



Boletín informativo

No.005 / 12 de enero 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 16 de enero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.190.000.000	180.430
CELSIA	330.000.000	112.933
CEMARGOS	690.000.000	192.127
CNEC	640.000.000	88.272
CORFICOLCF	1.090.000.000	68.349
ECOPETROL	148.270.000.000	63.307.807
GEB	980.000.000	547.300
GRUPOARGOS	1.150.000.000	114.738
GRUPOSURA	2.680.000.000	69.624
ISA	5.880.000.000	308.192
NUTRESA	750.000.000	14.880
PFAVAL	3.680.000.000	6.682.170
PFBCOLOM	49.600.000.000	1.582.824
PFDVVNDA	1.910.000.000	68.629
PFGRUPSURA	580.000.000	43.729
ICOLCAP	2.310.000.000	186.137



Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 16 de enero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	80.367.829
AMZN	1.000.000.000.000	76.786.826
BAC	1.000.000.000.000	38.275.771
BBVACOL	10.000.000	13.621
BCOLOMBIA	7.190.000.000	180.430
BHI	230.000.000	906.827
BMC	-	-
BOGOTA	280.000.000	8.756
BSANTANDCO	21.100.000.000	116.666.470
BVC	50.000.000	6.584
C	1.000.000.000.000	17.124.285
CAPCO	8.620.000.000	260.339
CELSIA	330.000.000	112.933
CEMARGOS	690.000.000	192.127
CENCOSUDCO	27.620.000.000	3.999.644
CFMITNIPCO	2.920.000.000	191.451
CHILECO	41.020.000.000	89.740.961
CLH	150.000.000	33.239
CNEC	640.000.000	88.272
COLTEJER	10.000.000	5
CONCONCRET	60.000.000	225.818
COPECCO	19.130.000.000	573.783
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.090.000.000	68.349



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CREDIFAMI	-	-
CSPX	96.800.000.000	51.115
ECOPETROL	148.270.000.000	63.307.807
EIMI	43.540.000.000	325.569
ELCONDOR	110.000.000	75.263
EMCA	3.320.000.000	132.913
ENELAMCO	37.140.000.000	65.921.336
ENELCHILCO	14.730.000.000	77.387.021
ENKA	30.000.000	988.238
ETB	20.000.000	116.064
EXITO	60.000.000	9.985
F	1.000.000.000.000	54.495.742
FABRICATO	10.000.000	1.031.859
FALABELLCO	34.100.000.000	3.829.208
FAMILIA	-	-
GE	1.000.000.000.000	5.889.647
GEB	980.000.000	547.300
GRUBOLIVAR	430.000.000	7.186
GRUPOARGOS	1.150.000.000	114.738
GRUPOAVAL	30.000.000	54.239
GRUPOSURA	2.680.000.000	69.624
HCOLSEL	340.000.000	28.403
IB01	40.730.000.000	82.296
ICHN	2.230.000.000	112.101
ICOLCAP	2.310.000.000	186.137
IDSE	310.000.000	657
INRA	1.170.000.000	8.154
ISA	5.880.000.000	308.192



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISAC	36.090.000.000	122.687
IUES	6.950.000.000	17.661
IUFS	5.030.000.000	109.960
IUHC	14.210.000.000	283.956
IUIT	6.670.000.000	87.178
JNJ	1.000.000.000.000	6.219.838
JPEA	6.920.000.000	302.254
JPM	1.000.000.000.000	11.128.964
MARLY	-	-
MINEROS	120.000.000	67.411
MOAT	146.280.000.000	472.221
NU	574.180.000.000	27.161.976
NUTRESA	750.000.000	14.880
OCCIDENTE	10.000.000	5
PARAUCOCO	6.830.000.000	1.353.685
PAZRIO	10.000.000	85.137
PEI	390.000.000	10.501
PFAVAL	3.680.000.000	6.682.170
PFAVH	-	-
PFBVACOL	10.000.000	146
PFBLOM	49.600.000.000	1.582.824
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	90.000.000	34.483
PFCORFICOL	90.000.000	6.785
PFDVVNDA	1.910.000.000	68.629
PFE	1.000.000.000.000	19.892.517
PFGUPOARG	210.000.000	33.793



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFGRUPSURA	580.000.000	43.729
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	10.000.000	841
PROMIGAS	80.000.000	17.352
PROTECCION	-	-
RBOT	5.330.000.000	117.982
SDGEB	90.000.000	51.047
SDHA	3.010.000.000	109.949
SDIA	19.630.000.000	766.260
SQMBCO	690.000.000	1.769
SUAS	26.080.000.000	473.396
TERPEL	110.000.000	12.582
TITAN	-	-
UBER	1.000.000.000.000	22.672.185
VALSIMESA	10000000	82,8125
VILLAS	10.000.000	687
LQDA	-	-
CBU7	-	-
IJPA	19.300.000.000	94.777
IWVL	13.000.000.000	81.956

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 16 de enero de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	80.367.829
AMZN	76.786.826
BAC	38.275.771
BBVACOL	13.621
BCOLOMBIA	180.430
BHI	906.827
BMC	-
BOGOTA	8.756
BSANTANDCO	116.666.470
BVC	6.584
C	17.124.285
CAPCO	260.339
CELSIA	112.933
CEMARGOS	192.127
CENCOSUDCO	3.999.644
CFMITNIPCO	191.451
CHILECO	89.740.961
CLH	33.239
CNEC	88.272
COLTEJER	5
CONCONCRET	225.818
COPECCO	573.783
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	68.349
CREDIFAMI	-
CSPX	51.115
ECOPETROL	63.307.807



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
EIMI	325.569
ELCONDOR	75.263
EMCA	132.913
ENELAMCO	65.921.336
ENELCHILCO	77.387.021
ENKA	988.238
ETB	116.064
EXITO	9.985
F	54.495.742
FABRICATO	1.031.859
FALABELLCO	3.829.208
FAMILIA	-
GE	5.889.647
GEB	547.300
GRUBOLIVAR	7.186
GRUPOARGOS	114.738
GRUPOAVAL	54.239
GRUPOSURA	69.624
HCOLSEL	28.403
IB01	82.296
ICHN	112.101
ICOLCAP	186.137
IDSE	657
INRA	8.154
ISA	308.192
ISAC	122.687
IUES	17.661
IUFS	109.960



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
IUHC	283.956
IUIT	87.178
JNJ	6.219.838
JPEA	302.254
JPM	11.128.964
MARLY	-
MINEROS	67.411
MOAT	472.221
NU	27.161.976
NUTRESA	14.880
OCCIDENTE	5
PARAUCOCO	1.353.685
PAZRIO	85.137
PEI	10.501
PFAVAL	6.682.170
PFAVH	-
PFBBVACOL	146
PFBCOLOM	1.582.824
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	34.483
PFCORFICOL	6.785
PFDVVNDA	68.629
PFE	19.892.517
PFGRUPOARG	33.793
PFGRUPSURA	43.729
PVVILLAS	-
PVVILLASCA	-
POPULAR	841



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PROMIGAS	17.352
PROTECCION	-
RBOT	117.982
SDGEB	51.047
SDHA	109.949
SDIA	766.260
SQMBCO	1.769
SUAS	473.396
TERPEL	12.582
TITAN	-
UBER	22.672.185
VALSIMESA	83
VILLAS	687
LQDA	0
CBU7	0
IJPA	94.776
IWVL	81.956

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías