



## No.068 / 05 de julio 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	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%



## 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 07 de julio de 2022 hasta el 03 de agosto de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
BCOLOMBIA	8,540,000,000	232,685
CEMARGOS	1,960,000,000	340,561
CORFICOLCF	1,700,000,000	62,097
ECOPETROL	90,290,000,000	31,130,405
GEB	2,710,000,000	1,052,741
GRUPOARGOS	4,270,000,000	292,201
GRUPOSURA	10,070,000,000	325,568
ISA	8,360,000,000	367,004
NUTRESA	3,720,000,000	87,499
PFAVAL	6,730,000,000	7,504,618
PFBCOLOM	66,970,000,000	1,933,036
PFDAVVNDA	2,350,000,000	68,937
PFGRUPSURA	1,680,000,000	78,115
ICOLCAP	6,570,000,000	412,413

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de julio de 2022 hasta el 03 de agosto de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
AAPL	1,000,000,000,000	87,622,835



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	72,446,672
BAC	1,000,000,000,000	48,649,655
BBVACOL	20,000,000	42,653
BCOLOMBIA	8,540,000,000	232,685
BMC	-	-
BOGOTA	850,000,000	13,441
BSANTANDCO	33,590,000,000	178,447,622
BVC	200,000,000	20,224
C	1,000,000,000,000	22,762,597
CARTON	-	-
CAPCO	17,010,000,000	349,699
CELSIA	780,000,000	183,600
CEMARGOS	1,960,000,000	340,561
CENCOSUDCO	29,120,000,000	4,712,379
CFMITNIPCO	4,270,000,000	305,556
CHILECO	48,670,000,000	128,793,515
CLH	120,000,000	34,866
CNEC	1,160,000,000	129,239
COLTEJER	10,000,000	25
CONCRET	200,000,000	651,096
COPECCO	17,940,000,000	591,929



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,700,000,000	62,097
CREDIFAMI	10,000,000	4
CSPX	102,390,000,000	58,996
ECOPETROL	90,290,000,000	31,130,405
EIMI	32,300,000,000	267,721
ELCONDOR	190,000,000	303,650
ENELAMCO	30,870,000,000	66,730,442
ENELCHILCO	12,800,000,000	91,584,313
ENKA	30,000,000	1,260,019
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	266,949
ÉXITO	420,000,000	28,184
FABRICATO	20,000,000	2,166,975
FALABELLCO	37,200,000,000	3,393,970
FAMILIA	10,000,000	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,657,706
GEB	2,710,000,000	1,052,741
GRUBOLIVAR	600,000,000	7,258
GRUPOARGOS	4,270,000,000	292,201
GRUPOAVAL	70,000,000	71,420



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	10,070,000,000	325,568
HCOLSEL	1,510,000,000	98,578
ICOLCAP	6,570,000,000	412,413
IDSE	370,000,000	817
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	8,360,000,000	367,004
ISAC	25,610,000,000	93,856
IUFS	8,780,000,000	228,466
IUIT	8,750,000,000	126,937
JNJ	1,000,000,000,000	7,091,308
JPEA	5,040,000,000	256,392
JPM	1,000,000,000,000	13,130,943
MINEROS	490,000,000	138,569
NUTRESA	3,720,000,000	87,499
OCCIDENTE	10,000,000	79
PARAUCOCO	4,280,000,000	1,206,099
PAZRIO	10,000,000	346,163
PFAVAL	6,730,000,000	7,504,618
PFAVH	-	-
PFBVACOL	10,000,000	2,809
PFBLOM	66,970,000,000	1,933,036



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	180,000,000	46,167
PFCORFICOL	200,000,000	8,559
PFDAVVNDA	2,350,000,000	68,937
PFE	1,000,000,000,000	24,960,730
PFGRUPOARG	410,000,000	46,560
PFGRUPSURA	1,680,000,000	78,115
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	10,000,000	256
PFVILLASCA	10,000,000	7
POPULAR	10,000,000	852
PROMIGAS	320,000,000	45,080
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,890,000,000	174,116
SQMBCO	980,000,000	2,963
SUAS	15,430,000,000	326,554
TERPEL	260,000,000	27,755
TGLSC	-	-
TITAN	10,000,000	57
VALSIMESA	10,000,000	147



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
VILLAS	10,000,000	841
BHI	910,000,000	3,147,116
IB01	23,350,000,000	58,549
NU	80,000,000	4,702
SDGEB	30,000,000	13,644

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de julio de 2022 hasta el 03 de agosto de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	87,622,835
AGROCHAL	-
AMZN	72,446,672
BAC	48,649,655
BBVACOL	42,653
BCOLOMBIA	232,685
BMC	-
BOGOTA	13,441
BSANTANDCO	178,447,622
BVC	20,224
C	22,762,597
CARTON	-
CAPCO	349,699
CELSIA	183,600



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CEMARGOS	340,561
CENCOSUDCO	4,712,379
CFMITNIPCO	305,556
CHILECO	128,793,515
CLH	34,866
CNEC	129,239
COLTEJER	25
CONCRET	651,096
COPECCO	591,929
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	62,097
CREDIFAMI	4
CSPX	58,996
ECOPETROL	31,130,405
EIMI	267,721
ELCONDOR	303,650
ENELAMCO	66,730,442
ENELCHILCO	91,584,313
ENKA	1,260,019
ESTRA	-
ETB	266,949
EXITO	28,184





## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
FABRICATO	2,166,975
FALABELLCO	3,393,970
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,657,706
GEB	1,052,741
GRUBOLIVAR	7,258
GRUPOARGOS	292,201
GRUPOAVAL	71,420
GRUPOSURA	325,568
HCOLSEL	98,578
ICOLCAP	412,413
IDSE	817
INESA	-
INVENSA	-
ISA	367,004
ISAC	93,856
IUFS	228,466
IUIT	126,937
JNJ	7,091,308
JPEA	256,392
JPM	13,130,943



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
MINEROS	138,569
NUTRESA	87,499
OCCIDENTE	79
PARAUCOCO	1,206,099
PAZRIO	346,163
PFAVAL	7,504,618
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,809
PFBCELOM	1,933,036
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	46,167
PFCORFICOL	8,559
PFDVVNDA	68,937
PFE	24,960,730
PFGRUPOARG	46,560
PFGRUPSURA	78,115
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	256
PFVILLASCA	7
POPULAR	852
PROMIGAS	45,080



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	174,116
SQMBCO	2,963
SUAS	326,554
TERPEL	27,755
TGLSC	-
TITAN	57
VALSIMESA	147
VILLAS	841
BHI	3,147,116
IB01	58,549
NU	4,702
SDGEB	13,644

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías