



Boletín informativo

No.023 / febrero 21 de 2022

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A 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 al 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 22 de febrero de 2022 hasta el 28 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6,840,000,000	195,392
CEMARGOS	2,720,000,000	469,830
CORFICOLCF	1,850,000,000	63,316
ECOPETROL	68,720,000,000	24,652,282
GEB	3,010,000,000	1,125,278
GRUPOARGOS	3,340,000,000	263,416
GRUPOSURA	7,020,000,000	291,900
ISA	7,780,000,000	346,113
NUTRESA	3,750,000,000	151,622
PFAVAL	7,160,000,000	6,638,408
PFBCOLOM	48,590,000,000	1,561,859
PFDVVNDA	2,600,000,000	80,766
PFGRUPSURA	1,880,000,000	84,011
ICOLCAP	7,320,000,000	529,180

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de febrero de 2022 hasta el 28 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	84,592,712



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,256,463
BAC	1,000,000,000,000	46,027,903
BBVACOL	10,000,000	28,505
BCOLOMBIA	6,840,000,000	195,392
BMC	-	58
BOGOTA	640,000,000	8,781
BVC	220,000,000	21,032
C	1,000,000,000,000	20,055,667
CARTON	-	-
CELSIA	820,000,000	186,528
CEMARGOS	2,720,000,000	469,830
CENCOSUDCO	34,240,000,000	5,320,499
CFMITNIPCO	4,460,000,000	344,557
CHILECO	40,750,000,000	108,652,155
CLH	90,000,000	24,949
CNEC	1,370,000,000	133,275
COLTEJER	-	49
CONCONCRET	170,000,000	500,101
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,850,000,000	63,316
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	87,730,000,000	52,285
ECOPETROL	68,720,000,000	24,652,282
EIMI	48,130,000,000	342,613
ELCONDOR	30,000,000	34,721
ENELAMCO	30,310,000,000	63,768,543
ENKA	30,000,000	1,472,572
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	278,572
EXITO	150,000,000	13,257
FABRICATO	30,000,000	4,173,413
FALABELLCO	48,240,000,000	3,737,062
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,288,244
GEB	3,010,000,000	1,125,278
GRUBOLIVAR	460,000,000	6,275
GRUPOARGOS	3,340,000,000	263,416
GRUPOAVAL	70,000,000	59,865
GRUPOSURA	7,020,000,000	291,900
HCOLSEL	1,930,000,000	138,929
ICOLCAP	7,320,000,000	529,180
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	7,780,000,000	346,113
ISAC	19,240,000,000	69,861
IUFS	11,130,000,000	262,494
IUIT	10,360,000,000	133,694
JNJ	1,000,000,000,000	6,837,121
JPEA	9,010,000,000	388,725
JPM	1,000,000,000,000	11,751,344
JPM	1,000,000,000,000	11,751,344
MINEROS	500,000,000	129,265
NUTRESA	3,750,000,000	151,622
OCCIDENTE	10,000,000	415
PAZRIO	-	619,281
PFAVAL	7,160,000,000	6,638,408
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	226
PFBCOLOM	48,590,000,000	1,561,859
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	51,908
PFCORFICOL	170,000,000	7,079
PFDAVVNDA	2,600,000,000	80,766
PFE	1,000,000,000,000	32,165,810



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	540,000,000	52,902
PFGRUPSURA	1,880,000,000	84,011
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	102
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	3,108
PROMIGAS	280,000,000	38,288
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,140,000,000	138,490
SQMBCO	40,000,000	177
SUAS	19,620,000,000	411,323
TERPEL	190,000,000	21,509
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALSIMESA	-	185
VILLAS	20,000,000	4,073

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de febrero de 2022 hasta el 28 de febrero de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84,592,712



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,256,463
BAC	46,027,903
BBVACOL	28,505
BCOLOMBIA	195,392
BMC	58
BOGOTA	8,781
BVC	21,032
C	20,055,667
CARTON	-
CELSIA	186,528
CEMARGOS	469,830
CENCOSUDCO	5,320,499
CFMITNIPCO	344,557
CHILECO	108,652,155
CLH	24,949
CNEC	133,275
COLTEJER	49
CONCONCRET	500,101
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	63,316
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,285
ECOPETROL	24,652,282
EIMI	342,613
ELCONDOR	34,721
ENELAMCO	63,768,543
ENKA	1,472,572
ESTRA	-
ETB	278,572
EXITO	13,257
FABRICATO	4,173,413
FALABELLCO	3,737,062
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,288,244
GEB	1,125,278
GRUBOLIVAR	6,275
GRUPOARGOS	263,416
GRUPOAVAL	59,865
GRUPOSURA	291,900
HCOLSEL	138,929
ICOLCAP	529,180
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	346,113
ISAC	69,861
IUFS	262,494
IUIT	133,694
JNJ	6,837,121
JPEA	388,725
JPM	11,751,344
JPM	11,751,344
MINEROS	129,265
NUTRESA	151,622
OCCIDENTE	415
PAZRIO	619,281
PFAVAL	6,638,408
PFAVH	-
PFBBVACOL	226
PFBCOLOM	1,561,859
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	51,908
PFCORFICOL	7,079
PFDVVNDA	80,766
PFE	32,165,810



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	52,902
PFGRUPSURA	84,011
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	102
PFVILLASCA	3
POPULAR	3,108
PROMIGAS	38,288
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	138,490
SQMBCO	177
SUAS	411,323
TERPEL	21,509
TGLSC	-
TITAN	-
VALSIMESA	185
VILLAS	4,073

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías