



## Boletín informativo

### No.039 / marzo 28 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 29 de marzo de 2022 hasta el 04 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

| <b>Nemotécnico</b> | <b>VMD Efectivo</b> | <b>VMD acciones</b> |
|--------------------|---------------------|---------------------|
| BCOLOMBIA          | 7.360.000.000       | 216.122             |
| CEMARGOS           | 2.550.000.000       | 402.231             |
| CORFICOLCF         | 1.720.000.000       | 59.259              |
| ECOPETROL          | 72.840.000.000      | 27.091.067          |
| GEB                | 3.040.000.000       | 1.151.142           |
| GRUPOARGOS         | 3.990.000.000       | 311.967             |
| GRUPOSURA          | 6.920.000.000       | 283.377             |
| ISA                | 8.240.000.000       | 364.807             |
| NUTRESA            | 4.480.000.000       | 166.593             |
| PFAVAL             | 6.300.000.000       | 5.856.070           |
| PFBCOLOM           | 51.840.000.000      | 1.637.833           |
| PFDAVVNDA          | 2.540.000.000       | 78.622              |
| PFGRUPSURA         | 2.110.000.000       | 93.598              |
| ICOLCAP            | 7.950.000.000       | 564.634             |

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de marzo de 2022 hasta el 04 de abril 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   | 84.366.294          |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD Efectivo      | VMD acciones |
|-------------|-------------------|--------------|
| AGROCHAL    | -                 | -            |
| AMZN        | 1.000.000.000.000 | 3.318.311    |
| BAC         | 1.000.000.000.000 | 47.093.783   |
| BBVACOL     | 10.000.000        | 29.771       |
| BCOLOMBIA   | 7.360.000.000     | 216.122      |
| BMC         | -                 | 58           |
| BOGOTA      | 800.000.000       | 10.933       |
| BVC         | 180.000.000       | 17.594       |
| C           | 1.000.000.000.000 | 20.812.265   |
| CARTON      | -                 | -            |
| CELSIA      | 850.000.000       | 197.012      |
| CEMARGOS    | 2.550.000.000     | 402.231      |
| CENCOSUDCO  | 30.210.000.000    | 4.388.896    |
| CFMITNIPCO  | 3.600.000.000     | 273.397      |
| CHILECO     | 41.080.000.000    | 109.541.928  |
| CLH         | 80.000.000        | 23.796       |
| CNEC        | 1.450.000.000     | 142.053      |
| COLTEJER    | -                 | 37           |
| CONCRET     | 180.000.000       | 544.616      |
| CORFERIAS   | -                 | 12           |
| CORFICOLCF  | 1.720.000.000     | 59.259       |
| CREDIFAMI   | -                 | -            |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD Efectivo      | VMD acciones |
|-------------|-------------------|--------------|
| CSPX        | 88.540.000.000    | 51.680       |
| ECOPETROL   | 72.840.000.000    | 27.091.067   |
| EIMI        | 45.710.000.000    | 335.217      |
| ELCONDOR    | 20.000.000        | 27.019       |
| ENELAMCO    | 29.090.000.000    | 63.711.714   |
| ENKA        | 50.000.000        | 1.893.709    |
| ESTRA       | -                 | -            |
| ETB         | 50.000.000        | 253.835      |
| EXITO       | 210.000.000       | 16.332       |
| FABRICATO   | 30.000.000        | 4.406.426    |
| FALABELLCO  | 47.970.000.000    | 3.853.890    |
| FAMILIA     | -                 | -            |
| GASNATURAL  | -                 | -            |
| GE          | 1.000.000.000.000 | 5.959.393    |
| GEB         | 3.040.000.000     | 1.151.142    |
| GRUBOLIVAR  | 630.000.000       | 7.264        |
| GRUPOARGOS  | 3.990.000.000     | 311.967      |
| GRUPOAVAL   | 60.000.000        | 56.326       |
| GRUPOSURA   | 6.920.000.000     | 283.377      |
| HCOLSEL     | 1.670.000.000     | 116.825      |
| ICOLCAP     | 7.950.000.000     | 564.634      |
| INESA       | -                 | -            |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD Efectivo      | VMD acciones |
|-------------|-------------------|--------------|
| INVENSA     | -                 | -            |
| ISA         | 8.240.000.000     | 364.807      |
| ISAC        | 20.860.000.000    | 75.459       |
| IUFS        | 12.030.000.000    | 284.339      |
| IUIT        | 10.320.000.000    | 140.304      |
| JNJ         | 1.000.000.000.000 | 6.829.319    |
| JPEA        | 9.510.000.000     | 420.744      |
| JPM         | 1.000.000.000.000 | 13.021.478   |
| JPM         | 1.000.000.000.000 | 13.021.478   |
| MINEROS     | 530.000.000       | 138.101      |
| NUTRESA     | 4.480.000.000     | 166.593      |
| OCCIDENTE   | 10.000.000        | 394          |
| PAZRIO      | 10.000.000        | 847.500      |
| PFAVAL      | 6.300.000.000     | 5.856.070    |
| PFAVH       | -                 | -            |
| PFBVACOL    | -                 | 549          |
| PFCOLOM     | 51.840.000.000    | 1.637.833    |
| PFCARPAK    | -                 | -            |
| PFCEMARGOS  | 220.000.000       | 52.796       |
| PFCORFICOL  | 170.000.000       | 7.092        |
| PFDVVNDA    | 2.540.000.000     | 78.622       |
| PFE         | 1.000.000.000.000 | 31.991.288   |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD Efectivo   | VMD acciones |
|-------------|----------------|--------------|
| PFGRUPOARG  | 570.000.000    | 55.659       |
| PFGRUPSURA  | 2.110.000.000  | 93.598       |
| PFVILLA051  | -              | -            |
| PFVILLA053  | -              | -            |
| PFVILLAS    | -              | 182          |
| PFVILLASCA  | -              | 3            |
| POPULAR     | -              | 2.876        |
| PROMIGAS    | 300.000.000    | 41.136       |
| PROTECCION  | -              | -            |
| SANFELIPE   | -              | -            |
| SDHA        | 3.340.000.000  | 147.756      |
| SQMBCO      | 20.000.000     | 83           |
| SUAS        | 19.790.000.000 | 406.784      |
| TERPEL      | 240.000.000    | 25.354       |
| TGLSC       | -              | -            |
| TITAN       | -              | 12           |
| VALSIMESA   | -              | 156          |
| VILLAS      | 20.000.000     | 4.513        |

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de marzo de 2022 hasta el 04 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

| Nemotécnico | VMD acciones |
|-------------|--------------|
| AAPL        | 84.366.294   |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD acciones |
|-------------|--------------|
| AGROCHAL    | -            |
| AMZN        | 3.318.311    |
| BAC         | 47.093.783   |
| BBVACOL     | 29.771       |
| BCOLOMBIA   | 216.122      |
| BMC         | 58           |
| BOGOTA      | 10.933       |
| BVC         | 17.594       |
| C           | 20.812.265   |
| CARTON      | -            |
| CELSIA      | 197.012      |
| CEMARGOS    | 402.231      |
| CENCOSUDCO  | 4.388.896    |
| CFMITNIPCO  | 273.397      |
| CHILECO     | 109.541.928  |
| CLH         | 23.796       |
| CNEC        | 142.053      |
| COLTEJER    | 37           |
| CONCRET     | 544.616      |
| CORFERIAS   | 12           |
| CORFICOLCF  | 59.259       |
| CREDIFAMI   | -            |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD acciones |
|-------------|--------------|
| CSPX        | 51.680       |
| ECOPETROL   | 27.091.067   |
| EIMI        | 335.217      |
| ELCONDOR    | 27.019       |
| ENELAMCO    | 63.711.714   |
| ENKA        | 1.893.709    |
| ESTRA       | -            |
| ETB         | 253.835      |
| EXITO       | 16.332       |
| FABRICATO   | 4.406.426    |
| FALABELLCO  | 3.853.890    |
| FAMILIA     | -            |
| GASNATURAL  | -            |
| GE          | 5.959.393    |
| GEB         | 1.151.142    |
| GRUBOLIVAR  | 7.264        |
| GRUPOARGOS  | 311.967      |
| GRUPOAVAL   | 56.326       |
| GRUPOSURA   | 283.377      |
| HCOLSEL     | 116.825      |
| ICOLCAP     | 564.634      |
| INESA       | -            |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD acciones |
|-------------|--------------|
| INVENSA     | -            |
| ISA         | 364.807      |
| ISAC        | 75.459       |
| IUFS        | 284.339      |
| IUIT        | 140.304      |
| JNJ         | 6.829.319    |
| JPEA        | 420.744      |
| JPM         | 13.021.478   |
| JPM         | 13.021.478   |
| MINEROS     | 138.101      |
| NUTRESA     | 166.593      |
| OCCIDENTE   | 394          |
| PAZRIO      | 847.500      |
| PFAVAL      | 5.856.070    |
| PFAVH       | -            |
| PFBBVACOL   | 549          |
| PFBCOLOM    | 1.637.833    |
| PFCARPAK    | -            |
| PFCEMARGOS  | 52.796       |
| PFCORFICOL  | 7.092        |
| PFDVVNDA    | 78.622       |
| PFE         | 31.991.288   |



## Boletín informativo

| Nemotécnico | VMD acciones |
|-------------|--------------|
| PFGRUPOARG  | 55.659       |
| PFGRUPSURA  | 93.598       |
| PFVILLA051  | -            |
| PFVILLA053  | -            |
| PFVILLAS    | 182          |
| PFVILLASCA  | 3            |
| POPULAR     | 2.876        |
| PROMIGAS    | 41.136       |
| PROTECCION  | -            |
| SANFELIPE   | -            |
| SDHA        | 147.756      |
| SQMBCO      | 83           |
| SUAS        | 406.784      |
| TERPEL      | 25.354       |
| TGLSC       | -            |
| TITAN       | 12           |
| VALSIMESA   | 156          |
| VILLAS      | 4.513        |

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías