



Boletín informativo

No.023 / 05 de mayo 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 08 de mayo de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.370.000.000	197.013
CELSIA	760.000.000	284.239
CEMARGOS	2.730.000.000	907.956
CNEC	310.000.000	8.132
CORFICOLCF	1.460.000.000	126.499
ECOPETROL	136.690.000.000	55.091.934
GE	1.000.000.000.000	6.970.438
GEB	1.400.000.000	909.284
GRUPOARGOS	1.360.000.000	148.042
GRUPOSURA	7.700.000.000	202.373
ISA	4.800.000.000	280.399
NUTRESA	1.720.000.000	33.272
PFAVAL	2.810.000.000	4.985.827
PFBCOLOM	63.590.000.000	2.067.035
PFDVVNDA	2.030.000.000	90.268



Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 08 de mayo de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	61.280.615
AMZN	1.000.000.000.000	64.179.344
BAC	1.000.000.000.000	58.935.045
BBVACOL	10.000.000	9.462
BCOLOMBIA	7.370.000.000	197.013
BHI	170.000.000	733.959
BMC	10.000.000	2.437
BOGOTA	560.000.000	18.747
BSANTANDCO	45.060.000.000	218.116.588
BVC	640.000.000	67.683
C	1.000.000.000.000	19.128.878
CAPCO	6.830.000.000	176.654
CELSIA	760.000.000	284.239
CEMARGOS	2.730.000.000	907.956
CENCOSUDCO	42.060.000.000	4.689.828
CFMITNIPCO	2.600.000.000	149.702
CHILECO	49.560.000.000	101.426.185
CLH	60.000.000	14.337
CNEC	310.000.000	8.132
COLTEJER	10.000.000	646
CONCONCRET	130.000.000	513.796
COPECCO	27.170.000.000	804.529
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.460.000.000	126.499



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	10.000.000	8
CSPX	85.730.000.000	43.416
ECOPETROL	136.690.000.000	55.091.934
EIMI	52.220.000.000	373.116
ELCONDOR	10.000.000	21
EMCA	4.060.000.000	157.155
ENELAMCO	19.650.000.000	32.779.449
ENELCHILCO	16.260.000.000	68.094.846
ENKA	20.000.000	711.528
ETB	10.000.000	65.563
EXITO	280.000.000	68.586
F	1.000.000.000.000	69.849.510
FABRICATO	10.000.000	1.492.166
FALABELLCO	38.080.000.000	3.573.334
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	6.970.438
GEB	1.400.000.000	909.284
GRUBOLIVAR	240.000.000	3.897
GRUPOARGOS	1.360.000.000	148.042
GRUPOAVAL	40.000.000	55.428
GRUPOSURA	7.700.000.000	202.373
HCOLSEL	560.000.000	48.540
IB01	61.750.000.000	126.229
ICHN	2.440.000.000	109.864
ICOLCAP	1.900.000.000	158.024
IDSE	420.000.000	791
INRA	370.000.000	2.794
ISA	4.800.000.000	280.399



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISAC	30.810.000.000	99.862
IUES	5.740.000.000	14.436
IUFS	7.490.000.000	167.022
IUHC	8.290.000.000	175.289
IUIT	7.010.000.000	82.326
JNJ	1.000.000.000.000	8.253.028
JPEA	5.530.000.000	235.472
JPM	1.000.000.000.000	13.785.336
MARLY	-	-
MINEROS	150.000.000	68.222
MOAT	199.360.000.000	587.648
NU	548.380.000.000	24.067.760
NUTRESA	1.720.000.000	33.272
OCCIDENTE	10.000.000	188
PARAUCOCO	9.890.000.000	1.535.662
PAZRIO	10.000.000	63.927
PEI	490.000.000	16.865
PFAVAL	2.810.000.000	4.985.827
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	63.590.000.000	2.067.035
PFCARPAK	10.000.000	15
PFCEMARGOS	140.000.000	60.414
PFCORFICOL	70.000.000	6.160
PFDVVNDA	2.030.000.000	90.268
PFE	1.000.000.000.000	21.713.170
PFGRUPOARG	140.000.000	24.624



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPSURA	690.000.000	62.561
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	219
PROMIGAS	80.000.000	19.032
PROTECCION	-	-
RBOT	5.250.000.000	103.467
SDGEB	-	-
SDHA	3.280.000.000	121.009
SDIA	19.600.000.000	767.177
SQMBCO	4.680.000.000	16.315
SUAS	28.310.000.000	492.739
TERPEL	110.000.000	12.827
TITAN	10.000.000	47
UBER	1.000.000.000.000	26.233.578
VALSIMESA	10.000.000	93
VILLAS	10.000.000	127
LQDA	-	-
CBU7	10.150.000.000	16.865
IJPA	13.900.000.000	65.554
IWVL	19.160.000.000	112.154
COPECCO	27.170.000.000	804.529
BRKB	1.000.000.000.000	3.656.978
VOO	1.000.000.000.000	3.748.599
GEHC	756.070.000.000	2.101.156



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 08 de mayo de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	61.280.615
AMZN	64.179.344
BAC	58.935.045
BBVACOL	9.462
BCOLOMBIA	197.013
BHI	733.959
BMC	2.437
BOGOTA	18.747
BSANTANDCO	218.116.588
BVC	67.683
C	19.128.878
CAPCO	176.654
CELSIA	284.239
CEMARGOS	907.956
CENCOSUDCO	4.689.828
CFMITNIPCO	149.702
CHILECO	101.426.185
CLH	14.337
CNEC	8.132
COLTEJER	646
CONCONCRET	513.796
COPECCO	804.529
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	126.499
CREDIFAMI	8
CSPX	43.416



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ECOPETROL	55.091.934
EIMI	373.116
ELCONDOR	21
EMCA	157.155
ENELAMCO	32.779.449
ENELCHILCO	68.094.846
ENKA	711.528
ETB	65.563
EXITO	68.586
F	69.849.510
FABRICATO	1.492.166
FALABELLCO	3.573.334
FAMILIA	-
GE	6.970.438
GEB	909.284
GRUBOLIVAR	3.897
GRUPOARGOS	148.042
GRUPOAVAL	55.428
GRUPOSURA	202.373
HCOLSEL	48.540
IB01	126.229
ICHN	109.864
ICOLCAP	158.024
IDSE	791
INRA	2.794
ISA	280.399
ISAC	99.862
IUES	14.436



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUFS	167.022
IUHC	175.289
IUIT	82.326
JNJ	8.253.028
JPEA	235.472
JPM	13.785.336
MARLY	-
MINEROS	68.222
MOAT	587.648
NU	24.067.760
NUTRESA	33.272
OCCIDENTE	188
PARAUCOCO	1.535.662
PAZRIO	63.927
PEI	16.865
PFAVAL	4.985.827
PFAVH	-
PFB BVACOL	-
PFB COLOM	2.067.035
PFCARPAK	15
PFC EMARGOS	60.414
PFCORFICOL	6.160
PFD AVV NDA	90.268
PFE	21.713.170
PFGRUPOARG	24.624
PFGRUPSURA	62.561
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	219
PROMIGAS	19.032
PROTECCION	-
RBOT	103.467
SDGEB	-
SDHA	121.009
SDIA	767.177
SQMBCO	16.315
SUAS	492.739
TERPEL	12.827
TITAN	47
UBER	26.233.578
VALSIMESA	93
VILLAS	127
LQDA	-
CBU7	16.865
IJPA	65.554
IWVL	112.154
COPECCO	804.529
BRKB	3.656.978
VOO	3.748.599
GEHC	2.101.156

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías