997
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	52,611
PFCORFICOL	170,000,000	7,326
PFDAVVNDA	2,680,000,000	82,813
PFE	1,000,000,000,000	32,418,118
PFGRUPOARG	540,000,000	53,008
PFGRUPSURA	1,840,000,000	82,651
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	155
PFVILLASCA	-	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	-	2,648
PROMIGAS	260,000,000	35,929
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,160,000,000	139,382
SQMBCO	50,000,000	201
SUAS	19,160,000,000	405,381
TERPEL	190,000,000	21,743
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	142
VILLAS	20,000,000	4,114

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de febrero de 2022 hasta el 15 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83,086,656
AGROCHAL	-
AMZN	3,186,048
BAC	46,150,090
BBVACOL	25,415
BCOLOMBIA	189,300
BMC	82
BOGOTA	8,297
BVC	21,626
C	19,906,650
CARTON	-
CELSIA	187,117
CEMARGOS	472,520
CENCOSUDCO	5,327,670
CFMITNIPCO	330,588



**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	108,950,323
CLH	23,892
CNEC	133,474
COLTEJER	51
CONCRET	481,147
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	71,349
CREDIFAMI	8
CSPX	48,709
ECOPETROL	22,247,051
EIMI	335,504
ELCONDOR	35,292
ENELAMCO	62,206,952
ENKA	1,286,002
ESTRA	-
ETB	265,316
EXITO	13,784
FABRICATO	3,891,989
FALABELLCO	4,062,230
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,625,706
GEB	1,111,221
GRUBOLIVAR	6,239
GRUPOARGOS	252,256
GRUPOAVAL	56,781
GRUPOSURA	296,592
HCOLSEL	170,891
ICOLCAP	495,182
INESA	-
INVENSA	-
ISA	345,017



**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
ISAC	76,519
IUFS	258,030
IUIT	131,412
JNJ	6,654,084
JPEA	390,060
JPM	11,472,423
JPM	11,472,423
MINEROS	117,209
NUTRESA	147,440
OCCIDENTE	421
PAZRIO	583,646
PFAVAL	6,780,291
PFAVH	-
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1,568,997
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	52,611
PFCORFICOL	7,326
PFDAVVNDA	82,813
PFE	32,418,118
PFGRUPOARG	53,008
PFGRUPSURA	82,651
PVILLA051	-
PVILLA053	-
PVILLAS	155
PVILLASCA	0
POPULAR	2,648
PROMIGAS	35,929
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	139,382







## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
SQMBCO	201
SUAS	405,381
TERPEL	21,743
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	142
VILLAS	4,114

Jose Manuel Suarez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías