



Boletín informativo

No.047 / abril 11 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 12 de abril de 2022 hasta el 19 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7,340,000,000	216,820
CEMARGOS	2,770,000,000	453,834
CORFICOLCF	1,990,000,000	69,049
ECOPETROL	74,760,000,000	27,133,905
GEB	3,000,000,000	1,165,531
GRUPOARGOS	4,340,000,000	335,172
GRUPOSURA	7,320,000,000	287,960
ISA	8,230,000,000	363,577
NUTRESA	4,460,000,000	160,743
PFAVAL	7,580,000,000	7,747,794
PFBCOLOM	54,710,000,000	1,693,488
PFDAVVNDA	2,440,000,000	75,014
PFGRUPSURA	2,200,000,000	97,140
ICOLCAP	8,240,000,000	577,141

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de abril de 2022 hasta el 19 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	83,291,751



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AGROCHAL	-	-
AMZN	1,000,000,000,000	3,305,305
BAC	1,000,000,000,000	46,530,851
BBVACOL	10,000,000	38,380
BCOLOMBIA	7,340,000,000	216,820
BMC	-	71
BOGOTA	930,000,000	13,951
BVC	190,000,000	19,286
C	1,000,000,000,000	21,261,734
CARTON	-	-
CELSIA	840,000,000	196,114
CEMARGOS	2,770,000,000	453,834
CENCOSUDCO	30,880,000,000	4,352,944
CFMITNIPCO	3,000,000,000	217,139
CHILECO	43,270,000,000	115,281,108
CLH	70,000,000	22,463
CNEC	1,480,000,000	145,181
COLTEJER	-	12
CONCONCRET	190,000,000	589,126
CORFERIAS	-	12
CORFICOLCF	1,990,000,000	69,049
CREDIFAMI	-	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSPX	91,080,000,000	52,592
ECOPETROL	74,760,000,000	27,133,905
EIMI	45,340,000,000	334,989
ELCONDOR	30,000,000	33,123
ENELAMCO	28,490,000,000	62,345,887
ENKA	50,000,000	1,907,495
ESTRA	-	-
ETB	50,000,000	247,721
EXITO	200,000,000	16,042
FABRICATO	30,000,000	4,538,659
FALABELLCO	51,570,000,000	4,157,205
FAMILIA	-	24
GASNATURAL	-	-
GE	1,000,000,000,000	6,241,443
GEB	3,000,000,000	1,165,531
GRUBOLIVAR	820,000,000	10,005
GRUPOARGOS	4,340,000,000	335,172
GRUPOAVAL	60,000,000	57,846
GRUPOSURA	7,320,000,000	287,960
HCOLSEL	2,120,000,000	144,755
ICOLCAP	8,240,000,000	577,141
INESA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
INVENSA	-	-
ISA	8,230,000,000	363,577
ISAC	22,020,000,000	79,357
IUFS	12,170,000,000	287,193
IUIT	10,280,000,000	136,856
JNJ	1,000,000,000,000	6,820,021
JPEA	7,760,000,000	344,720
JPM	1,000,000,000,000	12,768,026
JPM	1,000,000,000,000	12,768,026
MINEROS	530,000,000	138,152
NUTRESA	4,460,000,000	160,743
OCCIDENTE	10,000,000	299
PAZRIO	10,000,000	855,667
PFAVAL	7,580,000,000	7,747,794
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	2,333
PFBCOLOM	54,710,000,000	1,693,488
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230,000,000	53,676
PFCORFICOL	180,000,000	7,488
PFDAVVNDA	2,440,000,000	75,014
PFE	1,000,000,000,000	29,233,985



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPOARG	580,000,000	57,500
PFGRUPSURA	2,200,000,000	97,140
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	197
PFVILLASCA	-	3
POPULAR	-	2,969
PROMIGAS	350,000,000	50,909
PROTECCION	-	-
SANFELIPE	-	-
SDHA	3,750,000,000	167,347
SQMBCO	10,000,000	43
SUAS	19,740,000,000	402,638
TERPEL	240,000,000	25,864
TGLSC	-	-
TITAN	-	34
VALSIMESA	-	187
VILLAS	20,000,000	4,559

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 12 de abril de 2022 hasta el 19 de abril de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	83,291,751



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AGROCHAL	-
AMZN	3,305,305
BAC	46,530,851
BBVACOL	38,380
BCOLOMBIA	216,820
BMC	71
BOGOTA	13,951
BVC	19,286
C	21,261,734
CARTON	-
CELSIA	196,114
CEMARGOS	453,834
CENCOSUDCO	4,352,944
CFMITNIPCO	217,139
CHILECO	115,281,108
CLH	22,463
CNEC	145,181
COLTEJER	12
CONCONCRET	589,126
CORFERIAS	12
CORFICOLCF	69,049
CREDIFAMI	8



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CSPX	52,592
ECOPETROL	27,133,905
EIMI	334,989
ELCONDOR	33,123
ENELAMCO	62,345,887
ENKA	1,907,495
ESTRA	-
ETB	247,721
EXITO	16,042
FABRICATO	4,538,659
FALABELLCO	4,157,205
FAMILIA	24
GASNATURAL	-
GE	6,241,443
GEB	1,165,531
GRUBOLIVAR	10,005
GRUPOARGOS	335,172
GRUPOAVAL	57,846
GRUPOSURA	287,960
HCOLSEL	144,755
ICOLCAP	577,141
INESA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
INVENSA	-
ISA	363,577
ISAC	79,357
IUFS	287,193
IUIT	136,856
JNJ	6,820,021
JPEA	344,720
JPM	12,768,026
JPM	12,768,026
MINEROS	138,152
NUTRESA	160,743
OCCIDENTE	299
PAZRIO	855,667
PFAVAL	7,747,794
PFAVH	-
PFBVACOL	2,333
PFBCELOM	1,693,488
PFCARPAK	-
PFCCEMARGOS	53,676
PFCORFICOL	7,488
PFDVVNDA	75,014
PFE	29,233,985



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFGRUPOARG	57,500
PFGRUPSURA	97,140
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	197
PFVILLASCA	3
POPULAR	2,969
PROMIGAS	50,909
PROTECCION	-
SANFELIPE	-
SDHA	167,347
SQMBCO	43
SUAS	402,638
TERPEL	25,864
TGLSC	-
TITAN	34
VALSIMESA	187
VILLAS	4,559

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías