



Boletín informativo

No.047 / 13 de octubre 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 18 de octubre de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.490.000.000	206.585
CELSIA	300.000.000	119.880
CEMARGOS	3.590.000.000	1.000.759
CNEC	220.000.000	6.291
CORFICOLCF	770.000.000	58.904
ECOPETROL	95.640.000.000	40.998.200
GEB	1.150.000.000	666.092
GRUPOARGOS	2.870.000.000	336.115
GRUPOSURA	760.000.000	23.948
ISA	4.640.000.000	294.029
NUTRESA	690.000.000	13.719
PFAVAL	1.870.000.000	3.749.365
PFBCOLOM	44.310.000.000	1.586.735
PFDVVNDA	2.410.000.000	143.350
PFGRUPSURA	1.190.000.000	101.023



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
HCOLSEL	630.000.000	54.437
ICOLCAP	2.870.000.000	244.662
PFCEMARGOS	270.000.000	100.243
PFGRUPOARG	300.000.000	50.373

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 18 de octubre de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	56.342.437
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	52.182.240
BAC	1.000.000.000.000	40.206.038
BBVACOL	10.000.000	20.346
BCOLOMBIA	6.490.000.000	206.585
BHI	160.000.000	737.187
BMC	10.000.000	16
BOGOTA	340.000.000	12.889
BRKB	1.000.000.000.000	2.942.369
BSANTANDCO	31.650.000.000	160.080.855
BVC	30.000.000	2.417
C	1.000.000.000.000	16.047.348
CAPCO	6.600.000.000	227.209
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	12.860.000.000	22.856
CBU7	11.070.000.000	21.616



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CELSIA	300.000.000	119.880
CEMA	6.000.000.000	9.524
CEMARGOS	3.590.000.000	1.000.759
CENCOSUDCO	32.540.000.000	3.905.768
CEUU	1.300.000.000	42.998
CFMITNIPCO	1.780.000.000	115.106
CHILECO	35.930.000.000	83.181.054
CLH	-	-
CNEC	220.000.000	6.291
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	10.000.000	42
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	80.000.000	287.758
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	19.360.000.000	653.241
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	770.000.000	58.904
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	84.290.000.000	44.729
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	95.640.000.000	40.998.200
EIMI	42.800.000.000	344.254
ELCONDOR	10.000.000	1.191



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ELECTULUA	-	-
EMCA	3.510.000.000	156.366
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	17.300.000.000	34.833.678
ENELCHILCO	31.280.000.000	113.889.103
ENKA	10.000.000	177.224
EQAC	3.280.000.000	3.133
ESTRA	-	-
ETB	20.000.000	195.644
EXITO	790.000.000	280.188
F	1.000.000.000.000	49.253.817
FABRICATO	10.000.000	120.056
FALABELLCO	34.860.000.000	3.446.405
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	22.495.347
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	6.950.000.000	303.752
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	4.271.070
GEB	1.150.000.000	666.092
GEHC	867.610.000.000	2.956.766
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	180.000.000	2.976
GRUPOARGOS	2.870.000.000	336.115
GRUPOAVAL	20.000.000	29.874
GRUPOIMSA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	760.000.000	23.948
HCOLSEL	220.000.000	18.630
IAUP	980.000.000	18.691
IB01	40.580.000.000	94.401
IBTA	14.930.000.000	700.940
ICHN	1.570.000.000	88.782
ICOLCAP	3.020.000.000	267.641
IDSE	1.670.000.000	3.772
IDTP	9.440.000.000	10.171
IHYA	6.310.000.000	262.272
IJPA	8.180.000.000	41.610
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	780.000.000	8.259
INVENSA	-	-
ISA	4.640.000.000	294.029
ISAC	35.160.000.000	122.902
IUES	4.950.000.000	144.205
IUFS	3.700.000.000	93.295
IUHC	4.790.000.000	115.172
IUIT	10.090.000.000	112.252
IWVL	15.880.000.000	102.375
JNJ	1.000.000.000.000	19.643.692
JPEA	6.080.000.000	297.978
JPM	1.000.000.000.000	9.007.795
LLP	-	-
LQDA	15.480.000.000	705.656



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	180.000.000	92.798
MOAT	265.740.000.000	823.750
MVOL	5.720.000.000	24.502
NU	704.710.000.000	23.434.977
NUTRESA	690.000.000	13.719
OCCIDENTE	10.000.000	39
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	9.080.000.000	1.427.268
PAZRIO	10.000.000	133.905
PEI	780.000.000	18.011
PFAVAL	1.870.000.000	3.749.365
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	10.000.000	281
PFBCOLOM	44.310.000.000	1.586.735
PFCARPAK	10.000.000	16
PFCEMARGOS	270.000.000	100.243
PFCORFICOL	50.000.000	4.033
PFDVVNDA	2.410.000.000	143.350
PFE	1.000.000.000.000	23.823.878
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	300.000.000	50.373
PFGRUPSURA	1.190.000.000	101.023
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	1.564
PROMIGAS	50.000.000	10.157
PROTECCION	10.000.000	1
RBOT	3.610.000.000	76.944
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	1.970.000.000	82.612
SDIA	13.290.000.000	600.475
SGLD	13.780.000.000	18.239
SPMV	6.540.000.000	20.382
SPXS	27.870.000.000	7.942
SQMBCO	850.000.000	3.419
SUAS	10.830.000.000	201.834
TERPEL	140.000.000	19.672
TGLSC	-	-
TITAN	10.000.000	7
UBER	1.000.000.000.000	19.397.050
VALINDUSTR	10.000.000	779
VALSIMESA	10.000.000	9
VILLAS	10.000.000	13
VOO	1.000.000.000.000	3.894.002



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 18 de octubre de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	56.342.437
AGROCHAL	-
AMZN	52.182.240
BAC	40.206.038
BBVACOL	20.346
BCOLOMBIA	206.585
BHI	737.187
BMC	16
BOGOTA	12.889
BRKB	2.942.369
BSANTANDCO	160.080.855
BVC	2.417
C	16.047.348
CAPCO	227.209
CARACOLTV	-
CARTON	-
CBU0	22.856
CBU7	21.616
CELSIA	119.880
CEMA	9.524
CEMARGOS	1.000.759
CENCOSUDCO	3.905.768
CEUU	42.998
CFMITNIPCO	115.106



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CHILECO	83.181.054
CLH	-
CNEC	6.291
COLOMBINA	-
COLTEJER	42
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	287.758
COOMEVAEPS	-
COPECCO	653.241
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	58.904
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
CSPX	44.729
DESCAUCANO	-
DPCSACOL	-
DPELECTULU	-
ECOPETROL	40.998.200
EIMI	344.254
ELCONDOR	1.191
ELECTULUA	-
EMCA	156.366
EMPAQUES	-
ENELAMCO	34.833.678
ENELCHILCO	113.889.103
ENKA	177.224
EQAC	3.133



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ESTRA	-
ETB	195.644
EXITO	280.188
F	49.253.817
FABRICATO	120.056
FALABELLCO	3.446.405
FAMILIA	-
FB	22.495.347
FGNTOLIMA	-
FLOA	303.752
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	4.271.070
GEB	666.092
GEHC	2.956.766
GIBRALTAR	-
GRUBOLIVAR	2.976
GRUPOARGOS	336.115
GRUPOAVAL	29.874
GRUPOIMSA	-
GRUPOSURA	23.948
HCOLSEL	18.630
IAUP	18.691
IB01	94.401
IBTA	700.940
ICHN	88.782
ICOLCAP	267.641
IDSE	3.772



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IDTP	10.171
IHYA	262.272
IJPA	41.610
INCASTILLA	-
INESA	-
INRA	8.259
INVENSA	-
ISA	294.029
ISAC	122.902
IUES	144.205
IUFS	93.295
IUHC	115.172
IUIT	112.252
IWVL	102.375
JNJ	19.643.692
JPEA	297.978
JPM	9.007.795
LLP	-
LQDA	705.656
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	92.798
MOAT	823.750
MVOL	24.502
NU	23.434.977
NUTRESA	13.719
OCCIDENTE	39



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
ORBIS	-
PARAUCOCO	1.427.268
PAZRIO	133.905
PEI	18.011
PFAVAL	3.749.365
PFAVH	-
PFBBVACOL	281
PFBCOLOM	1.586.735
PFCARPAK	16
PFCEMARGOS	100.243
PFCORFICOL	4.033
PFDVVNDA	143.350
PFE	23.823.878
PFGBOLIVAR	-
PFGRUPOARG	50.373
PFGRUPSURA	101.023
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	-
PFVILLAS00	-
PFVILLAS01	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	1.564
PROMIGAS	10.157
PROTECCION	1
RBOT	76.944
RCNTELEVI	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
SDGEB	-
SDHA	82.612
SDIA	600.475
SGLD	18.239
SPMV	20.382
SPXS	7.942
SQMBCO	3.419
SUAS	201.834
TERPEL	19.672
TGLSC	-
TITAN	7
UBER	19.397.050
VALINDUSTR	779
VALSIMESA	9
VILLAS	13
VOO	3.894.002

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías