



## No.097 / 13 de diciembre de 2022

**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](mailto: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)
Hasta un 100%	3
Hasta un 200%	4
Mayor a un 300%	5

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:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de incremento en la Garantía por Posición.
Entre un 100% y 150%	3	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%



## Boletín informativo

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 desde el 14 de diciembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
BCOLOMBIA	5.450.000.000	146.364
CELSIA	400.000.000	134.527
CEMARGOS	940.000.000	254.903
CNEC	700.000.000	96.211
CORFICOLCF	1.120.000.000	68.938
ECOPETROL	125.770.000.000	54.094.699
GEB	1.470.000.000	786.747
GRUPOARGOS	1.350.000.000	131.256
GRUPOSURA	3.140.000.000	82.770
ISA	4.940.000.000	270.981
NUTRESA	1.020.000.000	22.459
PFAVAL	3.930.000.000	6.877.543
PFBCOLOM	49.610.000.000	1.616.413
PFDVVNDA	2.180.000.000	76.528
HCOLSEL	590.000.000	49.282
ICOLCAP	2.220.000.000	180.629



## Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de diciembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	86.737.198
AMZN	1.000.000.000.000	72.868.713
BAC	1.000.000.000.000	39.925.075
BBVACOL	10.000.000	18.595
BCOLOMBIA	5.450.000.000	146.364
BHI	200.000.000	819.992
BMC	-	-
BOGOTA	300.000.000	9.583
BSANTANDCO	18.490.000.000	105.450.453
BVC	60.000.000	6.888
C	1.000.000.000.000	17.914.524
CAPCO	8.220.000.000	257.116
CELSIA	400.000.000	134.527
CEMARGOS	940.000.000	254.903
CENCOSUDCO	26.310.000.000	4.024.577
CFMITNIPCO	4.470.000.000	301.296
CHILECO	43.120.000.000	98.832.714
CLH	160.000.000	36.213
CNEC	700.000.000	96.211
COLTEJER	10.000.000	0
CONCRET	50.000.000	205.572
COPECCO	20.840.000.000	631.733
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.120.000.000	68.938



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	-	-
CSPX	96.410.000.000	52.220
ECOPETROL	125.770.000.000	54.094.699
EIMI	35.160.000.000	274.019
ELCONDOR	140.000.000	102.670
EMCA	10.000.000	7
ENELAMCO	38.560.000.000	71.365.215
ENELCHILCO	16.030.000.000	93.394.173
ENKA	40.000.000	1.448.565
ETB	20.000.000	120.879
EXITO	490.000.000	47.453
F	10.000.000	61
FABRICATO	10.000.000	871.146
FALABELLCO	34.760.000.000	3.728.128
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	5.892.927
GEB	1.470.000.000	786.747
GRUBOLIVAR	410.000.000	7.215
GRUPOARGOS	1.350.000.000	131.256
GRUPOAVAL	30.000.000	50.609
GRUPOSURA	3.140.000.000	82.770
HCOLSEL	590.000.000	49.282
IB01	36.700.000.000	76.053
ICHN	10.000.000	316
ICOLCAP	2.220.000.000	180.629
IDSE	330.000.000	718
INRA	10.000.000	0
ISA	4.940.000.000	270.981
ISAC	31.860.000.000	113.408
IUES	10.000.000	8
IUFS	5.720.000.000	134.706



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
IUHC	10.000.000	31
IUIT	6.710.000.000	89.436
JNJ	1.000.000.000.000	6.817.153
JPEA	6.220.000.000	279.498
JPM	1.000.000.000.000	12.051.734
MARLY	-	-
MINEROS	120.000.000	67.997
MOAT US	152.490.000.000	509.767
NU	639.840.000.000	29.098.694
NUTRESA	1.020.000.000	22.459
OCCIDENTE	10.000.000	2
PARAUCOCO	5.490.000.000	1.157.835
PAZRIO	10.000.000	120.999
PEI	380.000.000	10.184
PFAVAL	3.930.000.000	6.877.543
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	10.000.000	146
PFBCOLOM	49.610.000.000	1.616.413
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	90.000.000	34.609
PFCORFICOL	120.000.000	8.304
PFDVVNDA	2.180.000.000	76.528
PFE	1.000.000.000.000	19.441.576
PFGRUPOARG	220.000.000	35.852
PFGRUPSURA	600.000.000	44.637
PVVILLAS	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	781
PROMIGAS	100.000.000	20.760



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PROTECCION	-	-
RBOT	10.000.000	34
SDGEB	140.000.000	79.353
SDHA	2.650.000.000	99.251
SDIA	10.000.000	151
SQMBCO	850.000.000	2.131
SUAS	25.330.000.000	470.607
TERPEL	120.000.000	14.238
TITAN	10.000.000	39
UBER	10.000.000	23
VALSIMESA	10.000.000	88
VILLAS	10.000.000	673
LQDA	9.930.000.000	350.000
CBU7	11.930.000.000	18.000

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de diciembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	88.172.988
AMZN	70.003.367
Nemotécnico	VMD acciones
BAC	39.644.580
BBVACOL	14.770
BCOLOMBIA	132.522
BHI	609.839
BMC	-
BOGOTA	6.325
BSANTANDCO	137.793.927



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
BVC	7.902
C	17.712.754
CAPCO	258.617
CELSIA	124.057
CEMARGOS	224.296
CENCOSUDCO	4.841.084
CFMITNIPCO	477.608
CHILECO	138.595.378
CLH	38.757
CNEC	65.556
COLTEJER	3
CONCRET	190.973
COPECCO	782.973
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	71.009
CREDIFAMI	-
CSPX	52.095
ECOPETROL	39.271.738
EIMI	269.419
ELCONDOR	118.477
EMCA	-
ENELAMCO	63.546.492
ENELCHILCO	116.338.212
ENKA	1.591.152
ETB	97.217
EXITO	50.375
F	55
FABRICATO	755.799
FALABELLCO	4.043.563
FAMILIA	-



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
GE	6.009.205
GEB	705.432
GRUBOLIVAR	5.729
GRUPOARGOS	125.880
GRUPOAVAL	39.913
GRUPOSURA	35.378
HCOLSEL	67.243
IB01	72.620
ICHN	-
ICOLCAP	188.568
IDSE	599
INRA	-
ISA	242.846
ISAC	120.081
IUES	-
IUFS	150.708
IUHC	-
IUIT	81.217
JNJ	6.936.973
JPEA	232.891
JPM	12.299.826
MARLY	-
MINEROS	65.492
MOAT US	540.304
NU	30.143.047
NUTRESA	21.237
OCCIDENTE	3
PARAUCOCO	1.485.807
PAZRIO	118.900
PEI	6.405
PFAVAL	4.599.180





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFAVH	-
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.524.279
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	33.705
PFCORFICOL	6.846
PFDAVVNDA	90.724
PFE	19.382.657
PFGRUPOARG	27.560
PFGRUPSURA	41.759
PFVILLAS	-
PFVILLASCA	-
POPULAR	781
PROMIGAS	20.819
PROTECCION	-
RBOT	-
SDGEB	94.003
SDHA	114.084
SDIA	-
SQMBCO	3.087
SUAS	439.936
TERPEL	17.477
TITAN	39
UBER	23
VALSIMESA	13
VILLAS	715
LQDA	350.000
CBU7	18.000



## Boletín informativo

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgo y Metodologías