



Boletín informativo

No.009 / 13 de febrero de 2023

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)
Entre un 100% y 150%	3.0
Entre un 150% y 200%	4.0
Mayor a un 200%	5.0

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:



Boletín informativo

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de Incremento en la Garantía por Posición
Entre un 100% y 150%	3.0	22.0%
Entre un 150% y 200%	4.0	41.0%
Mayor a un 200%	5.0	58.0%

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 a partir del 14 de febrero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.450.000.000	146.364
CELSIA	400.000.000	134.527
CEMARGOS	940.000.000	254.903
CNEC	700.000.000	96.211
CORFICOLCF	1.120.000.000	68.938
ECOPETROL	125.770.000.000	54.094.699
GEB	1.470.000.000	786.747
GRUPOARGOS	1.350.000.000	131.256
GRUPOSURA	3.140.000.000	82.770
PFBCOLOM	4.940.000.000	270.981
NUTRESA	1.020.000.000	22.459
PFAVAL	3.930.000.000	6.877.543
PFBCOLOM	49.610.000.000	1.616.413
PFDVVNDA	2.180.000.000	76.528
PFGRUPSURA	600.000.000	44.637
ICOLCAP	2.220.000.000	180.629
SDGEB	140.000.000	79.353
ISA	4.940.000.000	270.981



Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 14 de febrero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	86.737.198
AMZN	1.000.000.000.000	72.868.713
BAC	1.000.000.000.000	39.925.075
BBVACOL	10.000.000	18.595
BCOLOMBIA	5.450.000.000	146.364
BHI	200.000.000	819.992
BMC	-	-
BOGOTA	300.000.000	9.583
BSANTANDCO	18.490.000.000	105.450.453
BVC	60.000.000	6.888
C	1.000.000.000.000	17.914.524
CAPCO	8.220.000.000	257.116
CELSIA	400.000.000	134.527
CEMARGOS	940.000.000	254.903
CENCOSUDCO	26.310.000.000	4.024.577
CFMITNIPCO	4.470.000.000	301.296
CHILECO	43.120.000.000	98.832.714
CLH	160.000.000	36.213
CNEC	700.000.000	96.211
COLTEJER	10.000.000	0
CONCONCRET	50.000.000	205.572
COPECCO	20.840.000.000	631.733
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.120.000.000	68.938



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	-	-
CSPX	96.410.000.000	52.220
ECOPETROL	125.770.000.000	54.094.699
EIMI	35.160.000.000	274.019
ELCONDOR	140.000.000	102.670
EMCA	10.000.000	7
ENELAMCO	38.560.000.000	71.365.215
ENELCHILCO	16.030.000.000	93.394.173
ENKA	40.000.000	1.448.565
ETB	20.000.000	120.879
EXITO	490.000.000	47.453
F	10.000.000	61
FABRICATO	10.000.000	871.146
FALABELLCO	34.760.000.000	3.728.128
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	5.892.927
GEB	1.470.000.000	786.747
GRUBOLIVAR	410.000.000	7.215
GRUPOARGOS	1.350.000.000	131.256
GRUPOAVAL	30.000.000	50.609
GRUPOSURA	3.140.000.000	82.770
HCOLSEL	590.000.000	49.282
IB01	36.700.000.000	76.053
ICHN	10.000.000	316
ICOLCAP	2.220.000.000	180.629
IDSE	330.000.000	718
INRA	10.000.000	0
ISA	4.940.000.000	270.981



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISAC	31.860.000.000	113.408
IUES	10.000.000	8
IUFS	5.720.000.000	134.706
IUHC	10.000.000	31
IUIT	6.710.000.000	89.436
JNJ	1.000.000.000.000	6.817.153
JPEA	6.220.000.000	279.498
JPM	1.000.000.000.000	12.051.734
MARLY	-	-
MINEROS	120.000.000	67.997
MOAT	-	-
NU	639.840.000.000	29.098.694
NUTRESA	1.020.000.000	22.459
OCCIDENTE	10.000.000	2
PARAUCOCO	5.490.000.000	1.157.835
PAZRIO	10.000.000	120.999
PEI	380.000.000	10.184
PFAVAL	3.930.000.000	6.877.543
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	10.000.000	146
PFBCOLOM	49.610.000.000	1.616.413
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	90.000.000	34.609
PFCORFICOL	120.000.000	8.304
PFDAVVNDA	2.180.000.000	76.528
PFE	1.000.000.000.000	19.441.576
PFGRUPOARG	220.000.000	35.852



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPSURA	600.000.000	44.637
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	781
PROMIGAS	100.000.000	20.760
PROTECCION	-	-
RBOT	10.000.000	34
SDGEB	140.000.000	79.353
SDHA	2.650.000.000	99.251
SDIA	10.000.000	151
SQMBCO	850.000.000	2.131
SUAS	25.330.000.000	470.607
TERPEL	120.000.000	14.238
TITAN	10.000.000	39
UBER	10.000.000	23
VALSIMESA	10.000.000	88
VILLAS	10.000.000	673
LQDA	-	-
CBU7	-	-
IJPA	-	-
IWVL	-	-

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 14 de febrero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	86.737.198
AMZN	72.868.713
BAC	39.925.075
BBVACOL	18.595
BCOLOMBIA	146.364
BHI	819.992
BMC	-
BOGOTA	9.583
BSANTANDCO	105.450.453
BVC	6.888
C	17.914.524
CAPCO	257.116
CELSIA	134.527
CEMARGOS	254.903
CENCOSUDCO	4.024.577
CFMITNIPCO	301.296
CHILECO	98.832.714
CLH	36.213
CNEC	96.211
COLTEJER	0
CONCONCRET	205.572
COPECCO	631.733
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	68.938
CREDIFAMI	-
CSPX	52.220
ECOPETROL	54.094.699



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
EIMI	274.019
ELCONDOR	102.670
EMCA	7
ENELAMCO	71.365.215
ENELCHILCO	93.394.173
ENKA	1.448.565
ETB	120.879
EXITO	47.453
F	61
FABRICATO	871.146
FALABELLCO	3.728.128
FAMILIA	-
GE	5.892.927
GEB	786.747
GRUBOLIVAR	7.215
GRUPOARGOS	131.256
GRUPOAVAL	50.609
GRUPOSURA	82.770
HCOLSEL	49.282
IB01	76.053
ICHN	316
ICOLCAP	180.629
IDSE	718
INRA	0
ISA	270.981
ISAC	113.408
IUES	8
IUFS	134.706



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUHC	31
IUIT	89.436
JNJ	6.817.153
JPEA	279.498
JPM	12.051.734
MARLY	-
MINEROS	67.997
MOAT	-
NU	29.098.694
NUTRESA	22.459
OCCIDENTE	2
PARAUCOCO	1.157.835
PAZRIO	120.999
PEI	10.184
PFAVAL	6.877.543
PFAVH	-
PFBBVACOL	146
PFBCOLOM	1.616.413
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	34.609
PFCORFICOL	8.304
PFDVVNDA	76.528
PFE	19.441.576
PFGRUPOARG	35.852
PFGRUPSURA	44.637
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	781



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PROMIGAS	20.760
PROTECCION	-
RBOT	34
SDGEB	79.353
SDHA	99.251
SDIA	151
SQMBCO	2.131
SUAS	470.607
TERPEL	14.238
TITAN	39
UBER	23
VALSIMESA	88
VILLAS	673
LQDA	-
CBU7	-
IJPA	-
IWVL	-

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías