



## No.089 / 27 de octubre 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 28 de octubre de 2022 hasta el 28 de noviembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
BCOLOMBIA	5.000.000.000	141.953
CELSIA	670.000.000	199.118
CEMARGOS	1.050.000.000	279.095
CNEC	510.000.000	65.899
CORFICOLCF	770.000.000	41.173
ECOPETROL	75.980.000.000	33.551.151
GEB	1.560.000.000	809.263
GRUPOARGOS	1.370.000.000	126.950
GRUPOSURA	1.370.000.000	36.338
ISA	4.360.000.000	231.573
NUTRESA	770.000.000	19.730
PFAVAL	2.890.000.000	4.354.624
PFBCOLOM	49.900.000.000	1.589.621
PFDVAVNDA	2.260.000.000	74.295
PFGRUPSURA	490.000.000	34.002
HCOLSEL	980.000.000	80.441
ICOLCAP	1.950.000.000	155.586



## Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de octubre de 2022 hasta el 28 de noviembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	78.924.962
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	54.892.595
BAC	1.000.000.000.000	38.440.157
BBVACOL	10.000.000	12.581
BCOLOMBIA	5.000.000.000	141.953
BMC	-	-
BOGOTA	230.000.000	6.253
BSANTANDCO	25.290.000.000	145.836.446
BVC	80.000.000	9.181
C	1.000.000.000.000	16.868.275
CARTON	-	-
CAPCO	8.190.000.000	240.093
CELSIA	670.000.000	199.118
CEMARGOS	1.050.000.000	279.095
CENCOSUDCO	32.510.000.000	5.375.066



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CFMITNIPCO	8.220.000.000	544.889
CHILECO	64.970.000.000	155.471.937
CLH	870.000.000	258.782
CNEC	510.000.000	65.899
COLTEJER	10.000.000	3
CONCRET	60.000.000	230.907
COPECCO	31.460.000.000	892.348
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	770.000.000	41.173
CREDIFAMI	-	-
CSPX	87.290.000.000	48.838
ECOPETROL	75.980.000.000	33.551.151
EIMI	33.120.000.000	264.447
ELCONDOR	190.000.000	161.192
ENELAMCO	37.400.000.000	78.018.032
ENELCHILCO	20.620.000.000	143.298.333
ENKA	50.000.000	1.759.880
ETB	20.000.000	82.629
EXITO	570.000.000	53.511
FABRICATO	10.000.000	479.492
FALABELLCO	43.140.000.000	4.383.621
FAMILIA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GE	1.000.000.000.000	6.146.454
GEB	1.560.000.000	809.263
GRUBOLIVAR	320.000.000	5.953
GRUPOARGOS	1.370.000.000	126.950
GRUPOAVAL	40.000.000	54.687
GRUPOSURA	1.370.000.000	36.338
HCOLSEL	980.000.000	80.441
ICOLCAP	1.950.000.000	155.586
IDSE	290.000.000	658
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	4.360.000.000	231.573
ISAC	33.130.000.000	121.694
IUFS	6.300.000.000	154.629
IUIT	8.000.000.000	106.488
JNJ	1.000.000.000.000	6.706.424
JPEA	4.670.000.000	221.214
JPM	1.000.000.000.000	11.903.335
MINEROS	170.000.000	86.951
NUTRESA	770.000.000	19.730
OCCIDENTE	10.000.000	5



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PARAUCOCO	7.060.000.000	1.681.852
PAZRIO	10.000.000	118.005
PFAVAL	2.890.000.000	4.354.624
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	49.900.000.000	1.589.621
PFCARPAK	10.000.000	29
PFCEMARGOS	90.000.000	34.415
PFCORFICOL	100.000.000	6.115
PFDAVVNDA	2.260.000.000	74.295
PFE	1.000.000.000.000	18.446.520
PFGRUPOARG	180.000.000	26.365
PFGRUPSURA	490.000.000	34.002
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	781
PROMIGAS	100.000.000	19.202
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	2.130.000.000	85.859



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
SQMBCO	1.500.000.000	4.032
SUAS	17.480.000.000	342.888
TERPEL	150.000.000	18.466
TGLSC	-	-
TITAN	10.000.000	161
VALSIMESA	10.000.000	13
VILLAS	10.000.000	389
BHI	160.000.000	720.115
IB01	33.400.000.000	73.641
NU	587.250.000.000	27.857.785
SDGEB	190.000.000	108.092
LQDA	9.930.000.000	350.000
CBU7	11.930.000.000	18.000

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 28 de octubre de 2022 hasta el 28 de noviembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	78.924.962
AGROCHAL	-
AMZN	54.892.595
BAC	38.440.157
BBVACOL	12.581



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
BCOLOMBIA	141.953
BMC	-
BOGOTA	6.253
BSANTANDCO	145.836.446
BVC	9.181
C	16.868.275
CARTON	-
CAPCO	240.093
CELSIA	199.118
CEMARGOS	279.095
CENCOSUDCO	5.375.066
CFMITNIPCO	544.889
CHILECO	155.471.937
CLH	258.782
CNEC	65.899
COLTEJER	3
CONCRET	230.907
COPECCO	892.348
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	41.173
CREDIFAMI	-
CSPX	48.838





## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
ECOPETROL	33.551.151
EIMI	264.447
ELCONDOR	161.192
ENELAMCO	78.018.032
ENELCHILCO	143.298.333
ENKA	1.759.880
ETB	82.629
EXITO	53.511
FABRICATO	479.492
FALABELLCO	4.383.621
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6.146.454
GEB	809.263
GRUBOLIVAR	5.953
GRUPOARGOS	126.950
GRUPOAVAL	54.687
GRUPOSURA	36.338
HCOLSEL	80.441
ICOLCAP	155.586
IDSE	658
INESA	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	231.573
ISAC	121.694
IUFS	154.629
IUIT	106.488
JNJ	6.706.424
JPEA	221.214
JPM	11.903.335
MINEROS	86.951
NUTRESA	19.730
OCCIDENTE	5
PARAUCOCO	1.681.852
PAZRIO	118.005
PFAVAL	4.354.624
PFAVH	-
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.589.621
PFCARPAK	29
PFCEMARGOS	34.415
PFCORFICOL	6.115
PFDAVVNDA	74.295
PFE	18.446.520



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	26.365
PFGRUPSURA	34.002
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	781
PROMIGAS	19.202
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	85.859
SQMBCO	4.032
SUAS	342.888
TERPEL	18.466
TGLSC	-
TITAN	161
VALSIMESA	13
VILLAS	389
BHI	720.115
IB01	73.641
NU	27.857.785
SDGEB	108.092



## Boletín informativo

LQDA	350.000
CBU7	18.000

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías