



Boletín informativo

No.063 / 06 de junio 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.

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 07 de junio de 2022 hasta el 06 de julio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,480,000,000	239,690
CEMARGOS	2,020,000,000	337,290
CORFICOLCF	1,650,000,000	59,781
ECOPETROL	81,240,000,000	28,143,564
GEB	2,980,000,000	1,165,140
GRUPOARGOS	4,580,000,000	347,076
GRUPOSURA	9,900,000,000	331,813
ISA	8,530,000,000	375,817
NUTRESA	4,480,000,000	117,030
PFAVAL	6,860,000,000	7,493,164
PFBCOLOM	60,580,000,000	1,792,674
PFDAVVNDA	2,310,000,000	70,118
PFGRUPSURA	2,300,000,000	100,714
ICOLCAP	7,760,000,000	529,782

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de junio de 2022 hasta el 06 de julio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	84,413,072



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,425,190
BAC	1,000,000,000,000	46,975,837
BBVACOL	20,000,000	42,675
BCOLOMBIA	8,480,000,000	239,690
BMC	-	26
BOGOTA	1,080,000,000	17,750
BVC	190,000,000	19,441
C	1,000,000,000,000	22,033,708
CARTON	-	-
CELSIA	840,000,000	195,828
CEMARGOS	2,020,000,000	337,290
CENCOSUDCO	27,790,000,000	4,146,522
CFMITNIPCO	3,060,000,000	217,312
CHILECO	45,790,000,000	121,935,698
CLH	70,000,000	24,489
CNEC	1,400,000,000	139,578
COLTEJER	-	4
CONCONCRET	210,000,000	643,605
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,650,000,000	59,781
CREDIFAMI	-	4



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	95,720,000,000	54,855
ECOPETROL	81,240,000,000	28,143,564
EIMI	34,530,000,000	282,252
ELCONDOR	20,000,000	25,609
ENELAMCO	24,230,000,000	55,221,475
ENKA	50,000,000	1,934,437
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	263,145
EXITO	400,000,000	27,561
FABRICATO	30,000,000	3,446,622
FALABELLCO	48,290,000,000	3,991,353
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,255,997
GEB	2,980,000,000	1,165,140
GRUBOLIVAR	810,000,000	9,184
GRUPOARGOS	4,580,000,000	347,076
GRUPOAVAL	50,000,000	55,423
GRUPOSURA	9,900,000,000	331,813
HCOLSEL	1,210,000,000	78,979
ICOLCAP	7,760,000,000	529,782
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,530,000,000	375,817
ISAC	23,580,000,000	85,403
IUFS	9,970,000,000	252,896
IUIT	8,490,000,000	120,233
JNJ	1,000,000,000,000	6,818,513
JPEA	4,420,000,000	218,936
JPM	1,000,000,000,000	12,913,899
JPM	1,000,000,000,000	12,913,899
MINEROS	500,000,000	137,366
NUTRESA	4,480,000,000	117,030
OCCIDENTE	-	90
PAZRIO	10,000,000	906,776
PFAVAL	6,860,000,000	7,493,164
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	60,580,000,000	1,792,674
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	190,000,000	49,302
PFCORFICOL	210,000,000	9,054
PFDAVVNDA	2,310,000,000	70,118
PFE	1,000,000,000,000	25,361,923



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	440,000,000	48,344
PFGRUPSURA	2,300,000,000	100,714
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	231
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	-	735
PROMIGAS	400,000,000	57,533
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,880,000,000	174,572
SQMBCO	10,000,000	36
SUAS	16,490,000,000	341,025
TERPEL	270,000,000	28,276
TGLSC	-	-
TITAN	-	57
VALSIMESA	-	158
VILLAS	10,000,000	1,319
BHI	800,000,000	2,806,396
IB01	21,640,000,000	54,535
NU	-	75
SDGEB	-	791



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 07 de junio de 2022 hasta el 06 de julio de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84,413,072
AGROCHAL	-
AMZN	3,425,190
BAC	46,975,837
BBVACOL	42,675
BCOLOMBIA	239,690
BMC	26
BOGOTA	17,750
BVC	19,441
C	22,033,708
CARTON	-
CELSIA	195,828
CEMARGOS	337,290
CENCOSUDCO	4,146,522
CFMITNIPCO	217,312
CHILECO	121,935,698
CLH	24,489
CNEC	139,578
COLTEJER	4
CONCRET	643,605



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	59,781
CREDIFAMI	4
CSPX	54,855
ECOPETROL	28,143,564
EIMI	282,252
ELCONDOR	25,609
ENELAMCO	55,221,475
ENKA	1,934,437
ESTRA	-
ETB	263,145
EXITO	27,561
FABRICATO	3,446,622
FALABELLCO	3,991,353
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,255,997
GEB	1,165,140
GRUBOLIVAR	9,184
GRUPOARGOS	347,076
GRUPOAVAL	55,423
GRUPOSURA	331,813



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
HCOLSEL	78,979
ICOLCAP	529,782
INESA	-
INVENSA	-
ISA	375,817
ISAC	85,403
IUFS	252,896
IUIT	120,233
JNJ	6,818,513
JPEA	218,936
JPM	12,913,899
JPM	12,913,899
MINEROS	137,366
NUTRESA	117,030
OCCIDENTE	90
PAZRIO	906,776
PFAVAL	7,493,164
PFAVH	-
PFBBVACOL	2,333
PFBCOLOM	1,792,674
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	49,302



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFCORFICOL	9,054
PFDVVNDA	70,118
PFE	25,361,923
PFGRUPOARG	48,344
PFGRUPSURA	100,714
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	231
PFVILLASCA	-
POPULAR	735
PROMIGAS	57,533
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	174,572
SQMBCO	36
SUAS	341,025
TERPEL	28,276
TGLSC	-
TITAN	57
VALSIMESA	158
VILLAS	1,319
BHI	2,806,396



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IB01	54,535
NU	75
SDGEB	791

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías