



Boletín informativo

No 8 / 26 de febrero 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.

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 1 de marzo de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
BCOLOMBIA	162,600	5,280,000,000
CEMARGOS	587,412	3,580,000,000
CORFICOLCF	37,527	540,000,000
ECOPETROL	41,561,514	99,520,000,000
GEB	761,705	1,600,000,000
GRUPOARGOS	231,929	2,770,000,000
HCOLSEL	91,743	1,160,000,000
ICOLCAP	346,374	4,250,000,000
ISA	340,598	5,500,000,000
NUTRESA	8,632	400,000,000
PFAVAL	2,739,910	1,340,000,000
PFBCOLOM	1,533,792	46,360,000,000
PFDVVNDA	99,526	1,910,000,000
PFGRUPSURA	99,622	1,550,000,000



Boletín informativo

Los Volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 1 de marzo de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	50,854,249	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	46,460,569	1,000,000,000,000
BAC	40,297,157	1,000,000,000,000
BBVACOL	11,940	10,000,000
BCOLOMBIA	162,600	5,280,000,000
BHI	723,044	170,000,000
BMC	-	-
BOGOTA	5,524	160,000,000
BRKB	3,203,341	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	137,270,120	26,310,000,000
BVC	2,829	40,000,000
C	17,571,374	1,000,000,000,000
CAPCO	276,377	8,180,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	25,669	14,300,000,000
CBU7	37,473	19,170,000,000
CELSIA	369,910	1,110,000,000
CEMA	6,947	4,240,000,000
CEMARGOS	587,412	3,580,000,000
CENCOSUDCO	2,825,567	20,220,000,000
CEUU	106,116	3,330,000,000
CFMITNIPCO	93,369	1,300,000,000
CHILECO	97,956,685	43,640,000,000
CLH	-	-
CNEC	13,460	250,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	751	10,000,000
COLTEL	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CONCIVILES	-	-
CONCRET	371,830	110,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	497,751	13,630,000,000
CORFERIAS	105	10,000,000
CORFICOLCF	37,527	540,000,000
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	50,406	99,370,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	41,561,514	99,520,000,000
EIMI	239,865	29,170,000,000
ELCONDOR	696	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	185,045	4,200,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	32,857,273	14,020,000,000
ENELCHILCO	70,318,813	17,130,000,000
ENKA	3,315,481	60,000,000
EQAC	6,278	7,170,000,000
ESTRA	-	-
ETB	197,218	20,000,000
EXITO	285,706	960,000,000
F	52,849,641	1,000,000,000,000
FABRICATO	775,889	10,000,000
FALABELLCO	1,808,127	17,160,000,000
FAMILIA	-	-
FB	17,918,407	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	344,246	7,850,000,000
GASNATURAL	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
GASORIENTE	-	-
GE	4,555,128	1,000,000,000,000
GEB	761,705	1,600,000,000
GEB_DEB	-	-
GEHC	2,940,936	892,310,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	1,522	90,000,000
GRUPOARGOS	231,929	2,770,000,000
GRUPOAVAL	39,283	20,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	14,216	440,000,000
HCOLSEL	91,743	1,160,000,000
IAUP	26,271	1,340,000,000
IB01	118,049	50,500,000,000
IBTA	962,337	20,450,000,000
ICHN	270,486	3,920,000,000
ICOLCAP	346,374	4,250,000,000
IDSE	386	190,000,000
IDTP	10,187	9,340,000,000
IHYA	481,842	11,870,000,000
IJPA	60,811	12,180,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	14,690	1,210,000,000
INVENSA	-	-
INVERS	-	-
ISA	340,598	5,500,000,000
ISAC	121,188	35,750,000,000
IUES	141,076	4,600,000,000
IUFS	88,096	3,750,000,000
IUHC	131,480	5,550,000,000
IUIT	221,492	21,910,000,000
IWVL	44,776	7,060,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
JNJ	6,930,956	1,000,000,000,000
JPEA	344,871	7,190,000,000
JPM	8,856,793	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	814,775	18,260,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	150,853	290,000,000
MOAT	1,075,859	353,650,000,000
MVOL	32,287	7,640,000,000
NU	27,767,568	990,330,000,000
NUAMCO	8,613	180,000,000
NUTRESA	8,632	400,000,000
OCCIDENTE	130	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	826,363	5,120,000,000
PAZRIO	84,835	10,000,000
PEI	13,731	850,000,000
PFAVAL	2,739,910	1,340,000,000
PFAVH	-	-
PFBVACOL	258	10,000,000
PFBLOM	1,533,792	46,360,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	101,975	510,000,000
PFCORFICOL	7,801	100,000,000
PFDVVNDA	99,526	1,910,000,000
PFE	44,429,281	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	54,871	520,000,000
PFGRUPSURA	99,622	1,550,000,000
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	766	10,000,000
PORT	165,323	1,000,000,000
PREC	-	-
PROMIGAS	21,832	110,000,000
PROTECCION	15	10,000,000
RBOT	68,268	3,450,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	102,766	2,480,000,000
SDIA	794,623	17,690,000,000
SGLD	19,804	15,240,000,000
SPMV	15,298	5,060,000,000
SPXS	7,213	26,280,000,000
SQMBCO	3,230	610,000,000
SUAS	162,571	8,980,000,000
TERPEL	9,672	80,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	14	10,000,000
UBER	30,268,764	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	295	10,000,000
VOO	4,839,382	1,000,000,000,000



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables a partir del 1 de marzo de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	50,854,249	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	46,460,569	1,000,000,000,000
BAC	40,297,157	1,000,000,000,000
BBVACOL	11,940	10,000,000
BCOLOMBIA	162,600	5,280,000,000
BHI	723,044	170,000,000
BMC	-	-
BOGOTA	5,524	160,000,000
BRKB	3,203,341	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	137,270,120	26,310,000,000
BVC	2,829	40,000,000
C	17,571,374	1,000,000,000,000
CAPCO	276,377	8,180,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	25,669	14,300,000,000
CBU7	37,473	19,170,000,000
CELSIA	369,910	1,110,000,000
CEMA	6,947	4,240,000,000
CEMARGOS	587,412	3,580,000,000
CENCOSUDCO	2,825,567	20,220,000,000
CEUU	106,116	3,330,000,000
CFMITNIPCO	93,369	1,300,000,000
CHILECO	97,956,685	43,640,000,000
CLH	-	-
CNEC	13,460	250,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	751	10,000,000
COLTEL	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CONCIVILES	-	-
CONCRET	371,830	110,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	497,751	13,630,000,000
CORFERIAS	105	10,000,000
CORFICOLCF	37,527	540,000,000
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	50,406	99,370,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	41,561,514	99,520,000,000
EIMI	239,865	29,170,000,000
ELCONDOR	696	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	185,045	4,200,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	32,857,273	14,020,000,000
ENELCHILCO	70,318,813	17,130,000,000
ENKA	3,315,481	60,000,000
EQAC	6,278	7,170,000,000
ESTRA	-	-
ETB	197,218	20,000,000
EXITO	285,706	960,000,000
F	52,849,641	1,000,000,000,000
FABRICATO	775,889	10,000,000
FALABELLCO	1,808,127	17,160,000,000
FAMILIA	-	-
FB	17,918,407	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	344,246	7,850,000,000
GASNATURAL	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
GASORIENTE	-	-
GE	4,555,128	1,000,000,000,000
GEB	761,705	1,600,000,000
GEB_DEB	-	-
GEHC	2,940,936	892,310,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	1,522	90,000,000
GRUPOARGOS	231,929	2,770,000,000
GRUPOAVAL	39,283	20,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	14,216	440,000,000
HCOLSEL	91,743	1,160,000,000
IAUP	26,271	1,340,000,000
IB01	118,049	50,500,000,000
IBTA	962,337	20,450,000,000
ICHN	270,486	3,920,000,000
ICOLCAP	346,374	4,250,000,000
IDSE	386	190,000,000
IDTP	10,187	9,340,000,000
IHYA	481,842	11,870,000,000
IJPA	60,811	12,180,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	14,690	1,210,000,000
INVENSA	-	-
INVERS	-	-
ISA	340,598	5,500,000,000
ISAC	121,188	35,750,000,000
IUES	141,076	4,600,000,000
IUFS	88,096	3,750,000,000
IUHC	131,480	5,550,000,000
IUIT	221,492	21,910,000,000
IWVL	44,776	7,060,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
JNJ	6,930,956	1,000,000,000,000
JPEA	344,871	7,190,000,000
JPM	8,856,793	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	814,775	18,260,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	150,853	290,000,000
MOAT	1,075,859	353,650,000,000
MVOL	32,287	7,640,000,000
NU	27,767,568	990,330,000,000
NUAMCO	8,613	180,000,000
NUTRESA	8,632	400,000,000
OCCIDENTE	130	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	826,363	5,120,000,000
PAZRIO	84,835	10,000,000
PEI	13,731	850,000,000
PFAVAL	2,739,910	1,340,000,000
PFAVH	-	-
PFBVACOL	258	10,000,000
PFBLOM	1,533,792	46,360,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	101,975	510,000,000
PFCORFICOL	7,801	100,000,000
PFDVVNDA	99,526	1,910,000,000
PFE	44,429,281	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	54,871	520,000,000
PFGRUPSURA	99,622	1,550,000,000
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	766	10,000,000
PORT	165,323	1,000,000,000
PREC	-	-
PROMIGAS	21,832	110,000,000
PROTECCION	15	10,000,000
RBOT	68,268	3,450,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	102,766	2,480,000,000
SDIA	794,623	17,690,000,000
SGLD	19,804	15,240,000,000
SPMV	15,298	5,060,000,000
SPXS	7,213	26,280,000,000
SQMBCO	3,230	610,000,000
SUAS	162,571	8,980,000,000
TERPEL	9,672	80,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	14	10,000,000
UBER	30,268,764	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	295	10,000,000
VOO	4,839,382	1,000,000,000,000

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías