



Boletín informativo

No.033 / marzo 14 de 2022

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO CON 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 con el 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 marzo de 2022 hasta el 22 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,150,000,000	205,092
CEMARGOS	2,620,000,000	412,224
CORFICOLCF	1,710,000,000	59,135
ECOPETROL	72,940,000,000	26,785,366
GEB	3,020,000,000	1,139,011
GRUPOARGOS	3,490,000,000	274,039
GRUPOSURA	7,010,000,000	287,298
ISA	8,130,000,000	360,241
NUTRESA	4,550,000,000	169,705
PFAVAL	6,290,000,000	5,827,228
PFBCOLOM	50,710,000,000	1,610,639
PFDAVVNDA	2,600,000,000	80,714
PFGRUPSURA	2,090,000,000	93,062
ICOLCAP	7,840,000,000	559,000

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de marzo de 2022 hasta el 22 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	85,989,271



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,320,692
BAC	1,000,000,000,000	47,662,227
BBVACOL	10,000,000	28,785
BCOLOMBIA	7,150,000,000	205,092
BMC	-	58
BOGOTA	770,000,000	10,509
BVC	180,000,000	17,655
C	1,000,000,000,000	20,984,864
CARTON	-	-
CELSIA	820,000,000	190,369
CEMARGOS	2,620,000,000	412,224
CENCOSUDCO	31,700,000,000	4,714,782
CFMITNIPCO	4,100,000,000	314,298
CHILECO	40,710,000,000	108,580,761
CLH	80,000,000	24,005
CNEC	1,450,000,000	141,712
COLTEJER	-	37
CONCRET	180,000,000	531,679
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,710,000,000	59,135
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	89,290,000,000	52,392
ECOPETROL	72,940,000,000	26,785,366
EIMI	47,210,000,000	343,663
ELCONDOR	20,000,000	28,328
ENELAMCO	27,570,000,000	60,062,621
ENKA	50,000,000	2,210,080
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	251,872
EXITO	200,000,000	15,991
FABRICATO	30,000,000	4,383,290
FALABELLCO	51,340,000,000	4,112,107
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,204,070
GEB	3,020,000,000	1,139,011
GRUBOLIVAR	600,000,000	7,647
GRUPOARGOS	3,490,000,000	274,039
GRUPOAVAL	60,000,000	55,557
GRUPOSURA	7,010,000,000	287,298
HCOLSEL	1,680,000,000	117,511
ICOLCAP	7,840,000,000	559,000
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,130,000,000	360,241
ISAC	20,760,000,000	75,130
IUFS	12,180,000,000	288,190
IUIT	10,470,000,000	141,640
JNJ	1,000,000,000,000	6,853,290
JPEA	9,880,000,000	434,892
JPM	1,000,000,000,000	12,898,852
JPM	1,000,000,000,000	12,898,852
MINEROS	540,000,000	139,370
NUTRESA	4,550,000,000	169,705
OCCIDENTE	10,000,000	414
PAZRIO	10,000,000	847,513
PFAVAL	6,290,000,000	5,827,228
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	456
PFBCOLOM	50,710,000,000	1,610,639
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	52,867
PFCORFICOL	160,000,000	6,984
PFDVVNDA	2,600,000,000	80,714
PFE	1,000,000,000,000	32,178,514



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	560,000,000	55,079
PFGRUPSURA	2,090,000,000	93,062
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	120
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,896
PROMIGAS	300,000,000	41,567
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,360,000,000	148,606
SQMBCO	20,000,000	95
SUAS	19,820,000,000	408,838
TERPEL	220,000,000	23,633
TGLSC	-	-
TITAN	-	12
VALSIMESA	-	156
VILLAS	20,000,000	4,481

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

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	85,989,271



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,320,692
BAC	47,662,227
BBVACOL	28,785
BCOLOMBIA	205,092
BMC	58
BOGOTA	10,509
BVC	17,655
C	20,984,864
CARTON	-
CELSIA	190,369
CEMARGOS	412,224
CENCOSUDCO	4,714,782
CFMITNIPCO	314,298
CHILECO	108,580,761
CLH	24,005
CNEC	141,712
COLTEJER	37
CONCRET	531,679
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	59,135
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,392
ECOPETROL	26,785,366
EIMI	343,663
ELCONDOR	28,328
ENELAMCO	60,062,621
ENKA	2,210,080
ESTRA	-
ETB	251,872
EXITO	15,991
FABRICATO	4,383,290
FALABELLCO	4,112,107
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,204,070
GEB	1,139,011
GRUBOLIVAR	7,647
GRUPOARGOS	274,039
GRUPOAVAL	55,557
GRUPOSURA	287,298
HCOLSEL	117,511
ICOLCAP	559,000
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	360,241
ISAC	75,130
IUFS	288,190
IUIT	141,640
JNJ	6,853,290
JPEA	434,892
JPM	12,898,852
JPM	12,898,852
MINEROS	139,370
NUTRESA	169,705
OCCIDENTE	414
PAZRIO	847,513
PFAVAL	5,827,228
PFAVH	-
PFBVACOL	456
PFBCELOM	1,610,639
PFCARPAK	-
PFCMARGOS	52,867
PFCORFICOL	6,984
PFDVVNDA	80,714
PFE	32,178,514



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	55,079
PFGRUPSURA	93,062
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	120
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,896
PROMIGAS	41,567
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	148,606
SQMBCO	95
SUAS	408,838
TERPEL	23,633
TGLSC	-
TITAN	12
VALSIMESA	156
VILLAS	4,481

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías