



Boletín informativo

No.049 / abril 18 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 19 de abril de 2022 hasta el 26 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,350,000,000	218,696
CEMARGOS	2,730,000,000	436,454
CORFICOLCF	1,990,000,000	69,045
ECOPETROL	75,020,000,000	27,126,242
GEB	2,990,000,000	1,163,263
GRUPOARGOS	4,340,000,000	334,357
GRUPOSURA	7,320,000,000	287,637
ISA	8,240,000,000	363,987
NUTRESA	4,470,000,000	150,523
PFAVAL	7,140,000,000	7,239,291
PFBCOLOM	54,930,000,000	1,695,972
PFDAVVNDA	2,410,000,000	74,073
PFGRUPSURA	2,200,000,000	97,090
ICOLCAP	8,300,000,000	580,537

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de abril de 2022 hasta el 26 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	82,857,531



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,265,852
BAC	1,000,000,000,000	46,307,156
BBVACOL	10,000,000	38,380
BCOLOMBIA	7,350,000,000	218,696
BMC	-	71
BOGOTA	890,000,000	13,415
BVC	190,000,000	19,313
C	1,000,000,000,000	21,257,653
CARTON	-	-
CELSIA	820,000,000	190,655
CEMARGOS	2,730,000,000	436,454
CENCOSUDCO	27,410,000,000	3,827,754
CFMITNIPCO	2,990,000,000	215,999
CHILECO	43,240,000,000	115,244,345
CLH	70,000,000	22,004
CNEC	1,470,000,000	144,456
COLTEJER	-	12
CONCRET	190,000,000	593,937
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,990,000,000	69,045
CREDIFAMI	-	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	90,730,000,000	52,314
ECOPETROL	75,020,000,000	27,126,242
EIMI	44,380,000,000	332,043
ELCONDOR	20,000,000	32,400
ENELAMCO	26,770,000,000	58,933,333
ENKA	50,000,000	1,944,662
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	248,215
EXITO	210,000,000	16,110
FABRICATO	30,000,000	4,519,676
FALABELLCO	50,410,000,000	4,072,911
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,130,116
GEB	2,990,000,000	1,163,263
GRUBOLIVAR	840,000,000	10,148
GRUPOARGOS	4,340,000,000	334,357
GRUPOAVAL	60,000,000	56,121
GRUPOSURA	7,320,000,000	287,637
HCOLSEL	2,140,000,000	145,674
ICOLCAP	8,300,000,000	580,537
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,240,000,000	363,987
ISAC	22,010,000,000	79,270
IUFS	12,230,000,000	289,216
IUIT	10,230,000,000	136,148
JNJ	1,000,000,000,000	6,798,219
JPEA	7,370,000,000	338,480
JPM	1,000,000,000,000	12,759,383
JPM	1,000,000,000,000	12,759,383
MINEROS	500,000,000	133,480
NUTRESA	4,470,000,000	150,523
OCCIDENTE	10,000,000	299
PAZRIO	10,000,000	855,667
PFAVAL	7,140,000,000	7,239,291
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	54,930,000,000	1,695,972
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	53,492
PFCORFICOL	180,000,000	7,453
PFDAVVNDA	2,410,000,000	74,073
PFE	1,000,000,000,000	28,436,217



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	580,000,000	57,276
PFGRUPSURA	2,200,000,000	97,090
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	197
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,969
PROMIGAS	360,000,000	52,836
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,770,000,000	168,099
SQMBCO	10,000,000	43
SUAS	19,790,000,000	403,428
TERPEL	240,000,000	25,959
TGLSC	-	-
TITAN	-	34
VALSIMESA	-	187
VILLAS	20,000,000	4,558

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de abril de 2022 hasta el 26 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	82,857,531



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,265,852
BAC	46,307,156
BBVACOL	38,380
BCOLOMBIA	218,696
BMC	71
BOGOTA	13,415
BVC	19,313
C	21,257,653
CARTON	-
CELSIA	190,655
CEMARGOS	436,454
CENCOSUDCO	3,827,754
CFMITNIPCO	215,999
CHILECO	115,244,345
CLH	22,004
CNEC	144,456
COLTEJER	12
CONCRET	593,937
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	69,045
CREDIFAMI	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,314
ECOPETROL	27,126,242
EIMI	332,043
ELCONDOR	32,400
ENELAMCO	58,933,333
ENKA	1,944,662
ESTRA	-
ETB	248,215
EXITO	16,110
FABRICATO	4,519,676
FALABELLCO	4,072,911
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,130,116
GEB	1,163,263
GRUBOLIVAR	10,148
GRUPOARGOS	334,357
GRUPOAVAL	56,121
GRUPOSURA	287,637
HCOLSEL	145,674
ICOLCAP	580,537
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	363,987
ISAC	79,270
IUFS	289,216
IUIT	136,148
JNJ	6,798,219
JPEA	338,480
JPM	12,759,383
JPM	12,759,383
MINEROS	133,480
NUTRESA	150,523
OCCIDENTE	299
PAZRIO	855,667
PFAVAL	7,239,291
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,695,972
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	53,492
PFCORFICOL	7,453
PFDAVVNDA	74,073
PFE	28,436,217



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	57,276
PFGRUPSURA	97,090
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	197
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,969
PROMIGAS	52,836
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	168,099
SQMBCO	43
SUAS	403,428
TERPEL	25,959
TGLSC	-
TITAN	34
VALSIMESA	187
VILLAS	4,558

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías