



No.051 / abril 25 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 26 de abril de 2022 hasta el 03 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,370,000,000	215,406
CEMARGOS	2,460,000,000	390,836
CORFICOLCF	1,750,000,000	61,544
ECOPETROL	75,960,000,000	27,263,125
GEB	3,020,000,000	1,175,030
GRUPOARGOS	4,380,000,000	336,917
GRUPOSURA	7,360,000,000	267,398
ISA	8,310,000,000	366,535
NUTRESA	4,510,000,000	152,550
PFAVAL	6,520,000,000	7,096,926
PFBCOLOM	55,440,000,000	1,703,102
PFDAVVNDA	2,070,000,000	63,541
PFGRUPSURA	2,210,000,000	97,552
ICOLCAP	8,440,000,000	586,731

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de abril de 2022 hasta el 03 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	82,168,901



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,270,272
BAC	1,000,000,000,000	46,273,852
BBVACOL	10,000,000	38,374
BCOLOMBIA	7,370,000,000	215,406
BMC	-	71
BOGOTA	900,000,000	13,649
BVC	170,000,000	17,197
C	1,000,000,000,000	21,293,314
CARTON	-	-
CELSIA	830,000,000	194,610
CEMARGOS	2,460,000,000	390,836
CENCOSUDCO	26,950,000,000	3,758,984
CFMITNIPCO	2,990,000,000	215,789
CHILECO	43,370,000,000	115,654,726
CLH	60,000,000	18,552
CNEC	1,480,000,000	146,109
COLTEJER	-	4
CONCRET	200,000,000	600,456
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,750,000,000	61,544
CREDIFAMI	-	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	90,210,000,000	51,910
ECOPETROL	75,960,000,000	27,263,125
EIMI	42,080,000,000	318,458
ELCONDOR	20,000,000	27,478
ENELAMCO	26,520,000,000	58,708,839
ENKA	50,000,000	2,086,637
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	250,281
EXITO	210,000,000	16,209
FABRICATO	30,000,000	4,542,842
FALABELLCO	48,480,000,000	3,962,042
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,038,806
GEB	3,020,000,000	1,175,030
GRUBOLIVAR	880,000,000	10,562
GRUPOARGOS	4,380,000,000	336,917
GRUPOAVAL	50,000,000	44,350
GRUPOSURA	7,360,000,000	267,398
HCOLSEL	2,150,000,000	145,702
ICOLCAP	8,440,000,000	586,731
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,310,000,000	366,535
ISAC	22,210,000,000	79,998
IUFS	11,790,000,000	278,187
IUIT	10,080,000,000	135,382
JNJ	1,000,000,000,000	6,762,864
JPEA	6,360,000,000	296,057
JPM	1,000,000,000,000	12,678,709
JPM	1,000,000,000,000	12,678,709
MINEROS	500,000,000	134,211
NUTRESA	4,510,000,000	152,550
OCCIDENTE	10,000,000	299
PAZRIO	10,000,000	846,916
PFAVAL	6,520,000,000	7,096,926
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	55,440,000,000	1,703,102
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	54,589
PFCORFICOL	180,000,000	7,864
PFDVVNDA	2,070,000,000	63,541
PFE	1,000,000,000,000	28,065,370



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	590,000,000	58,553
PFGRUPSURA	2,210,000,000	97,552
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	197
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	3,009
PROMIGAS	370,000,000	53,675
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,740,000,000	166,888
SQMBCO	10,000,000	43
SUAS	19,590,000,000	391,958
TERPEL	250,000,000	26,187
TGLSC	-	-
TITAN	-	46
VALSIMESA	-	167
VILLAS	20,000,000	4,336

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 26 de abril de 2022 hasta el 03 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	82,168,901



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,270,272
BAC	46,273,852
BBVACOL	38,374
BCOLOMBIA	215,406
BMC	71
BOGOTA	13,649
BVC	17,197
C	21,293,314
CARTON	-
CELSIA	194,610
CEMARGOS	390,836
CENCOSUDCO	3,758,984
CFMITNIPCO	215,789
CHILECO	115,654,726
CLH	18,552
CNEC	146,109
COLTEJER	4
CONCRET	600,456
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	61,544
CREDIFAMI	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	51,910
ECOPETROL	27,263,125
EIMI	318,458
ELCONDOR	27,478
ENELAMCO	58,708,839
ENKA	2,086,637
ESTRA	-
ETB	250,281
EXITO	16,209
FABRICATO	4,542,842
FALABELLCO	3,962,042
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,038,806
GEB	1,175,030
GRUBOLIVAR	10,562
GRUPOARGOS	336,917
GRUPOAVAL	44,350
GRUPOSURA	267,398
HCOLSEL	145,702
ICOLCAP	586,731
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	366,535
ISAC	79,998
IUFS	278,187
IUIT	135,382
JNJ	6,762,864
JPEA	296,057
JPM	12,678,709
JPM	12,678,709
MINEROS	134,211
NUTRESA	152,550
OCCIDENTE	299
PAZRIO	846,916
PFAVAL	7,096,926
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,703,102
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	54,589
PFCORFICOL	7,864
PFDAVVNDA	63,541
PFE	28,065,370



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	58,553
PFGRUPSURA	97,552
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	197
PFVILLASCA	3
POPULAR	3,009
PROMIGAS	53,675
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	166,888
SQMBCO	43
SUAS	391,958
TERPEL	26,187
TGLSC	-
TITAN	46
VALSIMESA	167
VILLAS	4,336

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías