



Boletín informativo

No.025 / 31 de mayo 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 4 de junio de 2024 para las Operaciones de contado, TTV y Repo (si es elegible) son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	62,369,520	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	37,992,079	1,000,000,000,000
BAC	37,604,314	1,000,000,000,000
BBVACOL	49,799	10,000,000
BCOLOMBIA	496,803	16,590,000,000
BHI	655,908	170,000,000
BMC	523	10,000,000
BOGOTA	22,416	660,000,000
BRKB	3,252,153	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	203,356,798	37,900,000,000
BVC	2,222	30,000,000
C	13,798,269	1,000,000,000,000
CAPCO	313,596	8,660,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	30,641	16,580,000,000
CBU7	31,498	15,830,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CCAU	5,471	3,990,000,000
CELSIA	526,456	2,090,000,000
CEMA	8,776	5,650,000,000
CEMARGOS	750,220	6,160,000,000
CENCOSUDCO	4,321,697	30,340,000,000
CEUU	120,735	4,010,000,000
CFMITNIPCO	128,365	1,770,000,000
CHILECO	106,375,746	47,470,000,000
CLH	-	-
CNEC	30,533	430,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	2,117	10,000,000
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	499,391	160,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	654,475	18,500,000,000
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	100,584	1,520,000,000
CPXJ	11,022	7,280,000,000
CREDIFAMI	11	10,000,000
CSACOL	-	-
CSKR	3,730	2,510,000,000
CSPX	42,842	90,250,000,000
CUSS	1,124	2,160,000,000
CYBA	49,499	1,090,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPECTULU	-	-
DPYA	72,174	1,470,000,000
DTLA	929,234	16,160,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
ECOPETROL	46,034,047	102,660,000,000
EDMU	-	-
EIMI	210,707	26,820,000,000
ELCONDOR	11,127	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	188,405	4,290,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	40,060,284	15,270,000,000
ENELCHILCO	68,167,288	16,020,000,000
ENKA	3,220,210	60,000,000
EQAC	4,945	5,890,000,000
ESTRA	-	-
ETB	150,371	20,000,000
EXITO	171,882	410,000,000
F	47,914,905	1,000,000,000,000
FABRICATO	1,867,134	10,000,000
FALABELLCO	2,444,538	25,540,000,000
FAMILIA	-	-
FB	15,334,726	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	420,390	9,560,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	7,336,472	1,000,000,000,000
GEB	1,701,743	4,020,000,000
GEHC	3,018,740	1,000,000,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	15,548	920,000,000
GRUPOARGOS	396,733	6,210,000,000
GRUPOAVAL	67,386	40,000,000
GRUPOIMSA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
GRUPOSURA	40,847	1,320,000,000
GXTESCOL	685	40,000,000
HCOLSEL	91,771	1,300,000,000
HLQD	33,757	850,000,000
HYGU	12,471	310,000,000
IAUP	39,225	2,230,000,000
IAUS	5,144	970,000,000
IB01	137,792	58,730,000,000
IBTA	1,157,227	24,330,000,000
ICHN	181,616	2,850,000,000
ICOLCAP	306,906	4,210,000,000
IDSE	472	240,000,000
IDTP	7,956	7,200,000,000
IHYA	459,641	11,300,000,000
IJPA	67,861	14,380,000,000
IMBA	160,005	3,080,000,000
IMVU	653	170,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	9,088	710,000,000
INVENSA	-	-
ISA	501,531	9,380,000,000
ISAC	77,280	24,160,000,000
ISFD	108,540	3,040,000,000
IUAA	433,730	8,750,000,000
IUES	97,185	3,500,000,000
IUFS	104,526	4,790,000,000
IUHC	161,748	7,000,000,000
IUIT	191,177	20,480,000,000
IWVL	30,397	5,020,000,000
JNJ	7,311,446	1,000,000,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
JPEA	487,081	10,230,000,000
JPM	8,929,894	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	872,196	19,080,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	304,761	840,000,000
MOAT	764,890	258,880,000,000
MVOL	19,110	4,590,000,000
NU	24,220,243	1,000,000,000,000
NUAMCO	89,797	1,450,000,000
NUTRESA	13,086	590,000,000
OCCIDENTE	129	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	873,944	5,240,000,000
PAZRIO	40,252	10,000,000
PEI	28,568	2,060,000,000
PFAVAL	6,601,576	2,880,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	394	10,000,000
PFBCELOM	1,839,804	60,830,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCMARGOS	85,185	590,000,000
PFCORFICOL	18,652	290,000,000
PFDVVNDA	83,611	1,800,000,000
PFE	40,658,093	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	89,343	1,030,000,000
PFGRUPSURA	158,345	3,360,000,000
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFVILLAS	-	-
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	1,398	10,000,000
PORT	160,444	1,150,000,000
PROMIGAS	39,654	250,000,000
PROTECCION	2	10,000,000
RBOT	68,527	3,530,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SASU	111,526	4,500,000,000
SDGEB	-	-
SDHA	114,293	2,770,000,000
SDIA	751,934	16,650,000,000
SGLD	21,338	18,260,000,000
SPMV	19,628	6,710,000,000
SPXS	7,252	28,370,000,000
SQMBCO	1,702	310,000,000
SUAS	188,887	10,690,000,000
TERPEL	26,990	240,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
UBER	17,988,798	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	43	10,000,000
VILLAS	1,201	10,000,000
VOO	4,941,515	1,000,000,000,000
WIAU	51,001	1,270,000,000



Boletín informativo

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías