



Boletín informativo

No.038 / 11 de agosto 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 agosto de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.370.000.000	200.186
CELSIA	240.000.000	86.403
CEMARGOS	1.210.000.000	358.641
CNEC	170.000.000	4.715
CORFICOLCF	790.000.000	55.132
ECOPETROL	75.390.000.000	35.242.495
GEB	990.000.000	544.964
GRUPOARGOS	1.050.000.000	109.854
GRUPOSURA	550.000.000	13.506
ISA	4.610.000.000	265.223
NUTRESA	780.000.000	13.614
PFAVAL	1.610.000.000	3.098.031
PFBCELOM	49.620.000.000	1.752.704
PFDVVNDA	1.550.000.000	78.385
PFGGRUPSURA	580.000.000	44.066



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
HCOLSEL	630.000.000	54.437
ICOLCAP	2.870.000.000	244.662

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

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	55.212.680
AMZN	1.000.000.000.000	59.753.338
BAC	1.000.000.000.000	46.172.260
BBVACOL	10.000.000	11.111
BCOLOMBIA	6.370.000.000	200.186
BHI	150.000.000	670.987
BMC	10.000.000	6.050
BOGOTA	330.000.000	9.892
BSANTANDCO	32.270.000.000	154.926.603
BVC	70.000.000	6.912
C	1.000.000.000.000	15.318.628
CAPCO	7.460.000.000	231.819
CELSIA	240.000.000	86.403
CEMARGOS	1.210.000.000	358.641
CENCOSUDCO	37.970.000.000	4.437.535
CFMITNIPCO	2.600.000.000	157.181
CHILECO	38.680.000.000	85.031.238
CLH	-	-
CNEC	170.000.000	4.715
COLTEJER	10.000.000	31



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CONCRET	80.000.000	291.686
COPECCO	23.380.000.000	742.321
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	790.000.000	55.132
CREDIFAMI	-	-
CSPX	89.030.000.000	46.516
ECOPETROL	75.390.000.000	35.242.495
EIMI	46.030.000.000	358.165
ELCONDOR	10.000.000	1.275
EMCA	4.000.000.000	170.741
ENELAMCO	22.780.000.000	39.566.281
ENELCHILCO	39.050.000.000	142.011.662
ENKA	10.000.000	340.908
ETB	20.000.000	187.855
EXITO	60.000.000	14.200
F	1.000.000.000.000	59.610.666
FABRICATO	10.000.000	190.932
FALABELLCO	39.410.000.000	3.820.724
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	5.202.323
GEB	990.000.000	544.964
GRUBOLIVAR	180.000.000	2.580
GRUPOARGOS	1.050.000.000	109.854
GRUPOAVAL	20.000.000	38.638
GRUPOSURA	550.000.000	13.506
HCOLSEL	630.000.000	54.437
IB01	53.220.000.000	117.728
ICHN	1.560.000.000	84.545



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ICOLCAP	2.870.000.000	244.662
IDSE	310.000.000	620
INRA	530.000.000	4.716
ISA	4.610.000.000	265.223
ISAC	31.340.000.000	106.658
IUES	4.970.000.000	146.793
IUFS	4.850.000.000	119.481
IUHC	6.760.000.000	155.909
IUIT	12.030.000.000	132.934
JNJ	1.000.000.000.000	7.492.778
JPEA	4.490.000.000	210.175
JPM	1.000.000.000.000	10.172.641
MARLY	-	-
MINEROS	200.000.000	102.960
MOAT	267.030.000.000	805.216
NU	824.530.000.000	27.555.544
NUTRESA	780.000.000	13.614
OCCIDENTE	10.000.000	172
PARAUCOCO	11.010.000.000	1.663.745
PAZRIO	10.000.000	148.789
PEI	740.000.000	21.578
PFAVAL	1.610.000.000	3.098.031
PFAVH	-	-
PFBVACOL	-	-
PFBCOLOM	49.620.000.000	1.752.704
PFCARPAK	10.000.000	16
PFCEMARGOS	90.000.000	36.602



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	60.000.000	4.555
PFDAVVNDA	1.550.000.000	78.385
PFE	1.000.000.000.000	25.438.154
PFGRUPOARG	240.000.000	39.927
PFGRUPSURA	580.000.000	44.066
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	-	-
PROMIGAS	130.000.000	28.686
PROTECCION	-	-
RBOT	5.140.000.000	104.189
SDGEB	-	-
SDHA	2.880.000.000	114.267
SDIA	16.790.000.000	723.457
SQMBCO	1.330.000.000	4.942
SUAS	11.170.000.000	205.753
TERPEL	50.000.000	5.719
TITAN	10.000.000	67
UBER	1.000.000.000.000	25.231.428
VALSIMESA	-	-
VILLAS	10.000.000	272
LQDA	90.000.000	3.715
CBU7	12.900.000.000	23.729
IJPA	10.750.000.000	52.678
IWVL	16.720.000.000	106.690
COPECCO	23.380.000.000	742.321
BRKB	1.000.000.000.000	3.155.679



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
VOO	1.000.000.000.000	3.705.249
GEHC	1.000.000.000.000	3.211.719
VALINDUSTR	10.000.000	779
FB	1.000.000.000.000	25.671.435

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

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	55.212.680
AMZN	59.753.338
BAC	46.172.260
BBVACOL	11.111
BCOLOMBIA	200.186
BHI	670.987
BMC	6.050
BOGOTA	9.892
BSANTANDCO	154.926.603
BVC	6.912
C	15.318.628
CAPCO	231.819
CELSIA	86.403
CEMARGOS	358.641
CENCOSUDCO	4.437.535
CFMITNIPCO	157.181
CHILECO	85.031.238
CNEC	4.715



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
COLTEJER	31
CONCRET	291.686
COPECCO	742.321
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	55.132
CREDIFAMI	-
CSPX	46.516
ECOPETROL	35.242.495
EIMI	358.165
ELCONDOR	1.275
EMCA	170.741
ENELAMCO	39.566.281
ENELCHILCO	142.011.662
ENKA	340.908
ETB	187.855
EXITO	14.200
F	59.610.666
FABRICATO	190.932
FALABELLCO	3.820.724
FAMILIA	-
GE	5.202.323
GEB	544.964
GRUBOLIVAR	2.580
GRUPOARGOS	109.854
GRUPOAVAL	38.638
GRUPOSURA	13.506
HCOLSEL	54.437
IB01	117.728



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ICHN	84.545
ICOLCAP	244.662
IDSE	620
INRA	4.716
ISA	265.223
ISAC	106.658
IUES	146.793
IUFS	119.481
IUHC	155.909
IUIT	132.934
JNJ	7.492.778
JPEA	210.175
JPM	10.172.641
MARLY	-
MINEROS	102.960
MOAT	805.216
NU	27.555.544
NUTRESA	13.614
OCCIDENTE	172
PARAUCOCO	1.663.745
PAZRIO	148.789
PEI	21.578
PFAVAL	3.098.031
PFAVH	-
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.752.704
PFCARPAK	16
PFCEMARGOS	36.602



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFCORFICOL	4.555
PFDVVVND	78.385
PFE	25.438.154
PFGRUPOARG	39.927
PFGRUPSURA	44.066
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	-
PROMIGAS	28.686
PROTECCION	-
RBOT	104.189
SDGEB	-
SDHA	114.267
SDIA	723.457
SQMBCO	4.942
SUAS	205.753
TERPEL	5.719
TITAN	67
UBER	25.231.428
VALSIMESA	-
VILLAS	272
LQDA	3.715
CBU7	23.729
IJPA	52.678
IWVL	106.690
COPECCO	742.321
BRKB	3.155.679



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
VOO	3.705.249
GEHC	3.211.719
VALINDUSTR	779
FB	25.671.435

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías