



Boletín informativo

No.029 / marzo 07 de 2022

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A 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 al 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 08 de marzo de 2022 hasta el 15 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,240,000,000	207,050
CEMARGOS	2,760,000,000	447,746
CORFICOLCF	1,670,000,000	57,208
ECOPETROL	71,580,000,000	25,834,885
GEB	2,990,000,000	1,124,369
GRUPOARGOS	3,440,000,000	270,390
GRUPOSURA	7,130,000,000	292,382
ISA	8,210,000,000	363,647
NUTRESA	4,600,000,000	171,898
PFAVAL	6,510,000,000	6,019,197
PFBCOLOM	50,900,000,000	1,622,346
PFDAVVNDA	2,640,000,000	81,571
PFGRUPSURA	2,010,000,000	89,199
ICOLCAP	7,690,000,000	550,729

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de marzo de 2022 hasta el 15 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	87,040,508



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,310,605
BAC	1,000,000,000,000	47,850,450
BBVACOL	10,000,000	28,752
BCOLOMBIA	7,240,000,000	207,050
BMC	-	58
BOGOTA	650,000,000	8,871
BVC	190,000,000	18,577
C	1,000,000,000,000	21,085,854
CARTON	-	-
CELSIA	840,000,000	192,781
CEMARGOS	2,760,000,000	447,746
CENCOSUDCO	32,310,000,000	4,835,270
CFMITNIPCO	4,120,000,000	316,185
CHILECO	41,010,000,000	109,311,731
CLH	80,000,000	23,905
CNEC	1,440,000,000	141,004
COLTEJER	-	37
CONCRET	180,000,000	526,141
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,670,000,000	57,208
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	91,100,000,000	53,779
ECOPETROL	71,580,000,000	25,834,885
EIMI	48,910,000,000	351,099
ELCONDOR	20,000,000	26,807
ENELAMCO	29,200,000,000	63,156,275
ENKA	40,000,000	1,494,961
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	256,809
EXITO	190,000,000	15,234
FABRICATO	30,000,000	4,276,425
FALABELLCO	48,490,000,000	3,825,095
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,328,040
GEB	2,990,000,000	1,124,369
GRUBOLIVAR	400,000,000	5,005
GRUPOARGOS	3,440,000,000	270,390
GRUPOAVAL	60,000,000	55,403
GRUPOSURA	7,130,000,000	292,382
HCOLSEL	1,670,000,000	116,845
ICOLCAP	7,690,000,000	550,729
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,210,000,000	363,647
ISAC	20,610,000,000	74,643
IUFS	12,060,000,000	284,769
IUIT	10,610,000,000	143,293
JNJ	1,000,000,000,000	6,965,746
JPEA	9,850,000,000	431,326
JPM	1,000,000,000,000	12,765,832
JPM	1,000,000,000,000	12,765,832
MINEROS	530,000,000	137,723
NUTRESA	4,600,000,000	171,898
OCCIDENTE	10,000,000	411
PAZRIO	-	715,867
PFAVAL	6,510,000,000	6,019,197
PFAVH	-	-
PFBVACOL	-	456
PFCOLOM	50,900,000,000	1,622,346
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	51,610
PFCORFICOL	170,000,000	7,026
PFDVVNDA	2,640,000,000	81,571
PFE	1,000,000,000,000	32,543,233



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	560,000,000	54,791
PFGRUPSURA	2,010,000,000	89,199
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	98
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,896
PROMIGAS	290,000,000	40,136
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,430,000,000	151,805
SQMBCO	10,000,000	68
SUAS	20,330,000,000	422,496
TERPEL	210,000,000	22,954
TGLSC	-	-
TITAN	-	12
VALSIMESA	-	156
VILLAS	20,000,000	4,464

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de marzo de 2022 hasta el 15 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	87,040,508



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,310,605
BAC	47,850,450
BBVACOL	28,752
BCOLOMBIA	207,050
BMC	58
BOGOTA	8,871
BVC	18,577
C	21,085,854
CARTON	-
CELSIA	192,781
CEMARGOS	447,746
CENCOSUDCO	4,835,270
CFMITNIPCO	316,185
CHILECO	109,311,731
CLH	23,905
CNEC	141,004
COLTEJER	37
CONCRET	526,141
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	57,208
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	53,779
ECOPETROL	25,834,885
EIMI	351,099
ELCONDOR	26,807
ENELAMCO	63,156,275
ENKA	1,494,961
ESTRA	-
ETB	256,809
EXITO	15,234
FABRICATO	4,276,425
FALABELLCO	3,825,095
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	6,328,040
GEB	1,124,369
GRUBOLIVAR	5,005
GRUPOARGOS	270,390
GRUPOAVAL	55,403
GRUPOSURA	292,382
HCOLSEL	116,845
ICOLCAP	550,729
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	363,647
ISAC	74,643
IUFS	284,769
IUIT	143,293
JNJ	6,965,746
JPEA	431,326
JPM	12,765,832
JPM	12,765,832
MINEROS	137,723
NUTRESA	171,898
OCCIDENTE	411
PAZRIO	715,867
PFAVAL	6,019,197
PFAVH	-
PFBVACOL	456
PFBCOLOM	1,622,346
PFCARPAK	-
PFCMARGOS	51,610
PFCORFICOL	7,026
PFDVVNDA	81,571
PFE	32,543,233



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	54,791
PFGRUPSURA	89,199
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	98
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,896
PROMIGAS	40,136
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	151,805
SQMBCO	68
SUAS	422,496
TERPEL	22,954
TGLSC	-
TITAN	12
VALSIMESA	156
VILLAS	4,464

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías