



## Boletín informativo

### No.058 / mayo 10 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 10 de mayo de 2022 hasta el 17 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
BCOLOMBIA	7,440,000,000	209,728
CEMARGOS	2,250,000,000	361,658
CORFICOLCF	1,620,000,000	57,448
ECOPETROL	78,200,000,000	27,608,256
GEB	3,050,000,000	1,188,303
GRUPOARGOS	4,450,000,000	340,166
GRUPOSURA	7,300,000,000	228,404
ISA	8,240,000,000	363,071
NUTRESA	4,500,000,000	156,477
PFAVAL	6,190,000,000	7,184,078
PFBCOLOM	56,570,000,000	1,719,741
PFDAVVNDA	1,980,000,000	60,781
PFGRUPSURA	2,240,000,000	98,714
ICOLCAP	7,940,000,000	547,129

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 10 de mayo de 2022 hasta el 17 de mayo 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	81,036,409



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,388,050
BAC	1,000,000,000,000	46,035,509
BBVACOL	10,000,000	41,380
BCOLOMBIA	7,440,000,000	209,728
BMC	-	26
BOGOTA	950,000,000	15,115
BVC	190,000,000	19,111
C	1,000,000,000,000	21,463,075
CARTON	-	-
CELSIA	830,000,000	194,975
CEMARGOS	2,250,000,000	361,658
CENCOSUDCO	24,280,000,000	3,431,299
CFMITNIPCO	2,720,000,000	197,223
CHILECO	44,590,000,000	118,930,374
CLH	50,000,000	17,268
CNEC	1,470,000,000	145,274
COLTEJER	-	4
CONCRET	200,000,000	602,273
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,620,000,000	57,448
CREDIFAMI	-	8



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	92,340,000,000	52,975
ECOPETROL	78,200,000,000	27,608,256
EIMI	35,620,000,000	280,196
ELCONDOR	20,000,000	22,191
ENELAMCO	23,160,000,000	52,321,484
ENKA	50,000,000	1,944,812
ESTRA	-	-
ETB	40,000,000	243,158
EXITO	240,000,000	18,129
FABRICATO	30,000,000	4,260,567
FALABELLCO	48,830,000,000	4,100,101
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,349,597
GEB	3,050,000,000	1,188,303
GRUBOLIVAR	960,000,000	11,375
GRUPOARGOS	4,450,000,000	340,166
GRUPOAVAL	50,000,000	55,276
GRUPOSURA	7,300,000,000	228,404
HCOLSEL	2,140,000,000	143,651
ICOLCAP	7,940,000,000	547,129
INESA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,240,000,000	363,071
ISAC	22,480,000,000	80,971
IUFS	11,060,000,000	269,597
IUIT	8,340,000,000	112,864
JNJ	1,000,000,000,000	6,780,907
JPEA	4,800,000,000	230,585
JPM	1,000,000,000,000	12,794,395
JPM	1,000,000,000,000	12,794,395
MINEROS	500,000,000	133,946
NUTRESA	4,500,000,000	156,477
OCCIDENTE	-	181
PAZRIO	10,000,000	871,135
PFAVAL	6,190,000,000	7,184,078
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	56,570,000,000	1,719,741
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	55,158
PFCORFICOL	200,000,000	8,620
PFDAVVNDA	1,980,000,000	60,781
PFE	1,000,000,000,000	26,486,361



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	450,000,000	46,975
PFGRUPSURA	2,240,000,000	98,714
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	203
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,957
PROMIGAS	370,000,000	53,958
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,870,000,000	172,696
SQMBCO	10,000,000	37
SUAS	17,410,000,000	350,944
TERPEL	250,000,000	26,449
TGLSC	-	-
TITAN	-	46
VALSIMESA	-	160
VILLAS	10,000,000	2,953

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 10 de mayo de 2022 hasta el 17 de mayo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	81,036,409



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,388,050
BAC	46,035,509
BBVACOL	41,380
BCOLOMBIA	209,728
BMC	26
BOGOTA	15,115
BVC	19,111
C	21,463,075
CARTON	-
CELSIA	194,975
CEMARGOS	361,658
CENCOSUDCO	3,431,299
CFMITNIPCO	197,223
CHILECO	118,930,374
CLH	17,268
CNEC	145,274
COLTEJER	4
CONCRET	602,273
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	57,448
CREDIFAMI	8



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,975
ECOPETROL	27,608,256
EIMI	280,196
ELCONDOR	22,191
ENELAMCO	52,321,484
ENKA	1,944,812
ESTRA	-
ETB	243,158
EXITO	18,129
FABRICATO	4,260,567
FALABELLCO	4,100,101
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,349,597
GEB	1,188,303
GRUBOLIVAR	11,375
GRUPOARGOS	340,166
GRUPOAVAL	55,276
GRUPOSURA	228,404
HCOLSEL	143,651
ICOLCAP	547,129
INESA	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	363,071
ISAC	80,971
IUFS	269,597
IUIT	112,864
JNJ	6,780,907
JPEA	230,585
JPM	12,794,395
JPM	12,794,395
MINEROS	133,946
NUTRESA	156,477
OCCIDENTE	181
PAZRIO	871,135
PFAVAL	7,184,078
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,719,741
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	55,158
PFCORFICOL	8,620
PFDAVVNDA	60,781
PFE	26,486,361



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	46,975
PFGRUPSURA	98,714
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	203
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,957
PROMIGAS	53,958
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	172,696
SQMBCO	37
SUAS	350,944
TERPEL	26,449
TGLSC	-
TITAN	46
VALSIMESA	160
VILLAS	2,953

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías