



Boletín informativo

No.031 / 04 de julio 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 julio de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.160.000.000	186.349
CELSIA	350.000.000	120.287
CEMARGOS	1.440.000.000	451.047
CNEC	230.000.000	6.176
CORFICOLCF	940.000.000	69.283
ECOPETROL	97.070.000.000	43.397.424
GEB	950.000.000	543.649
GRUPOARGOS	900.000.000	95.426
GRUPOSURA	4.870.000.000	116.416
ISA	4.450.000.000	257.934
NUTRESA	1.080.000.000	19.129
PFAVAL	1.860.000.000	3.415.635
PFBCOLOM	54.080.000.000	1.875.991
PFDVVNDA	2.300.000.000	112.025
PFGRUPSURA	550.000.000	44.810



Boletín informativo

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

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	56.480.615
AMZN	1.000.000.000.000	61.019.200
BAC	1.000.000.000.000	50.756.123
BBVACOL	10.000.000	10.163
BCOLOMBIA	6.160.000.000	186.349
BHI	130.000.000	542.853
BMC	10.000.000	6.050
BOGOTA	400.000.000	12.080
BSANTANDCO	28.960.000.000	139.149.028
BVC	90.000.000	8.051
C	1.000.000.000.000	15.121.781
CAPCO	7.330.000.000	216.910
CELSIA	350.000.000	120.287
CEMARGOS	1.440.000.000	451.047
CENCOSUDCO	41.090.000.000	4.738.485
CFMITNIPCO	2.790.000.000	166.298
CHILECO	36.480.000.000	79.663.068
CLH	10.000.000	1.935
CNEC	230.000.000	6.176
COLTEJER	10.000.000	39
CONCONCRET	120.000.000	475.083
COPECCO	22.700.000.000	713.607
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	940.000.000	69.283



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	10.000.000	8
CSPX	80.600.000.000	41.916
ECOPETROL	97.070.000.000	43.397.424
EIMI	43.760.000.000	333.238
ELCONDOR	10.000.000	221
EMCA	3.630.000.000	149.124
ENELAMCO	24.430.000.000	40.938.955
ENELCHILCO	29.020.000.000	110.934.405
ENKA	20.000.000	472.935
ETB	20.000.000	107.451
EXITO	70.000.000	16.251
F	1.000.000.000.000	59.201.353
FABRICATO	10.000.000	1.237.833
FALABELLCO	39.640.000.000	3.895.671
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	5.655.295
GEB	950.000.000	543.649
GRUBOLIVAR	170.000.000	2.550
GRUPOARGOS	900.000.000	95.426
GRUPOAVAL	40.000.000	58.297
GRUPOSURA	4.870.000.000	116.416
HCOLSEL	570.000.000	48.333
IB01	59.770.000.000	128.464
ICHN	1.430.000.000	72.005
ICOLCAP	2.640.000.000	224.186
IDSE	260.000.000	499
INRA	460.000.000	3.864
ISA	4.450.000.000	257.934



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISAC	29.210.000.000	98.013
IUES	5.050.000.000	142.857
IUFS	5.610.000.000	136.457
IUHC	7.290.000.000	162.424
IUIT	8.880.000.000	99.922
JNJ	1.000.000.000.000	6.744.642
JPEA	4.120.000.000	186.643
JPM	1.000.000.000.000	11.050.917
MARLY	-	-
MINEROS	190.000.000	90.492
MOAT	238.960.000.000	718.889
NU	739.860.000.000	26.647.109
NUTRESA	1.080.000.000	19.129
OCCIDENTE	10.000.000	247
PARAUCOCO	10.030.000.000	1.548.121
PAZRIO	10.000.000	34.047
PEI	850.000.000	26.125
PFAVAL	1.860.000.000	3.415.635
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	54.080.000.000	1.875.991
PFCARPAK	10.000.000	26
PFCEMARGOS	100.000.000	40.201
PFCORFICOL	60.000.000	4.606
PFDVVNDA	2.300.000.000	112.025
PFE	1.000.000.000.000	24.220.254
PFGRUPOARG	130.000.000	21.952



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPSURA	550.000.000	44.810
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	-	-
PROMIGAS	160.000.000	37.479
PROTECCION	-	-
RBOT	5.020.000.000	101.419
SDGEB	-	-
SDHA	3.170.000.000	122.211
SDIA	16.260.000.000	671.330
SQMBCO	2.140.000.000	7.730
SUAS	12.790.000.000	233.882
TERPEL	70.000.000	9.332
TITAN	10.000.000	89
UBER	1.000.000.000.000	23.277.887
VALSIMESA	-	-
VILLAS	10.000.000	280
LQDA	50.000.000	1.745
CBU7	10.890.000.000	19.293
IJPA	11.560.000.000	55.945
IWVL	8.270.000.000	51.103
COPECCO	22.700.000.000	713.607
BRKB	1.000.000.000.000	3.262.380
VOO	1.000.000.000.000	3.537.311
GEHC	1.000.000.000.000	2.885.601



Boletín informativo

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

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	56.480.615
AMZN	61.019.200
BAC	50.756.123
BBVACOL	10.163
BCOLOMBIA	186.349
BHI	542.853
BMC	6.050
BOGOTA	12.080
BSANTANDCO	139.149.028
BVC	8.051
C	15.121.781
CAPCO	216.910
CELSIA	120.287
CEMARGOS	451.047
CENCOSUDCO	4.738.485
CFMITNIPCO	166.298
CHILECO	79.663.068
CLH	1.935
CNEC	6.176
COLTEJER	39
CONCONCRET	475.083
COPECCO	713.607
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	69.283
CREDIFAMI	8
CSPX	41.916



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ECOPETROL	43.397.424
EIMI	333.238
ELCONDOR	221
EMCA	149.124
ENELAMCO	40.938.955
ENELCHILCO	110.934.405
ENKA	472.935
ETB	107.451
EXITO	16.251
F	59.201.353
FABRICATO	1.237.833
FALABELLCO	3.895.671
FAMILIA	-
GE	5.655.295
GEB	543.649
GRUBOLIVAR	2.550
GRUPOARGOS	95.426
GRUPOAVAL	58.297
GRUPOSURA	116.416
HCOLSEL	48.333
IB01	128.464
ICHN	72.005
ICOLCAP	224.186
IDSE	499
INRA	3.864
ISA	257.934
ISAC	98.013
IUES	142.857



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUFS	136.457
IUHC	162.424
IUIT	99.922
JNJ	6.744.642
JPEA	186.643
JPM	11.050.917
MARLY	-
MINEROS	90.492
MOAT	718.889
NU	26.647.109
NUTRESA	19.129
OCCIDENTE	247
PARAUCOCO	1.548.121
PAZRIO	34.047
PEI	26.125
PFAVAL	3.415.635
PFAVH	-
PFBVACOL	-
PFCOLOM	1.875.991
PFCARPAK	26
PFCMARGOS	40.201
PFCORFICOL	4.606
PFDVVNDA	112.025
PFE	24.220.254
PFGRUPOARG	21.952
PFGROUPSURA	44.810
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	-
PROMIGAS	37.479
PROTECCION	-
RBOT	101.419
SDGEB	-
SDHA	122.211
SDIA	671.330
SQMBCO	7.730
SUAS	233.882
TERPEL	9.332
TITAN	89
UBER	23.277.887
VALSIMESA	-
VILLAS	280
LQDA	1.745
CBU7	19.293
IJPA	55.945
IWVL	51.103
COPECCO	713.607
BRKB	3.262.380
VOO	3.537.311
GEHC	2.885.601

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías