



## Boletín informativo

### No.015 / 27 de marzo 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 1 de abril de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
BCOLOMBIA	417,819	13,500,000,000
CEMARGOS	538,691	3,760,000,000
CORFICOLCF	43,325	650,000,000
ECOPETROL	40,857,668	92,770,000,000
GEB	1,435,864	3,160,000,000
GRUPOARGOS	249,010	3,460,000,000
GXTESCOL	20,000,000	1,000,000,000,000
HCOLSEL	108,718	1,460,000,000
ICOLCAP	287,181	3,660,000,000
ISA	379,792	6,650,000,000
NUTRESA	15,445	710,000,000
PFAVAL	6,361,416	2,850,000,000
PFBCOLOM	1,592,581	50,150,000,000
PFDAVVNDA	99,645	1,990,000,000
PFGRUPSURA	128,475	2,220,000,000



## Boletín informativo

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

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	58,417,269	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	42,429,670	1,000,000,000,000
BAC	39,159,306	1,000,000,000,000
BBVACOL	15,448	10,000,000
BCOLOMBIA	417,819	13,500,000,000
BHI	610,544	150,000,000
BMC	-	-
BOGOTA	11,527	360,000,000
BRKB	3,407,633	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	100,518,982	19,060,000,000
BVC	965	10,000,000
C	16,504,976	1,000,000,000,000
CAPCO	346,845	9,940,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	22,890	12,690,000,000
CBU7	34,619	17,670,000,000
CELSIA	506,104	1,760,000,000
CEMA	8,933	5,550,000,000
CEMARGOS	538,691	3,760,000,000
CENCOSUDCO	2,792,930	19,180,000,000
CEUU	106,042	3,360,000,000
CFMITNIPCO	108,964	1,500,000,000
CHILECO	105,879,302	47,050,000,000
CLH	-	-
CNEC	22,652	380,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	2,276	10,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	431,683	130,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	547,940	14,290,000,000
CORFERIAS	105	10,000,000
CORFICOLCF	43,325	650,000,000
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	42,232	85,990,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	40,857,668	92,770,000,000
EIMI	217,000	26,660,000,000
ELCONDOR	1,075	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	163,537	3,730,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	35,250,567	14,190,000,000
ENELCHILCO	69,058,440	16,150,000,000
ENKA	3,746,549	70,000,000
EQAC	6,877	8,050,000,000
ESTRA	-	-
ETB	201,325	20,000,000
EXITO	291,950	930,000,000
F	51,992,459	1,000,000,000,000
FABRICATO	1,521,458	10,000,000
FALABELLCO	2,033,740	19,500,000,000
FAMILIA	-	-
FB	17,392,460	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
FLOA	369,160	8,420,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	5,579,367	1,000,000,000,000
GEB	1,435,864	3,160,000,000
GEB_DEB	-	-
GEHC	3,465,513	1,000,000,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	9,437	510,000,000
GRUPOARGOS	249,010	3,460,000,000
GRUPOAVAL	44,445	30,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	37,600	1,150,000,000
GXTESCOL	20,000,000	1,000,000,000,000
HCOLSEL	108,718	1,460,000,000
IAUP	28,859	1,450,000,000
IB01	103,187	44,010,000,000
IBTA	1,121,142	23,750,000,000
ICHN	299,690	4,350,000,000
ICOLCAP	287,181	3,660,000,000
IDSE	497	250,000,000
IDTP	7,733	7,070,000,000
IHYA	478,448	11,810,000,000
IJPA	65,102	13,510,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	15,626	1,260,000,000
INVENSA	-	-
INVERS	-	-
ISA	379,792	6,650,000,000
ISAC	94,855	28,660,000,000
IUES	98,221	3,240,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
IUFS	85,228	3,750,000,000
IUHC	116,981	5,090,000,000
IUIT	213,709	21,920,000,000
IWVL	35,879	5,770,000,000
JNJ	6,723,036	1,000,000,000,000
JPEA	399,116	8,380,000,000
JPM	8,588,791	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	757,982	16,950,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	285,769	650,000,000
MOAT	979,022	327,600,000,000
MVOL	30,193	7,200,000,000
NU	32,057,309	1,000,000,000,000
NUAMCO	34,490	480,000,000
NUTRESA	15,445	710,000,000
OCCIDENTE	114	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	887,017	5,430,000,000
PAZRIO	72,706	10,000,000
PEI	10,927	730,000,000
PFAVAL	6,361,416	2,850,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	258	10,000,000
PFBCOLOM	1,592,581	50,150,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	114,551	650,000,000
PFCORFICOL	8,638	110,000,000
PFDAVVNDA	99,645	1,990,000,000
PFE	42,528,131	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
PFGRUPOARG	68,438	700,000,000
PFGRUPSURA	128,475	2,220,000,000
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	-
PVVILLAS00	-	-
PVVILLAS01	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	2,020	10,000,000
PORT	201,735	1,230,000,000
PREC	-	-
PROMIGAS	19,836	100,000,000
PROTECCION	15	10,000,000
RBOT	77,750	4,030,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	125,509	3,040,000,000
SDIA	810,238	18,040,000,000
SGLD	19,081	14,820,000,000
SPMV	14,444	4,850,000,000
SPXS	7,754	29,120,000,000
SQMBCO	2,977	540,000,000
SUAS	180,576	10,170,000,000
TERPEL	12,953	110,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	14	10,000,000
UBER	19,888,375	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
VILLAS	680	10,000,000
VOO	4,990,144	1,000,000,000,000

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

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	58,417,269	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	42,429,670	1,000,000,000,000
BAC	39,159,306	1,000,000,000,000
BBVACOL	15,448	10,000,000
BCOLOMBIA	417,819	13,500,000,000
BHI	610,544	150,000,000
BMC	-	-
BOGOTA	11,527	360,000,000
BRKB	3,407,633	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	100,518,982	19,060,000,000
BVC	965	10,000,000
C	16,504,976	1,000,000,000,000
CAPCO	346,845	9,940,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	22,890	12,690,000,000
CBU7	34,619	17,670,000,000
CELSIA	506,104	1,760,000,000
CEMA	8,933	5,550,000,000
CEMARGOS	538,691	3,760,000,000
CENCOSUDCO	2,792,930	19,180,000,000
CEUU	106,042	3,360,000,000
CFMITNIPCO	108,964	1,500,000,000
CHILECO	105,879,302	47,050,000,000
CLH	-	-





## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CNEC	22,652	380,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	2,276	10,000,000
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	431,683	130,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	547,940	14,290,000,000
CORFERIAS	105	10,000,000
CORFICOLCF	43,325	650,000,000
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
CSPX	42,232	85,990,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
ECOPETROL	40,857,668	92,770,000,000
EIMI	217,000	26,660,000,000
ELCONDOR	1,075	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	163,537	3,730,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	35,250,567	14,190,000,000
ENELCHILCO	69,058,440	16,150,000,000
ENKA	3,746,549	70,000,000
EQAC	6,877	8,050,000,000
ESTRA	-	-
ETB	201,325	20,000,000
EXITO	291,950	930,000,000
F	51,992,459	1,000,000,000,000
FABRICATO	1,521,458	10,000,000
FALABELLCO	2,033,740	19,500,000,000



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
FAMILIA	-	-
FB	17,392,460	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	369,160	8,420,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	5,579,367	1,000,000,000,000
GEB	1,435,864	3,160,000,000
GEB_DEB	-	-
GEHC	3,465,513	1,000,000,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	9,437	510,000,000
GRUPOARGOS	249,010	3,460,000,000
GRUPOAVAL	44,445	30,000,000
GRUPOIMSA	-	-
GRUPOSURA	37,600	1,150,000,000
GXTESCOL	20,000,000	1,000,000,000,000
HCOLSEL	108,718	1,460,000,000
IAUP	28,859	1,450,000,000
IB01	103,187	44,010,000,000
IBTA	1,121,142	23,750,000,000
ICHN	299,690	4,350,000,000
ICOLCAP	287,181	3,660,000,000
IDSE	497	250,000,000
IDTP	7,733	7,070,000,000
IHYA	478,448	11,810,000,000
IJPA	65,102	13,510,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	15,626	1,260,000,000
INVENSA	-	-
INVERS	-	-



## Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
ISA	379,792	6,650,000,000
ISAC	94,855	28,660,000,000
IUES	98,221	3,240,000,000
IUFS	85,228	3,750,000,000
IUHC	116,981	5,090,000,000
IUIT	213,709	21,920,000,000
IWVL	35,879	5,770,000,000
JNJ	6,723,036	1,000,000,000,000
JPEA	399,116	8,380,000,000
JPM	8,588,791	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	757,982	16,950,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	285,769	650,000,000
MOAT	979,022	327,600,000,000
MVOL	30,193	7,200,000,000
NU	32,057,309	1,000,000,000,000
NUAMCO	34,490	480,000,000
NUTRESA	15,445	710,000,000
OCCIDENTE	114	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	887,017	5,430,000,000
PAZRIO	72,706	10,000,000
PEI	10,927	730,000,000
PFAVAL	6,361,416	2,850,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	258	10,000,000
PFBCOLOM	1,592,581	50,150,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	114,551	650,000,000
PFCORFICOL	8,638	110,000,000



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
PFDAVVNDA	99,645	1,990,000,000
PFE	42,528,131	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	68,438	700,000,000
PFGRUPSURA	128,475	2,220,000,000
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	-
PVVILLAS00	-	-
PVVILLAS01	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	2,020	10,000,000
PORT	201,735	1,230,000,000
PREC	-	-
PROMIGAS	19,836	100,000,000
PROTECCION	15	10,000,000
RBOT	77,750	4,030,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SDGEB	-	-
SDHA	125,509	3,040,000,000
SDIA	810,238	18,040,000,000
SGLD	19,081	14,820,000,000
SPMV	14,444	4,850,000,000
SPXS	7,754	29,120,000,000
SQMBCO	2,977	540,000,000
SUAS	180,576	10,170,000,000
TERPEL	12,953	110,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	14	10,000,000



## Boletín informativo

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Acciones</b>	<b>VMD Efectivo</b>
UBER	19,888,375	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	-	-
VILLAS	680	10,000,000
VOO	4,990,144	1,000,000,000,000

José Manuel Suárez Jiménez  
Subgerente de Riesgo y Metodologías