



No.021 / febrero 14 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.

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%



Boletín informativo

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 15 de febrero de 2022 hasta el 22 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,710,000,000	193,380
CEMARGOS	2,730,000,000	468,448
CORFICOLCF	1,990,000,000	68,062
ECOPETROL	63,650,000,000	22,889,536
GEB	2,990,000,000	1,115,582
GRUPOARGOS	3,340,000,000	263,339
GRUPOSURA	6,990,000,000	292,867
ISA	7,730,000,000	343,833
NUTRESA	3,660,000,000	147,448
PFAVAL	7,320,000,000	6,778,493
PFBCOLOM	48,520,000,000	1,560,734
PFDAVVNDA	2,650,000,000	82,188
PFGRUPSURA	1,850,000,000	82,690
ICOLCAP	7,120,000,000	516,520

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de febrero de 2022 hasta el 22 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	84,089,336



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,224,131
BAC	1,000,000,000,000	46,241,847
BBVACOL	10,000,000	29,497
BCOLOMBIA	6,710,000,000	193,380
BMC	-	82
BOGOTA	640,000,000	8,675
BVC	210,000,000	20,665
C	1,000,000,000,000	19,959,682
CARTON	-	-
CELSIA	820,000,000	190,312
CEMARGOS	2,730,000,000	468,448
CENCOSUDCO	34,250,000,000	5,320,578
CFMITNIPCO	4,400,000,000	338,410
CHILECO	40,690,000,000	108,686,495
CLH	90,000,000	24,804
CNEC	1,360,000,000	132,763
COLTEJER	-	51
CONCONCRET	170,000,000	489,501
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,990,000,000	68,062
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	86,500,000,000	50,463
ECOPETROL	63,650,000,000	22,889,536
EIMI	47,450,000,000	337,325
ELCONDOR	30,000,000	34,982
ENELAMCO	30,040,000,000	63,064,902
ENKA	30,000,000	1,431,645
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	271,660
EXITO	150,000,000	13,052
FABRICATO	30,000,000	3,934,394
FALABELLCO	52,890,000,000	4,075,662
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,351,458
GEB	2,990,000,000	1,115,582
GRUBOLIVAR	460,000,000	6,247
GRUPOARGOS	3,340,000,000	263,339
GRUPOAVAL	70,000,000	60,563
GRUPOSURA	6,990,000,000	292,867
HCOLSEL	2,350,000,000	179,253
ICOLCAP	7,120,000,000	516,520
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	7,730,000,000	343,833
ISAC	19,380,000,000	70,654
IUFS	11,170,000,000	264,078
IUIT	10,310,000,000	131,671
JNJ	1,000,000,000,000	6,793,227
JPEA	8,830,000,000	380,064
JPM	1,000,000,000,000	11,645,610
JPM	1,000,000,000,000	11,645,610
MINEROS	460,000,000	123,086
NUTRESA	3,660,000,000	147,448
OCCIDENTE	10,000,000	415
PAZRIO	-	584,201
PFAVAL	7,320,000,000	6,778,493
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	210
PFBCOLOM	48,520,000,000	1,560,734
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	51,751
PFCORFICOL	170,000,000	7,392
PFDAVVNDA	2,650,000,000	82,188
PFE	1,000,000,000,000	32,201,064



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	540,000,000	52,545
PFGRUPSURA	1,850,000,000	82,690
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	115
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	-	3,042
PROMIGAS	270,000,000	36,020
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,180,000,000	140,384
SQMBCO	40,000,000	177
SUAS	19,350,000,000	406,984
TERPEL	180,000,000	20,978
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	185
VILLAS	20,000,000	3,993

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de febrero de 2022 hasta el 22 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84,089,336



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,224,131
BAC	46,241,847
BBVACOL	29,497
BCOLOMBIA	193,380
BMC	82
BOGOTA	8,675
BVC	20,665
C	19,959,682
CARTON	-
CELSIA	190,312
CEMARGOS	468,448
CENCOSUDCO	5,320,578
CFMITNIPCO	338,410
CHILECO	108,686,495
CLH	24,804
CNEC	132,763
COLTEJER	51
CONCRET	489,501
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	68,062
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	50,463
ECOPETROL	22,889,536
EIMI	337,325
ELCONDOR	34,982
ENELAMCO	63,064,902
ENKA	1,431,645
ESTRA	-
ETB	271,660
EXITO	13,052
FABRICATO	3,934,394
FALABELLCO	4,075,662
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,351,458
GEB	1,115,582
GRUBOLIVAR	6,247
GRUPOARGOS	263,339
GRUPOAVAL	60,563
GRUPOSURA	292,867
HCOLSEL	179,253
ICOLCAP	516,520
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	343,833
ISAC	70,654
IUFS	264,078
IUIT	131,671
JNJ	6,793,227
JPEA	380,064
JPM	11,645,610
JPM	11,645,610
MINEROS	123,086
NUTRESA	147,448
OCCIDENTE	415
PAZRIO	584,201
PFAVAL	6,778,493
PFAVH	-
PFBVACOL	210
PFBCOLOM	1,560,734
PFCARPAK	-
PFCMARGOS	51,751
PFCORFICOL	7,392
PFDVVNDA	82,188
PFE	32,201,064



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	52,545
PFGRUPSURA	82,690
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	115
PFVILLASCA	-
POPULAR	3,042
PROMIGAS	36,020
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	140,384
SQMBCO	177
SUAS	406,984
TERPEL	20,978
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	185
VILLAS	3,993

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías