



Boletín informativo

No.030 / 28 de junio 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 2 de julio de 2024 para las Operaciones de contado, TTV y Repo (si es elegible) son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
AAPL	66,661,953	1,000,000,000,000
AGROCHAL	-	-
AMZN	38,260,051	1,000,000,000,000
BAC	35,841,434	1,000,000,000,000
BBVACOL	48,348	10,000,000
BCOLOMBIA	268,520	9,490,000,000
BHI	794,209	220,000,000
BMC	777	10,000,000
BOGOTA	19,936	560,000,000
BRKB	3,175,359	1,000,000,000,000
BSANTANDCO	248,479,441	46,300,000,000
BVC	3,478	40,000,000
C	12,751,073	1,000,000,000,000
CAPCO	278,362	7,690,000,000
CARACOLTV	-	-
CARTON	-	-
CBU0	31,793	17,360,000,000
CBU7	29,136	14,750,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
CCAU	8,555	6,380,000,000
CELSIA	359,375	1,510,000,000
CEMA	6,665	4,370,000,000
CEMARGOS	660,956	5,560,000,000
CENCOSUDCO	4,481,619	32,390,000,000
CEUU	125,211	4,200,000,000
CFMITNIPCO	124,402	1,730,000,000
CHILECO	98,382,206	44,380,000,000
CLH	-	-
CNEC	31,824	430,000,000
COLOMBINA	-	-
COLTEJER	16	10,000,000
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	545,669	170,000,000
COOMEVAEPS	-	-
COPECCO	696,331	21,120,000,000
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	98,250	1,490,000,000
CPXJ	15,653	10,740,000,000
CREDIFAMI	11	10,000,000
CSACOL	-	-
CSKR	3,019	2,040,000,000
CSPX	45,146	97,680,000,000
CUSS	1,007	1,940,000,000
CYBA	38,682	860,000,000
DESCAUCANO	-	-
DPCSACOL	-	-
DPELECTULU	-	-
DPYA	59,390	1,210,000,000
DTLA	746,849	13,000,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
ECOPETROL	48,363,728	111,190,000,000
EDMU	-	-
EIMI	240,291	31,460,000,000
ELCONDOR	11,725	10,000,000
ELECTULUA	-	-
EMCA	209,389	4,850,000,000
EMPAQUES	-	-
ENELAMCO	41,487,271	15,750,000,000
ENELCHILCO	74,043,667	17,360,000,000
ENKA	3,844,330	70,000,000
EQAC	5,117	6,380,000,000
ESTRA	-	-
ETB	180,714	20,000,000
EXITO	151,256	350,000,000
F	45,684,760	1,000,000,000,000
FABRICATO	1,441,608	10,000,000
FALABELLCO	2,940,290	34,290,000,000
FAMILIA	-	-
FB	14,321,537	1,000,000,000,000
FGNTOLIMA	-	-
FLOA	396,559	9,140,000,000
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	6,953,761	1,000,000,000,000
GEB	1,114,298	2,820,000,000
GEHC	2,636,159	847,640,000,000
GIBRALTAR	-	-
GRUBOLIVAR	8,821	580,000,000
GRUPOARGOS	352,409	5,740,000,000
GRUPOAVAL	58,262	30,000,000
GRUPOIMSA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
GRUPOSURA	24,489	870,000,000
GXTESCOL	790	40,000,000
HCOLSEL	70,531	1,050,000,000
HLQD	71,723	1,860,000,000
HYGU	15,719	400,000,000
IAUP	34,883	2,070,000,000
IAUS	4,717	910,000,000
IB01	139,277	60,120,000,000
IBTA	867,166	18,310,000,000
ICHN	202,352	3,310,000,000
ICOLCAP	294,175	4,110,000,000
IDSE	562	290,000,000
IDTP	8,487	7,810,000,000
IHYA	434,926	10,820,000,000
IJPA	78,794	16,850,000,000
IMBA	176,173	3,430,000,000
IMVU	676	170,000,000
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INRA	6,410	510,000,000
INVENSA	-	-
ISA	474,512	8,930,000,000
ISAC	76,902	24,520,000,000
ISFD	133,295	3,860,000,000
IUAA	416,142	8,470,000,000
IUES	97,929	3,560,000,000
IUFS	105,931	4,900,000,000
IUHC	184,900	8,140,000,000
IUIT	253,517	29,490,000,000
IWVL	31,830	5,330,000,000
JNJ	7,337,283	1,000,000,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
JPEA	447,905	9,520,000,000
JPM	9,196,053	1,000,000,000,000
LLP	-	-
LQDA	792,093	17,420,000,000
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	224,269	720,000,000
MOAT	762,485	259,800,000,000
MVOL	18,129	4,410,000,000
NU	22,805,129	1,000,000,000,000
NUAMCO	62,984	1,110,000,000
NUTRESA	6,424	310,000,000
OCCIDENTE	189	10,000,000
ORBIS	-	-
PARAUCOCO	793,656	4,800,000,000
PAZRIO	56,460	10,000,000
PEI	73,014	5,690,000,000
PFAVAL	3,541,846	1,620,000,000
PFAVH	-	-
PFBBVACOL	398	10,000,000
PFBCOLOM	1,911,718	64,280,000,000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	47,164	350,000,000
PFCORFICOL	18,904	290,000,000
PFDVVNDA	99,239	2,120,000,000
PFE	35,798,581	1,000,000,000,000
PFGBOLIVAR	-	-
PFGRUPOARG	92,395	1,090,000,000
PFGRUPSURA	156,048	3,530,000,000
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFVILLAS	-	-
PFVILLAS00	-	-
PFVILLAS01	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	-	-
PORT	179,442	1,310,000,000
PROMIGAS	53,048	350,000,000
PROTECCION	-	-
RBOT	83,731	4,350,000,000
RCNTELEVI	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
SASU	79,481	3,280,000,000
SDGEB	-	-
SDHA	90,192	2,220,000,000
SDIA	623,695	13,910,000,000
SGLD	20,924	18,380,000,000
SPMV	24,310	8,570,000,000
SPXS	6,922	27,870,000,000
SQMBCO	1,457	260,000,000
SUAS	166,963	9,540,000,000
TERPEL	29,545	260,000,000
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
UBER	17,791,816	1,000,000,000,000
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	59	10,000,000
VILLAS	767	10,000,000
VOO	5,023,510	1,000,000,000,000
WIAU	35,799	900,000,000



Boletín informativo

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgo y Metodologías