



No.084 / 08 de septiembre 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	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 12 de septiembre de 2022 hasta el 17 de octubre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	10.840.000.000	278.376
CELSIA	820.000.000	216.885
CEMARGOS	1.330.000.000	300.916
CNEC	820.000.000	96.170
CORFICOLCF	1.330.000.000	63.039
ECOPETROL	105.170.000.000	42.536.970
GE	1.000.000.000.000	6.476.206
GEB	1.570.000.000	774.656
GRUPOARGOS	2.260.000.000	164.587
GRUPOSURA	12.970.000.000	299.145
ISA	7.570.000.000	351.302
NUTRESA	1.930.000.000	50.509
PFAVAL	4.440.000.000	5.703.794
PFBCOLOM	86.940.000.000	2.482.581
PFDAVVNDA	2.490.000.000	76.510
PFGRUPSURA	1.040.000.000	55.152
AAPL	1.000.000.000.000	75.049.606
AMZN	1.000.000.000.000	69.303.441
BAC	1.000.000.000.000	42.140.131
C	1.000.000.000.000	19.552.560
PFE	1.000.000.000.000	19.806.766
JPM	1.000.000.000.000	12.172.352
JNJ	1.000.000.000.000	6.827.151
HCOLSEL	1.030.000.000	76.552
ICOLCAP	3.520.000.000	243.712



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de septiembre de 2022 hasta el 17 de octubre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	75.049.606
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	69.303.441
BAC	1.000.000.000.000	42.140.131
BBVACOL	20.000.000	29.630
BCOLOMBIA	10.840.000.000	278.376
BMC	10.000.000	10
BOGOTA	850.000.000	16.397
BSANTANDCO	34.420.000.000	197.159.753
BVC	140.000.000	14.579
C	1.000.000.000.000	19.552.560
CARTON	-	-
CAPCO	10.890.000.000	263.810
CELSIA	820.000.000	216.885
CEMARGOS	1.330.000.000	300.916
CENCOSUDCO	37.580.000.000	6.436.885
CFMITNIPCO	7.250.000.000	499.380
CHILECO	71.430.000.000	176.956.484
CLH	940.000.000	287.232



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CNEC	820.000.000	96.170
COLTEJER	10.000.000	24
CONCRET	130.000.000	442.398
COPECCO	29.640.000.000	870.998
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.330.000.000	63.039
CREDIFAMI	-	-
CSPX	86.790.000.000	51.076
ECOPETROL	105.170.000.000	42.536.970
EIMI	33.420.000.000	269.022
ELCONDOR	820.000.000	1.279.449
ENELAMCO	42.080.000.000	99.445.536
ENELCHILCO	18.750.000.000	158.686.170
ENKA	20.000.000	694.910
ESTRA	-	-
ETB	40.000.000	199.550
EXITO	190.000.000	16.780
FABRICATO	10.000.000	698.170
FALABELLCO	36.200.000.000	3.761.227
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1.000.000.000.000	6.476.206



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GEB	1.570.000.000	774.656
GRUBOLIVAR	380.000.000	5.753
GRUPOARGOS	2.260.000.000	164.587
GRUPOAVAL	80.000.000	100.878
GRUPOSURA	12.970.000.000	299.145
HCOLSEL	1.030.000.000	76.552
ICOLCAP	3.520.000.000	243.712
IDSE	360.000.000	839
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	7.570.000.000	351.302
ISAC	27.580.000.000	104.466
IUFS	5.640.000.000	144.534
IUIT	7.450.000.000	101.832
JNJ	1.000.000.000.000	6.827.151
JPEA	5.610.000.000	276.557
JPM	1.000.000.000.000	12.172.352
MINEROS	440.000.000	172.460
NUTRESA	1.930.000.000	50.509
OCCIDENTE	10.000.000	10
PARAUCOCO	7.160.000.000	1.843.585
GEB	1.570.000.000	774.656



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PAZRIO	10.000.000	119.573
PFAVAL	4.440.000.000	5.703.794
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	10.000.000	1.875
PFBCOLOM	86.940.000.000	2.482.581
PFCARPAK	10.000.000	29
PFCEMARGOS	150.000.000	48.310
PFCORFICOL	150.000.000	8.574
PFDAVVNDA	2.490.000.000	76.510
PFE	1.000.000.000.000	19.806.766
PFGRUPOARG	310.000.000	38.322
PFGRUPSURA	1.040.000.000	55.152
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	10.000.000	136
PVVILLASCA	10.000.000	17
POPULAR	10.000.000	328
PROMIGAS	220.000.000	35.404
PROTECCION	10.000.000	1
SANFELIPE	-	-
SDHA	3.460.000.000	146.849
SQMBCO	1.450.000.000	4.021



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
SUAS	15.870.000.000	323.240
TERPEL	220.000.000	25.899
TGLSC	-	-
TITAN	10.000.000	130
VALSIMESA	10.000.000	27
VILLAS	10.000.000	1.029
BHI	660.000.000	2.105.457
IB01	38.620.000.000	89.774
NU	510.780.000.000	28.235.514
SDGEB	210.000.000	110.561

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de septiembre de 2022 hasta el 17 de octubre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	75.049.606
AGROCHAL	-
AMZN	69.303.441
BAC	42.140.131
BBVACOL	29.630
BCOLOMBIA	278.376
BMC	10
BOGOTA	16.397
BSANTANDCO	197.159.753



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
BVC	14.579
C	19.552.560
CARTON	-
CAPCO	263.810
CELSIA	216.885
CEMARGOS	300.916
CENCOSUDCO	6.436.885
CFMITNIPCO	499.380
CHILECO	176.956.484
CLH	287.232
CNEC	96.170
COLTEJER	24
CONCRET	442.398
COPECCO	870.998
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	63.039
CREDIFAMI	-
CSPX	51.076
ECOPETROL	42.536.970
EIMI	269.022
ELCONDOR	1.279.449
ENELAMCO	99.445.536



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ENELCHILCO	158.686.170
ENKA	694.910
ESTRA	-
ETB	199.550
EXITO	16.780
FABRICATO	698.170
FALABELLCO	3.761.227
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6.476.206
GEB	774.656
GRUBOLIVAR	5.753
GRUPOARGOS	164.587
GRUPOAVAL	100.878
GRUPOSURA	299.145
HCOLSEL	76.552
ICOLCAP	243.712
IDSE	839
INESA	-
INVENSA	-
ISA	351.302
ISAC	104.466



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUFS	144.534
IUIT	101.832
JNJ	6.827.151
JPEA	276.557
JPM	12.172.352
MINEROS	172.460
NUTRESA	50.509
OCCIDENTE	10
PARAUCOCO	1.843.585
PAZRIO	119.573
PFAVAL	5.703.794
PFAVH	-
PFBBVACOL	1.875
PFBCOLOM	2.482.581
PFCARPAK	29
PFCEMARGOS	48.310
PFCORFICOL	8.574
PFDAVVNDA	76.510
PFE	19.806.766
PFGRUPOARG	38.322
PFGRUPSURA	55.152
PFVILLA051	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFVILLA053	-
PFVILLAS	136
PFVILLASCA	17
POPULAR	328
PROMIGAS	35.404
PROTECCION	1
SANFELIPE	-
SDHA	146.849
SQMBCO	4.021
SUAS	323.240
TERPEL	25.899
TGLSC	-
TITAN	130
VALSIMESA	27
VILLAS	1.029
BHI	2.105.457
IB01	89.774
NU	28.235.514
SDGEB	110.561

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías