



Boletín informativo

No.026 / febrero 28 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 01 de marzo de 2022 hasta el 07 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,050,000,000	199,259
CEMARGOS	2,730,000,000	451,212
CORFICOLCF	1,890,000,000	64,740
ECOPETROL	67,990,000,000	24,375,820
GEB	2,940,000,000	1,101,737
GRUPOARGOS	3,380,000,000	265,853
GRUPOSURA	7,160,000,000	295,059
ISA	7,930,000,000	352,373
NUTRESA	4,620,000,000	173,101
PFAVAL	6,650,000,000	6,159,646
PFBCOLOM	49,180,000,000	1,577,592
PFDAVVNDA	2,760,000,000	85,531
PFGRUPSURA	1,940,000,000	86,382
ICOLCAP	7,390,000,000	533,206

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de marzo de 2022 hasta el 07 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	84,812,224



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,241,433
BAC	1,000,000,000,000	46,223,958
BBVACOL	10,000,000	28,771
BCOLOMBIA	7,050,000,000	199,259
BMC	-	58
BOGOTA	640,000,000	8,702
BVC	200,000,000	20,115
C	1,000,000,000,000	20,253,917
CARTON	-	-
CELSIA	810,000,000	188,385
CEMARGOS	2,730,000,000	451,212
CENCOSUDCO	32,690,000,000	4,946,764
CFMITNIPCO	3,850,000,000	296,285
CHILECO	40,480,000,000	107,959,182
CLH	80,000,000	24,581
CNEC	1,380,000,000	134,439
COLTEJER	-	37
CONCRET	170,000,000	515,405
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,890,000,000	64,740
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	90,240,000,000	53,608
ECOPETROL	67,990,000,000	24,375,820
EIMI	47,520,000,000	339,783
ELCONDOR	30,000,000	34,431
ENELAMCO	30,330,000,000	64,196,416
ENKA	30,000,000	1,440,384
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	250,714
EXITO	180,000,000	15,070
FABRICATO	30,000,000	4,183,800
FALABELLCO	44,750,000,000	3,505,268
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,296,099
GEB	2,940,000,000	1,101,737
GRUBOLIVAR	420,000,000	5,359
GRUPOARGOS	3,380,000,000	265,853
GRUPOAVAL	60,000,000	56,764
GRUPOSURA	7,160,000,000	295,059
HCOLSEL	1,700,000,000	119,015
ICOLCAP	7,390,000,000	533,206
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	7,930,000,000	352,373
ISAC	19,600,000,000	71,105
IUFS	11,250,000,000	265,243
IUIT	10,500,000,000	136,595
JNJ	1,000,000,000,000	6,906,519
JPEA	9,110,000,000	395,425
JPM	1,000,000,000,000	11,949,141
JPM	1,000,000,000,000	11,949,141
MINEROS	510,000,000	130,212
NUTRESA	4,620,000,000	173,101
OCCIDENTE	10,000,000	413
PAZRIO	-	623,189
PFAVAL	6,650,000,000	6,159,646
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	456
PFBCOLOM	49,180,000,000	1,577,592
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	51,682
PFCORFICOL	160,000,000	6,778
PFDAVVNDA	2,760,000,000	85,531
PFE	1,000,000,000,000	32,262,397



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	550,000,000	53,594
PFGRUPSURA	1,940,000,000	86,382
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	93
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,896
PROMIGAS	280,000,000	38,185
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,130,000,000	138,000
SQMBCO	30,000,000	115
SUAS	19,740,000,000	412,485
TERPEL	200,000,000	22,171
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	151
VILLAS	20,000,000	4,339

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de marzo de 2022 hasta el 07 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84,812,224



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,241,433
BAC	46,223,958
BBVACOL	28,771
BCOLOMBIA	199,259
BMC	58
BOGOTA	8,702
BVC	20,115
C	20,253,917
CARTON	-
CELSIA	188,385
CEMARGOS	451,212
CENCOSUDCO	4,946,764
CFMITNIPCO	296,285
CHILECO	107,959,182
CLH	24,581
CNEC	134,439
COLTEJER	37
CONCRET	515,405
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	64,740
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	53,608
ECOPETROL	24,375,820
EIMI	339,783
ELCONDOR	34,431
ENELAMCO	64,196,416
ENKA	1,440,384
ESTRA	-
ETB	250,714
EXITO	15,070
FABRICATO	4,183,800
FALABELLCO	3,505,268
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,296,099
GEB	1,101,737
GRUBOLIVAR	5,359
GRUPOARGOS	265,853
GRUPOAVAL	56,764
GRUPOSURA	295,059
HCOLSEL	119,015
ICOLCAP	533,206
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	352,373
ISAC	71,105
IUFS	265,243
IUIT	136,595
JNJ	6,906,519
JPEA	395,425
JPM	11,949,141
JPM	11,949,141
MINEROS	130,212
NUTRESA	173,101
OCCIDENTE	413
PAZRIO	623,189
PFAVAL	6,159,646
PFAVH	-
PFBVACOL	456
PFBCELOM	1,577,592
PFCARPAK	-
PFCMARGOS	51,682
PFCORFICOL	6,778
PFDVVNDA	85,531
PFE	32,262,397



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	53,594
PFGRUPSURA	86,382
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	93
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,896
PROMIGAS	38,185
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	138,000
SQMBCO	115
SUAS	412,485
TERPEL	22,171
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	151
VILLAS	4,339

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías