



No.036 / marzo 22 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 23 de marzo de 2022 hasta el 28 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,360,000,000	216,122
CEMARGOS	2,550,000,000	402,231
CORFICOLCF	1,720,000,000	59,259
ECOPETROL	72,840,000,000	27,091,067
GEB	3,040,000,000	1,151,142
GRUPOARGOS	3,990,000,000	311,967
GRUPOSURA	6,920,000,000	283,377
ISA	8,240,000,000	364,807
NUTRESA	4,480,000,000	166,593
PFAVAL	6,300,000,000	5,856,070
PFBCOLOM	51,840,000,000	1,637,833
PFDAVVNDA	2,540,000,000	78,622
PFGRUPSURA	2,110,000,000	93,598
ICOLCAP	7,950,000,000	564,634

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 23 de marzo de 2022 hasta el 28 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	84,366,294



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,318,311
BAC	1,000,000,000,000	47,093,783
BBVACOL	10,000,000	29,771
BCOLOMBIA	7,360,000,000	216,122
BMC	-	58
BOGOTA	800,000,000	10,933
BVC	180,000,000	17,594
C	1,000,000,000,000	20,812,265
CARTON	-	-
CELSIA	850,000,000	197,012
CEMARGOS	2,550,000,000	402,231
CENCOSUDCO	30,210,000,000	4,388,896
CFMITNIPCO	3,600,000,000	273,397
CHILECO	41,080,000,000	109,541,928
CLH	80,000,000	23,796
CNEC	1,450,000,000	142,053
COLTEJER	-	37
CONCRET	180,000,000	544,616
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,720,000,000	59,259
CREDIFAMI	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	88,540,000,000	51,680
ECOPETROL	72,840,000,000	27,091,067
EIMI	45,710,000,000	335,217
ELCONDOR	20,000,000	27,019
ENELAMCO	29,090,000,000	63,711,714
ENKA	50,000,000	1,893,709
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	253,835
EXITO	210,000,000	16,332
FABRICATO	30,000,000	4,406,426
FALABELLCO	47,970,000,000	3,853,890
FAMILIA	-	-
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	5,959,393
GEB	3,040,000,000	1,151,142
GRUBOLIVAR	630,000,000	7,264
GRUPOARGOS	3,990,000,000	311,967
GRUPOAVAL	60,000,000	56,326
GRUPOSURA	6,920,000,000	283,377
HCOLSEL	1,670,000,000	116,825
ICOLCAP	7,950,000,000	564,634
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,240,000,000	364,807
ISAC	20,860,000,000	75,459
IUFS	12,030,000,000	284,339
IUIT	10,320,000,000	140,304
JNJ	1,000,000,000,000	6,829,319
JPEA	9,510,000,000	420,744
JPM	1,000,000,000,000	13,021,478
JPM	1,000,000,000,000	13,021,478
MINEROS	530,000,000	138,101
NUTRESA	4,480,000,000	166,593
OCCIDENTE	10,000,000	394
PAZRIO	10,000,000	847,500
PFAVAL	6,300,000,000	5,856,070
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	549
PFBCOLOM	51,840,000,000	1,637,833
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	220,000,000	52,796
PFCORFICOL	170,000,000	7,092
PFDAVVNDA	2,540,000,000	78,622
PFE	1,000,000,000,000	31,991,288



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	570,000,000	55,659
PFGRUPSURA	2,110,000,000	93,598
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	182
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,876
PROMIGAS	300,000,000	41,136
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,340,000,000	147,756
SQMBCO	20,000,000	83
SUAS	19,790,000,000	406,784
TERPEL	240,000,000	25,354
TGLSC	-	-
TITAN	-	12
VALSIMESA	-	156
VILLAS	20,000,000	4,513

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 23 de marzo de 2022 hasta el 28 de marzo de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	84,366,294



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,318,311
BAC	47,093,783
BBVACOL	29,771
BCOLOMBIA	216,122
BMC	58
BOGOTA	10,933
BVC	17,594
C	20,812,265
CARTON	-
CELSIA	197,012
CEMARGOS	402,231
CENCOSUDCO	4,388,896
CFMITNIPCO	273,397
CHILECO	109,541,928
CLH	23,796
CNEC	142,053
COLTEJER	37
CONCRET	544,616
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	59,259
CREDIFAMI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	51,680
ECOPETROL	27,091,067
EIMI	335,217
ELCONDOR	27,019
ENELAMCO	63,711,714
ENKA	1,893,709
ESTRA	-
ETB	253,835
EXITO	16,332
FABRICATO	4,406,426
FALABELLCO	3,853,890
FAMILIA	-
GASNATURAL	-
GE	5,959,393
GEB	1,151,142
GRUBOLIVAR	7,264
GRUPOARGOS	311,967
GRUPOAVAL	56,326
GRUPOSURA	283,377
HCOLSEL	116,825
ICOLCAP	564,634
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	364,807
ISAC	75,459
IUFS	284,339
IUIT	140,304
JNJ	6,829,319
JPEA	420,744
JPM	13,021,478
JPM	13,021,478
MINEROS	138,101
NUTRESA	166,593
OCCIDENTE	394
PAZRIO	847,500
PFAVAL	5,856,070
PFAVH	-
PFBVACOL	549
PFBCELOM	1,637,833
PFCARPAK	-
PFCMARGOS	52,796
PFCORFICOL	7,092
PFDVVNDA	78,622
PFE	31,991,288



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	55,659
PFGRUPSURA	93,598
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	182
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,876
PROMIGAS	41,136
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	147,756
SQMBCO	83
SUAS	406,784
TERPEL	25,354
TGLSC	-
TITAN	12
VALSIMESA	156
VILLAS	4,513

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías