



Boletín informativo

No.044 / abril 04 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 05 de abril de 2022 hasta el 11 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,360,000,000	216,143
CEMARGOS	2,710,000,000	432,359
CORFICOLCF	1,730,000,000	60,014
ECOPETROL	73,970,000,000	27,078,058
GEB	2,910,000,000	1,129,165
GRUPOARGOS	4,140,000,000	321,647
GRUPOSURA	6,890,000,000	277,841
ISA	8,120,000,000	359,674
NUTRESA	4,310,000,000	158,034
PFAVAL	6,110,000,000	6,527,379
PFBCOLOM	53,790,000,000	1,676,453
PFDAVVNDA	2,440,000,000	74,934
PFGRUPSURA	2,190,000,000	96,501
ICOLCAP	7,980,000,000	562,151

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 05 de abril de 2022 hasta el 11 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	83,627,282



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,316,740
BAC	1,000,000,000,000	46,573,248
BBVACOL	10,000,000	30,857
BCOLOMBIA	7,360,000,000	216,143
BMC	-	71
BOGOTA	800,000,000	11,387
BVC	190,000,000	18,721
C	1,000,000,000,000	21,061,781
CARTON	-	-
CELSIA	820,000,000	190,563
CEMARGOS	2,710,000,000	432,359
CENCOSUDCO	31,240,000,000	4,424,402
CFMITNIPCO	3,060,000,000	222,972
CHILECO	41,110,000,000	109,809,719
CLH	80,000,000	23,764
CNEC	1,510,000,000	147,529
COLTEJER	-	8
CONCRET	190,000,000	569,990
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,730,000,000	60,014
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	91,230,000,000	52,856
ECOPETROL	73,970,000,000	27,078,058
EIMI	46,460,000,000	339,939
ELCONDOR	30,000,000	33,384
ENELAMCO	28,510,000,000	62,182,181
ENKA	50,000,000	1,929,883
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	246,021
EXITO	200,000,000	16,063
FABRICATO	30,000,000	4,522,953
FALABELLCO	48,070,000,000	3,855,035
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,181,019
GEB	2,910,000,000	1,129,165
GRUBOLIVAR	670,000,000	7,699
GRUPOARGOS	4,140,000,000	321,647
GRUPOAVAL	60,000,000	57,172
GRUPOSURA	6,890,000,000	277,841
HCOLSEL	1,990,000,000	136,350
ICOLCAP	7,980,000,000	562,151
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,120,000,000	359,674
ISAC	22,000,000,000	79,436
IUFS	12,370,000,000	292,082
IUIT	10,310,000,000	137,371
JNJ	1,000,000,000,000	6,815,158
JPEA	8,500,000,000	383,277
JPM	1,000,000,000,000	12,812,805
JPM	1,000,000,000,000	12,812,805
MINEROS	530,000,000	137,805
NUTRESA	4,310,000,000	158,034
OCCIDENTE	10,000,000	294
PAZRIO	10,000,000	855,667
PFAVAL	6,110,000,000	6,527,379
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	549
PFBCOLOM	53,790,000,000	1,676,453
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	53,108
PFCORFICOL	170,000,000	7,385
PFDVVNDA	2,440,000,000	74,934
PFE	1,000,000,000,000	30,866,158



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	580,000,000	56,904
PFGRUPSURA	2,190,000,000	96,501
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	183
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,948
PROMIGAS	290,000,000	38,955
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,440,000,000	152,457
SQMBCO	10,000,000	44
SUAS	19,720,000,000	403,162
TERPEL	240,000,000	25,552
TGLSC	-	-
TITAN	-	15
VALSIMESA	-	141
VILLAS	20,000,000	4,524

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 05 de abril de 2022 hasta el 11 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83,627,282



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,316,740
BAC	46,573,248
BBVACOL	30,857
BCOLOMBIA	216,143
BMC	71
BOGOTA	11,387
BVC	18,721
C	21,061,781
CARTON	-
CELSIA	190,563
CEMARGOS	432,359
CENCOSUDCO	4,424,402
CFMITNIPCO	222,972
CHILECO	109,809,719
CLH	23,764
CNEC	147,529
COLTEJER	8
CONCRET	569,990
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	60,014
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,856
ECOPETROL	27,078,058
EIMI	339,939
ELCONDOR	33,384
ENELAMCO	62,182,181
ENKA	1,929,883
ESTRA	-
ETB	246,021
EXITO	16,063
FABRICATO	4,522,953
FALABELLCO	3,855,035
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,181,019
GEB	1,129,165
GRUBOLIVAR	7,699
GRUPOARGOS	321,647
GRUPOAVAL	57,172
GRUPOSURA	277,841
HCOLSEL	136,350
ICOLCAP	562,151
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	359,674
ISAC	79,436
IUFS	292,082
IUIT	137,371
JNJ	6,815,158
JPEA	383,277
JPM	12,812,805
JPM	12,812,805
MINEROS	137,805
NUTRESA	158,034
OCCIDENTE	294
PAZRIO	855,667
PFAVAL	6,527,379
PFAVH	-
PFBBVACOL	549
PFBCOLOM	1,676,453
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	53,108
PFCORFICOL	7,385
PFDAVVNDA	74,934
PFE	30,866,158



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	56,904
PFGRUPSURA	96,501
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	183
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,948
PROMIGAS	38,955
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	152,457
SQMBCO	44
SUAS	403,162
TERPEL	25,552
TGLSC	-
TITAN	15
VALSIMESA	141
VILLAS	4,524

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías