



## Boletín informativo

### No.055 / mayo 02 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 03 de mayo de 2022 hasta el 10 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,430,000,000	212,930
CEMARGOS	2,340,000,000	374,803
CORFICOLCF	1,710,000,000	60,489
ECOPETROL	76,760,000,000	27,332,385
GEB	3,050,000,000	1,188,099
GRUPOARGOS	4,470,000,000	342,194
GRUPOSURA	7,300,000,000	275,185
ISA	8,360,000,000	368,729
NUTRESA	4,560,000,000	159,567
PFAVAL	6,410,000,000	7,179,131
PFBCOLOM	55,850,000,000	1,707,681
PFDAVVNDA	2,040,000,000	62,728
PFGRUPSURA	2,230,000,000	98,151
ICOLCAP	7,990,000,000	551,965

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 03 de mayo de 2022 hasta el 10 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	81,374,405



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,343,410
BAC	1,000,000,000,000	45,847,329
BBVACOL	10,000,000	38,552
BCOLOMBIA	7,430,000,000	212,930
BMC	-	26
BOGOTA	920,000,000	14,284
BVC	180,000,000	18,255
C	1,000,000,000,000	21,249,522
CARTON	-	-
CELSIA	840,000,000	196,947
CEMARGOS	2,340,000,000	374,803
CENCOSUDCO	26,170,000,000	3,661,288
CFMITNIPCO	2,810,000,000	203,790
CHILECO	43,440,000,000	116,060,883
CLH	50,000,000	17,981
CNEC	1,480,000,000	145,750
COLTEJER	-	4
CONCRET	200,000,000	601,307
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,710,000,000	60,489
CREDIFAMI	-	8



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	91,480,000,000	52,538
ECOPETROL	76,760,000,000	27,332,385
EIMI	38,230,000,000	297,477
ELCONDOR	20,000,000	24,613
ENELAMCO	25,190,000,000	56,428,382
ENKA	50,000,000	2,073,759
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	251,606
EXITO	210,000,000	16,394
FABRICATO	30,000,000	4,625,685
FALABELLCO	49,280,000,000	4,093,381
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,280,668
GEB	3,050,000,000	1,188,099
GRUBOLIVAR	960,000,000	11,384
GRUPOARGOS	4,470,000,000	342,194
GRUPOAVAL	40,000,000	45,288
GRUPOSURA	7,300,000,000	275,185
HCOLSEL	2,280,000,000	164,150
ICOLCAP	7,990,000,000	551,965
INESA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,360,000,000	368,729
ISAC	22,400,000,000	80,711
IUFS	11,550,000,000	272,916
IUIT	9,850,000,000	131,339
JNJ	1,000,000,000,000	6,782,769
JPEA	5,330,000,000	252,326
JPM	1,000,000,000,000	12,718,980
JPM	1,000,000,000,000	12,718,980
MINEROS	490,000,000	130,957
NUTRESA	4,560,000,000	159,567
OCCIDENTE	10,000,000	303
PAZRIO	10,000,000	845,329
PFAVAL	6,410,000,000	7,179,131
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	55,850,000,000	1,707,681
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	54,945
PFCORFICOL	190,000,000	8,203
PFDAVVNDA	2,040,000,000	62,728
PFE	1,000,000,000,000	26,757,166



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	510,000,000	51,564
PFGRUPSURA	2,230,000,000	98,151
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	203
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	3,009
PROMIGAS	370,000,000	53,495
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,810,000,000	170,105
SQMBCO	10,000,000	43
SUAS	18,860,000,000	378,985
TERPEL	250,000,000	26,285
TGLSC	-	-
TITAN	-	46
VALSIMESA	-	160
VILLAS	20,000,000	4,197

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 03 de mayo de 2022 hasta el 10 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,374,405



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,343,410
BAC	45,847,329
BBVACOL	38,552
BCOLOMBIA	212,930
BMC	26
BOGOTA	14,284
BVC	18,255
C	21,249,522
CARTON	-
CELSIA	196,947
CEMARGOS	374,803
CENCOSUDCO	3,661,288
CFMITNIPCO	203,790
CHILECO	116,060,883
CLH	17,981
CNEC	145,750
COLTEJER	4
CONCRET	601,307
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	60,489
CREDIFAMI	8



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
CSPX	52,538
ECOPETROL	27,332,385
EIMI	297,477
ELCONDOR	24,613
ENELAMCO	56,428,382
ENKA	2,073,759
ESTRA	-
ETB	251,606
EXITO	16,394
FABRICATO	4,625,685
FALABELLCO	4,093,381
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,280,668
GEB	1,188,099
GRUBOLIVAR	11,384
GRUPOARGOS	342,194
GRUPOAVAL	45,288
GRUPOSURA	275,185
HCOLSEL	164,150
ICOLCAP	551,965
INESA	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	368,729
ISAC	80,711
IUFS	272,916
IUIT	131,339
JNJ	6,782,769
JPEA	252,326
JPM	12,718,980
JPM	12,718,980
MINEROS	130,957
NUTRESA	159,567
OCCIDENTE	303
PAZRIO	845,329
PFAVAL	7,179,131
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,707,681
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	54,945
PFCORFICOL	8,203
PFDAVVNDA	62,728
PFE	26,757,166



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	51,564
PFGRUPSURA	98,151
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	203
PFVILLASCA	3
POPULAR	3,009
PROMIGAS	53,495
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	170,105
SQMBCO	43
SUAS	378,985
TERPEL	26,285
TGLSC	-
TITAN	46
VALSIMESA	160
VILLAS	4,197

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías