



Boletín informativo

No.013 / 04 de abril 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 05 de abril de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8,430,000,000	214,544
CELSIA	560,000,000	216,909
CEMARGOS	2,290,000,000	748,601
CNEC	300,000,000	14,125
CORFICOLCF	1,370,000,000	114,214
ECOPETROL	138,950,000,000	54,565,321
GEB	1,550,000,000	984,875
GRUPOARGOS	1,400,000,000	150,554
GRUPOSURA	3,340,000,000	98,385
ISA	5,420,000,000	286,842
NUTRESA	610,000,000	12,381
PFAVAL	2,940,000,000	5,235,780
PFBCOLOM	56,700,000,000	1,753,618
PFDAVVNDA	1,200,000,000	48,158
PFGRUPSURA	630,000,000	55,093



Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 05 de abril de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1,000,000,000,000	66,738,031
AMZN	1,000,000,000,000	65,930,829
BAC	1,000,000,000,000	46,312,725
BBVACOL	10,000,000	8,455
BCOLOMBIA	8,430,000,000	214,544
BHI	160,000,000	731,785
BMC	-	-
BOGOTA	400,000,000	13,569
BSANTANDCO	41,870,000,000	211,394,888
BVC	670,000,000	74,066
C	1,000,000,000,000	18,588,962
CAPCO	6,090,000,000	150,302
CELSIA	560,000,000	216,909
CEMARGOS	2,290,000,000	748,601
CENCOSUDCO	36,200,000,000	4,289,713
CFMITNIPCO	1,990,000,000	114,495
CHILECO	53,360,000,000	107,217,799
CLH	60,000,000	12,297
CNEC	300,000,000	14,125
COLTEJER	10,000,000	643
CONCONCRET	40,000,000	187,500
COPECCO	23,350,000,000	671,340
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1,370,000,000	114,214



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	-	-
CSPX	90,710,000,000	46,365
ECOPETROL	138,950,000,000	54,565,321
EIMI	58,180,000,000	411,047
ELCONDOR	20,000,000	11,411
EMCA	4,030,000,000	154,855
ENELAMCO	16,600,000,000	27,364,886
ENELCHILCO	9,660,000,000	44,197,226
ENKA	20,000,000	525,726
ETB	10,000,000	39,414
EXITO	300,000,000	76,021
F	1,000,000,000,000	64,968,446
FABRICATO	10,000,000	674,454
FALABELLCO	44,950,000,000	4,321,749
FAMILIA	-	-
GE	1,000,000,000,000	7,489,722
GEB	1,550,000,000	984,875
GRUBOLIVAR	310,000,000	5,136
GRUPOARGOS	1,400,000,000	150,554
GRUPOAVAL	30,000,000	38,646
GRUPOSURA	3,340,000,000	98,385
HCOLSEL	720,000,000	60,105
IB01	52,890,000,000	107,120
ICHN	3,240,000,000	141,811
ICOLCAP	1,740,000,000	137,822
IDSE	420,000,000	786
INRA	410,000,000	2,935
ISA	5,420,000,000	286,842



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISAC	38,480,000,000	126,490
IUES	5,810,000,000	14,808
IUFS	7,400,000,000	158,600
IUHC	8,940,000,000	185,308
IUIT	8,000,000,000	100,103
JNJ	1,000,000,000,000	7,426,027
JPEA	6,690,000,000	282,264
JPM	1,000,000,000,000	11,579,663
MARLY	-	-
MINEROS	130,000,000	60,363
MOAT	158,690,000,000	474,035
NU	551,310,000,000	25,796,056
NUTRESA	610,000,000	12,381
OCCIDENTE	10,000,000	147
PARAUCOCO	9,620,000,000	1,569,569
PAZRIO	10,000,000	121,134
PEI	340,000,000	11,387
PFAVAL	2,940,000,000	5,235,780
PFAVH	-	-
PFBVACOL	-	-
PFBCELOM	56,700,000,000	1,753,618
PFCARPAK	10,000,000	42
PFCMARGOS	130,000,000	54,382
PFCORFICOL	90,000,000	6,945
PFDVVNDA	1,200,000,000	48,158
PFE	1,000,000,000,000	20,988,848
PFGUPOARG	140,000,000	23,884



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPSURA	630,000,000	55,093
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10,000,000	279
PROMIGAS	50,000,000	9,236
PROTECCION	10,000,000	1
RBOT	4,530,000,000	90,534
SDGEB	-	-
SDHA	3,630,000,000	133,032
SDIA	22,520,000,000	877,844
SQMBCO	3,550,000,000	12,299
SUAS	31,660,000,000	554,965
TERPEL	80,000,000	9,354
TITAN	10,000,000	25
UBER	1,000,000,000,000	23,305,431
VALSIMESA	10,000,000	139
VILLAS	10,000,000	290
LQDA	-	-
CBU7	-	-
IJPA	12,930,000,000	61,120
IWVL	17,990,000,000	105,025

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 05 de abril de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	66,738,031
AMZN	65,930,829
BAC	46,312,725
BBVACOL	8,455
BCOLOMBIA	214,544
BHI	731,785
BMC	-
BOGOTA	13,569
BSANTANDCO	211,394,888
BVC	74,066
C	18,588,962
CAPCO	150,302
CELSIA	216,909
CEMARGOS	748,601
CENCOSUDCO	4,289,713
CFMITNIPCO	114,495
CHILECO	107,217,799
CLH	12,297
CNEC	14,125
COLTEJER	643
CONCONCRET	187,500
COPECCO	671,340
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	114,214
CREDIFAMI	-
CSPX	46,365
ECOPETROL	54,565,321



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
EIMI	411,047
ELCONDOR	11,411
EMCA	154,855
ENELAMCO	27,364,886
ENELCHILCO	44,197,226
ENKA	525,726
ETB	39,414
EXITO	76,021
F	64,968,446
FABRICATO	674,454
FALABELLCO	4,321,749
FAMILIA	-
GE	7,489,722
GEB	984,875
GRUBOLIVAR	5,136
GRUPOARGOS	150,554
GRUPOAVAL	38,646
GRUPOSURA	98,385
HCOLSEL	60,105
IB01	107,120
ICHN	141,811
ICOLCAP	137,822
IDSE	786
INRA	2,935
ISA	286,842
ISAC	126,490
IUES	14,808
IUFS	158,600



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUHC	185,308
IUIT	100,103
JNJ	7,426,027
JPEA	282,264
JPM	11,579,663
MARLY	-
MINEROS	60,363
MOAT	474,035
NU	25,796,056
NUTRESA	12,381
OCCIDENTE	147
PARAUCOCO	1,569,569
PAZRIO	121,134
PEI	11,387
PFAVAL	5,235,780
PFAVH	-
PFBBVACOL	-
PFBCELOM	1,753,618
PFCARPAK	42
PFCMARGOS	54,382
PFCORFICOL	6,945
PFDVVNDA	48,158
PFE	20,988,848
PFGRUPOARG	23,884
PFGRUPSURA	55,093
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	279



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PROMIGAS	9,236
PROTECCION	1
RBOT	90,534
SDGEB	-
SDHA	133,032
SDIA	877,844
SQMBCO	12,299
SUAS	554,965
TERPEL	9,354
TITAN	25
UBER	23,305,431
VALSIMESA	139
VILLAS	290
LQDA	-
CBU7	-
IJPA	61,120
IWVL	105,025
COPECCO	671,340
BRKB	5,000,000
VOO	4,500,000
GEHC	1,800,000

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías