



## Boletín informativo

### No.060 / mayo 16 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](mailto: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 16 de mayo de 2022 hasta el 06 de junio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,750,000,000	227,940
CEMARGOS	2,170,000,000	352,269
CORFICOLCF	1,630,000,000	57,892
ECOPETROL	77,870,000,000	27,309,709
GEB	3,020,000,000	1,177,553
GRUPOARGOS	4,500,000,000	343,340
GRUPOSURA	6,640,000,000	182,277
ISA	8,160,000,000	359,142
NUTRESA	4,470,000,000	152,664
PFAVAL	6,040,000,000	7,102,010
PFBCOLOM	56,410,000,000	1,705,708
PFDAVVNDA	1,990,000,000	61,195
PFGRUPSURA	2,260,000,000	99,347
ICOLCAP	7,930,000,000	545,189

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de mayo de 2022 hasta el 06 de junio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	78,719,177



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,272,471
BAC	1,000,000,000,000	44,270,721
BBVACOL	10,000,000	41,237
BCOLOMBIA	7,750,000,000	227,940
BMC	-	26
BOGOTA	960,000,000	15,433
BVC	180,000,000	18,976
C	1,000,000,000,000	21,292,921
CARTON	-	-
CELSIA	830,000,000	194,825
CEMARGOS	2,170,000,000	352,269
CENCOSUDCO	23,200,000,000	3,293,222
CFMITNIPCO	2,360,000,000	170,968
CHILECO	44,040,000,000	117,694,570
CLH	40,000,000	14,774
CNEC	1,450,000,000	143,793
COLTEJER	-	4
CONCONCRET	200,000,000	611,679
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,630,000,000	57,892
CREDIFAMI	-	4



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	92,080,000,000	52,786
ECOPETROL	77,870,000,000	27,309,709
EIMI	34,400,000,000	273,818
ELCONDOR	20,000,000	22,119
ENELAMCO	21,580,000,000	48,864,685
ENKA	50,000,000	1,986,175
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	243,733
EXITO	400,000,000	27,679
FABRICATO	30,000,000	4,082,974
FALABELLCO	44,940,000,000	3,812,404
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,116,343
GEB	3,020,000,000	1,177,553
GRUBOLIVAR	960,000,000	11,347
GRUPOARGOS	4,500,000,000	343,340
GRUPOAVAL	40,000,000	49,322
GRUPOSURA	6,640,000,000	182,277
HCOLSEL	1,670,000,000	110,874
ICOLCAP	7,930,000,000	545,189
INESA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,160,000,000	359,142
ISAC	22,440,000,000	80,850
IUFS	10,330,000,000	253,798
IUIT	7,810,000,000	106,917
JNJ	1,000,000,000,000	6,685,679
JPEA	4,820,000,000	232,798
JPM	1,000,000,000,000	12,678,235
JPM	1,000,000,000,000	12,678,235
MINEROS	490,000,000	132,891
NUTRESA	4,470,000,000	152,664
OCCIDENTE	-	177
PAZRIO	10,000,000	887,253
PFAVAL	6,040,000,000	7,102,010
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	56,410,000,000	1,705,708
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	210,000,000	51,804
PFCORFICOL	210,000,000	8,842
PFDAVVNDA	1,990,000,000	61,195
PFE	1,000,000,000,000	24,392,235



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	420,000,000	44,785
PFGRUPSURA	2,260,000,000	99,347
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	214
PFVILLASCA	-	2
POPULAR	-	1,622
PROMIGAS	380,000,000	54,944
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,800,000,000	169,382
SQMBCO	10,000,000	36
SUAS	15,920,000,000	323,822
TERPEL	250,000,000	26,738
TGLSC	-	-
TITAN	-	57
VALSIMESA	-	134
VILLAS	10,000,000	2,834

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 16 de mayo de 2022 hasta el 06 de junio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	78,719,177



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,272,471
BAC	44,270,721
BBVACOL	41,237
BCOLOMBIA	227,940
BMC	26
BOGOTA	15,433
BVC	18,976
C	21,292,921
CARTON	-
CELSIA	194,825
CEMARGOS	352,269
CENCOSUDCO	3,293,222
CFMITNIPCO	170,968
CHILECO	117,694,570
CLH	14,774
CNEC	143,793
COLTEJER	4
CONCRET	611,679
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	57,892
CREDIFAMI	4



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,786
ECOPETROL	27,309,709
EIMI	273,818
ELCONDOR	22,119
ENELAMCO	48,864,685
ENKA	1,986,175
ESTRA	-
ETB	243,733
EXITO	27,679
FABRICATO	4,082,974
FALABELLCO	3,812,404
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,116,343
GEB	1,177,553
GRUBOLIVAR	11,347
GRUPOARGOS	343,340
GRUPOAVAL	49,322
GRUPOSURA	182,277
HCOLSEL	110,874
ICOLCAP	545,189
INESA	-





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	359,142
ISAC	80,850
IUFS	253,798
IUIT	106,917
JNJ	6,685,679
JPEA	232,798
JPM	12,678,235
JPM	12,678,235
MINEROS	132,891
NUTRESA	152,664
OCCIDENTE	177
PAZRIO	887,253
PFAVAL	7,102,010
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,705,708
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	51,804
PFCORFICOL	8,842
PFDAVVNDA	61,195
PFE	24,392,235



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	44,785
PFGRUPSURA	99,347
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	214
PFVILLASCA	2
POPULAR	1,622
PROMIGAS	54,944
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	169,382
SQMBCO	36
SUAS	323,822
TERPEL	26,738
TGLSC	-
TITAN	57
VALSIMESA	134
VILLAS	2,834

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías