



## Boletín informativo

### No.001 / 02 de enero de 2024

**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:

<b>% Sobre el Volumen Medio Diario</b>	<b>Horizonte de Tiempo (días)</b>
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

<b>% Sobre el Volumen Medio Diario</b>	<b>Horizonte de Tiempo (días)</b>	<b>% de Incremento en la Garantía por Posición</b>
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 03 de enero de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
BCOLOMBIA	106,873	3,320,000,000
CEMARGOS	798,927	4,200,000,000
CORFICOLCF	37,223	470,000,000
ECOPETROL	51,789,743	125,940,000,000
GEB	490,462	870,000,000
GRUPOARGOS	253,883	2,540,000,000
HCOLSEL	41,275	470,000,000
ICOLCAP	320,313	3,660,000,000
ISA	277,709	4,180,000,000
NUTRESA	13,291	650,000,000
PFAVAL	1,935,020	920,000,000
PFBCOLOM	1,338,735	37,010,000,000
PFDAVVNDA	75,552	1,220,000,000
PFGRUPSURA	59,813	730,000,000



## Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 03 de enero de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	52,586,978	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	51,244,148	1,000,000,000,000
BAC	46,524,338	1,000,000,000,000
BBVACOL	5,105	10,000,000
BCOLOMBIA	106,873	3,320,000,000
BHI	876,888	190,000,000
BMC	174	10,000,000
BOGOTA	4,003	110,000,000
BRKB	3,156,446	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	162,884,888	30,970,000,000
BVC	4,985	60,000,000
C	18,024,340	1,000,000,000,000
CAPCO	230,254	6,160,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	32,002	17,820,000,000
CBU7	40,368	20,760,000,000
CELSIA	257,699	670,000,000
CEMA	5,756	3,530,000,000
CEMARGOS	798,927	4,200,000,000
CENCOSUDCO	4,186,917	30,050,000,000
CEUU	216,014	6,630,000,000
CFMITNIPCO	100,648	1,410,000,000
CHILECO	67,825,027	29,550,000,000
CLH	-	-
CNEC	13,479	320,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	690	10,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	136,887	40,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	548,491	15,940,000,000
CORFERIAS	-	0
CORFICOLCF	37,223	470,000,000
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	56,311	107,300,000,000
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	51,789,743	125,940,000,000
EIMI	259,255	31,700,000,000
ELCONDOR	5,562	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	148,150	3,350,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	30,657,819	13,730,000,000
ENELCHILCO	69,408,639	17,390,000,000
ENKA	208,804	10,000,000
EQAC	4,845	5,200,000,000
ESTRA	-	-
ETB	107,233	10,000,000
EXITO	398,577	1,260,000,000
F	53,429,396	1,000,000,000,000
FABRICATO	102,239	10,000,000
FALABELLCO	2,243,444	20,620,000,000
FAMILIA	-	-
FB	19,098,743	1,000,000,000,000



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	428,300	10,000,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	4,648,070	1,000,000,000,000
GEB	490,462	870,000,000
GEHC	2,679,993	757,150,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	1,674	90,000,000
GRUPOARGOS	253,883	2,540,000,000
GRUPOAVAL	36,705	20,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	11,793	370,000,000
HCOLSEL	41,275	470,000,000
IAUP	25,654	1,350,000,000
IBTA	1,133,069	24,760,000,000
IB01	125,208	54,580,000,000
ICHN	97,718	1,580,000,000
ICOLCAP	320,313	3,660,000,000
IDSE	3,382	1,490,000,000
IDTP	11,540	10,670,000,000
IHYA	425,160	10,430,000,000
IJPA	72,948	14,370,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	11,441	950,000,000
INVENSA	-	-
ISA	277,709	4,180,000,000
ISAC	123,948	35,560,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
IUES	163,368	5,590,000,000
IUFS	87,802	3,540,000,000
IUHC	148,359	6,120,000,000
IUIT	182,209	17,060,000,000
IWVL	41,444	6,440,000,000
JNJ	6,878,167	1,000,000,000,000
JPEA	330,080	6,770,000,000
JPM	9,254,499	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	878,622	19,320,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	116,899	210,000,000
MOAT	1,079,952	340,750,000,000
MVOL	29,080	6,710,000,000
NU	24,922,059	815,760,000,000
NUAMCO	6,539	140,000,000
NUTRESA	13,291	650,000,000
OCCIDENTE	50	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	729,923	4,280,000,000
PAZRIO	22,568	10,000,000
PEI	13,660	780,000,000
PFAVAL	1,935,020	920,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	223	10,000,000
PFBCOLOM	1,338,735	37,010,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	89,952	350,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFCORFICOL	5,043	60,000,000
PFDAVVNDA	75,552	1,220,000,000
PFE	37,836,857	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	0
PFGRUPOARG	37,249	270,000,000
PFGRUPSURA	59,813	730,000,000
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
POPULAR	1,495	10,000,000
PORT	-	-
PROMIGAS	13,836	60,000,000
PROTECCION	2	10,000,000
RBOT	90,049	4,150,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	113,597	2,750,000,000
SDIA	661,515	14,910,000,000
SGLD	18,947	14,680,000,000
SPMV	13,170	4,190,000,000
SPXS	5,836	20,610,000,000
SQMBCO	2,734	550,000,000
SUAS	269,676	14,460,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
TERPEL	8,543	60,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	10	10,000,000
UBER	28,626,408	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	120	10,000,000
VOO	4,730,650	1,000,000,000,000

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 03 de enero de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	52,586,978	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	51,244,148	1,000,000,000,000
BAC	46,524,338	1,000,000,000,000
BBVACOL	5,105	10,000,000
BCOLOMBIA	106,873	3,320,000,000
BHI	876,888	190,000,000
BMC	174	10,000,000
BOGOTA	4,003	110,000,000
BRKB	3,156,446	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	162,884,888	30,970,000,000
BVC	4,985	60,000,000
C	18,024,340	1,000,000,000,000
CAPCO	230,254	6,160,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBUO	32,002	17,820,000,000





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CBU7	40,368	20,760,000,000
CELSIA	257,699	670,000,000
CEMA	5,756	3,530,000,000
CEMARGOS	798,927	4,200,000,000
CENCOSUDCO	4,186,917	30,050,000,000
CEUU	216,014	6,630,000,000
CFMITNIPCO	100,648	1,410,000,000
CHILECO	67,825,027	29,550,000,000
CLH	-	-
CNEC	13,479	320,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	690	10,000,000
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	136,887	40,000,000
COOMEVAEPS	-	0
COPECCO	548,491	15,940,000,000
CORFERIAS	-	0
CORFICOLCF	37,223	470,000,000
CREDIFAMI	-	0
CSACOL	-	0
CSPX	56,311	107,300,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	51,789,743	125,940,000,000
EIMI	259,255	31,700,000,000
ELCONDOR	5,562	10,000,000
ELECTULUA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
EMCA	148,150	3,350,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	30,657,819	13,730,000,000
ENELCHILCO	69,408,639	17,390,000,000
ENKA	208,804	10,000,000
EQAC	4,845	5,200,000,000
ESTRA	-	-
ETB	107,233	10,000,000
EXITO	398,577	1,260,000,000
F	53,429,396	1,000,000,000,000
FABRICATO	102,239	10,000,000
FALABELLCO	2,243,444	20,620,000,000
FAMILIA	-	-
FB	19,098,743	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	428,300	10,000,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	4,648,070	1,000,000,000,000
GEB	490,462	870,000,000
GEHC	2,679,993	757,150,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	1,674	90,000,000
GRUPOARGOS	253,883	2,540,000,000
GRUPOAVAL	36,705	20,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	11,793	370,000,000
HCOLSEL	41,275	470,000,000
IAUP	25,654	1,350,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
IBTA	1,133,069	24,760,000,000
IB01	125,208	54,580,000,000
ICHN	97,718	1,580,000,000
ICOLCAP	320,313	3,660,000,000
IDSE	3,382	1,490,000,000
IDTP	11,540	10,670,000,000
IHYA	425,160	10,430,000,000
IJPA	72,948	14,370,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	11,441	950,000,000
INVENSA	-	-
ISA	277,709	4,180,000,000
ISAC	123,948	35,560,000,000
IUES	163,368	5,590,000,000
IUFS	87,802	3,540,000,000
IUHC	148,359	6,120,000,000
IUIT	182,209	17,060,000,000
IWVL	41,444	6,440,000,000
JNJ	6,878,167	1,000,000,000,000
JPEA	330,080	6,770,000,000
JPM	9,254,499	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	878,622	19,320,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	116,899	210,000,000
MOAT	1,079,952	340,750,000,000
MVOL	29,080	6,710,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
NU	24,922,059	815,760,000,000
NUAMCO	6,539	140,000,000
NUTRESA	13,291	650,000,000
OCCIDENTE	50	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	729,923	4,280,000,000
PAZRIO	22,568	10,000,000
PEI	13,660	780,000,000
PFAVAL	1,935,020	920,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	223	10,000,000
PFBCOLOM	1,338,735	37,010,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	89,952	350,000,000
PFCORFICOL	5,043	60,000,000
PFDAVVNDA	75,552	1,220,000,000
PFE	37,836,857	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	37,249	270,000,000
PFGRUPSURA	59,813	730,000,000
PFVILLAS	-	-
PFVILLASCA	-	-
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
POPULAR	1,495	10,000,000
PORT	-	-
PROMIGAS	13,836	60,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PROTECCION	2	10,000,000
RBOT	90,049	4,150,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	113,597	2,750,000,000
SDIA	661,515	14,910,000,000
SGLD	18,947	14,680,000,000
SPMV	13,170	4,190,000,000
SPXS	5,836	20,610,000,000
SQMBCO	2,734	550,000,000
SUAS	269,676	14,460,000,000
TERPEL	8,543	60,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	10	10,000,000
UBER	28,626,408	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	120	10,000,000
VOO	4,730,650	1,000,000,000,000

José Manuel Suárez Jiménez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías