



No.074 / 02 de agosto 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	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%



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 04 de agosto de 2022 hasta el 05 de septiembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,710,000,000	235,469
CEMARGOS	1,380,000,000	272,594
CORFICOLCF	1,250,000,000	53,043
ECOPETROL	90,910,000,000	31,862,048
GEB	1,720,000,000	768,289
GRUPOARGOS	3,300,000,000	228,410
GRUPOSURA	9,880,000,000	301,615
ISA	8,230,000,000	363,230
NUTRESA	2,350,000,000	58,864
PFAVAL	5,230,000,000	6,531,499
PFBCOLOM	69,290,000,000	1,995,173
PFDAVVNDA	2,210,000,000	67,231
PFGRUPSURA	1,410,000,000	69,211
ICOLCAP	4,080,000,000	269,316

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de agosto de 2022 hasta el 05 de septiembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	86,599,972



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	72,188,237
BAC	1,000,000,000,000	46,980,327
BBVACOL	20,000,000	45,139
BCOLOMBIA	8,710,000,000	235,469
BMC	10,000,000	10
BOGOTA	860,000,000	13,999
BSANTANDCO	33,790,000,000	180,379,196
BVC	170,000,000	17,605
C	1,000,000,000,000	22,741,975
CARTON	-	-
CAPCO	13,540,000,000	305,561
CELSIA	690,000,000	171,628
CEMARGOS	1,380,000,000	272,594
CENCOSUDCO	30,320,000,000	4,694,823
CFMITNIPCO	4,180,000,000	297,542
CHILECO	51,830,000,000	136,058,406
CLH	110,000,000	34,459
CNEC	900,000,000	104,651
COLTEJER	10,000,000	13
CONCRET	150,000,000	504,012
COPECCO	19,240,000,000	621,734



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,250,000,000	53,043
CREDIFAMI	-	-
CSPX	102,100,000,000	58,598
ECOPETROL	90,910,000,000	31,862,048
EIMI	36,210,000,000	296,741
ELCONDOR	220,000,000	337,269
ENELAMCO	31,130,000,000	69,084,048
ENELCHILCO	12,850,000,000	96,269,043
ENKA	20,000,000	613,606
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	263,191
EXITO	400,000,000	26,753
FABRICATO	20,000,000	1,303,781
FALABELLCO	34,080,000,000	3,394,881
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,039,349
GEB	1,720,000,000	768,289
GRUBOLIVAR	470,000,000	5,750
GRUPOARGOS	3,300,000,000	228,410
GRUPOAVAL	70,000,000	65,744



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	9,880,000,000	301,615
HCOLSEL	860,000,000	57,486
ICOLCAP	4,080,000,000	269,316
IDSE	420,000,000	937
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	8,230,000,000	363,230
ISAC	26,000,000,000	96,111
IUFS	7,230,000,000	190,105
IUIT	8,530,000,000	123,260
JNJ	1,000,000,000,000	7,031,916
JPEA	6,030,000,000	294,224
JPM	1,000,000,000,000	12,919,284
MINEROS	490,000,000	144,857
NUTRESA	2,350,000,000	58,864
OCCIDENTE	10,000,000	57
PARAUCOCO	4,620,000,000	1,267,490
PAZRIO	10,000,000	361,868
PFAVAL	5,230,000,000	6,531,499
PFAVH	-	-
PFBVACOL	10,000,000	1,875
PFBLOM	69,290,000,000	1,995,173



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	150,000,000	44,574
PFCORFICOL	200,000,000	8,732
PFDAVVNDA	2,210,000,000	67,231
PFE	1,000,000,000,000	22,680,075
PFGRUPOARG	350,000,000	41,649
PFGRUPSURA	1,410,000,000	69,211
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	10,000,000	256
PVVILLASCA	10,000,000	7
POPULAR	10,000,000	328
PROMIGAS	280,000,000	42,357
PROTECCION	10,000,000	0
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,810,000,000	168,907
SQMBCO	930,000,000	2,679
SUAS	17,610,000,000	369,221
TERPEL	240,000,000	26,532
TGLSC	-	-
TITAN	10,000,000	46
VALSIMESA	10,000,000	50



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
VILLAS	10,000,000	1,061
BHI	940,000,000	3,240,091
IB01	25,790,000,000	63,593
NU	130,000,000	7,819
SDGEB	40,000,000	20,287

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de agosto de 2022 hasta el 05 de septiembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	86,599,972
AGROCHAL	-
AMZN	72,188,237
BAC	46,980,327
BBVACOL	45,139
BCOLOMBIA	235,469
BMC	10
BOGOTA	13,999
BSANTANDCO	180,379,196
BVC	17,605
C	22,741,975
CARTON	-
CAPCO	305,561
CELSIA	171,628



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CEMARGOS	272,594
CENCOSUDCO	4,694,823
CFMITNIPCO	297,542
CHILECO	136,058,406
CLH	34,459
CNEC	104,651
COLTEJER	13
CONCRET	504,012
COPECCO	621,734
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	53,043
CREDIFAMI	-
CSPX	58,598
ECOPETROL	31,862,048
EIMI	296,741
ELCONDOR	337,269
ENELAMCO	69,084,048
ENELCHILCO	96,269,043
ENKA	613,606
ESTRA	-
ETB	263,191
EXITO	26,753



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
FABRICATO	1,303,781
FALABELLCO	3,394,881
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	7,039,349
GEB	768,289
GRUBOLIVAR	5,750
GRUPOARGOS	228,410
GRUPOAVAL	65,744
GRUPOSURA	301,615
HCOLSEL	57,486
ICOLCAP	269,316
IDSE	937
INESA	-
INVENSA	-
ISA	363,230
ISAC	96,111
IUFS	190,105
IUIT	123,260
JNJ	7,031,916
JPEA	294,224
JPM	12,919,284



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
MINEROS	144,857
NUTRESA	58,864
OCCIDENTE	57
PARAUCOCO	1,267,490
PAZRIO	361,868
PFAVAL	6,531,499
PFAVH	-
PFBBVACOL	1,875
PFBCOLOM	1,995,173
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	44,574
PFCORFICOL	8,732
PFDAVVNDA	67,231
PFE	22,680,075
PFGRUPOARG	41,649
PFGRUPSURA	69,211
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	256
PFVILLASCA	7
POPULAR	328
PROMIGAS	42,357



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PROTECCION	0
SANFELIPE	-
SDHA	168,907
SQMBCO	2,679
SUAS	369,221
TERPEL	26,532
TGLSC	-
TITAN	46
VALSIMESA	50
VILLAS	1,061
BHI	3,240,091
IB01	63,593
NU	7,819
SDGEB	20,287

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías