



Boletín informativo

No.181 / Diciembre 14 de 2020

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A 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)
Hasta un 100%	3
Hasta un 200%	4
Mayor a un 300%	5

Por tal razón los parámetros para el cálculo de la Garantía por Posición y el Riesgo en situación de estrés se incrementarán de acuerdo al incremento del horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar la posición según se muestra en la siguiente tabla:

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de incremento en la Garantía por Posición.
Entre un 100% y 150%	3	28%
Entre un 150% y 200%	4	52%
Mayor a un 200%	5	73%

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.



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de diciembre 2020 hasta el 21 de diciembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.421.000.000	231.905
CELSIA	867.000.000	188.333
CEMARGOS	2.861.000.000	510.854
CORFICOLCF	1.984.000.000	62.795
ECOPETROL	68.655.000.000	29.720.563
GEB	2.511.000.000	971.269
GRUPOARGOS	3.168.000.000	238.229
GRUPOSURA	5.730.000.000	238.153
ISA	7.227.000.000	295.116
NUTRESA	2.704.000.000	113.298
PFAVAL	11.201.000.000	9.912.472
PFBCOLOM	54.270.000.000	1.664.736
PFDAVVNDA	3.614.000.000	107.812
PFGRUPSURA	1.633.000.000	82.547
ICOLCAP	7.411.000.000	529.443
BOGOTA	614.000.000	8.182

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de diciembre 2020 hasta el 21 de diciembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	71.211.986
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	4.655.601
BAC	1.000.000.000.000	59.000.381
BBVACOL	20.000.000	64.068
BCOLOMBIA	7.421.000.000	231.905
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	614.000.000	8.182



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	379.000.000	33.332
C	1.000.000.000.000	24.132.359
CARTON	24.000.000	2.464
CELSIA	867.000.000	188.333
CEMARGOS	2.861.000.000	510.854
CLH	1.959.000.000	601.723
CNEC	1.967.000.000	179.947
COLTEJER	1.000.000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	119.000.000	324.287
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.984.000.000	62.795
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	68.655.000.000	29.720.563
ELCONDOR	84.000.000	73.075
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	58.000.000	5.498.732
ESTRA	-	-
ETB	176.000.000	829.953
EXITO	205.000.000	14.951
FABRICATO	15.000.000	3.038.099
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	19.308.154
FGNTOLIMA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	95.580.623
GEB	2.511.000.000	971.269
GRUBOLIVAR	202.000.000	3.057
GRUPOARGOS	3.168.000.000	238.229
GRUPOAVAL	76.000.000	67.933
GRUPOSURA	5.730.000.000	238.153
HCOLSEL	6.126.000.000	477.105
ICOLCAP	7.411.000.000	529.443
INCASTILLA	-	-
INESA	11.000.000	26.662
INVENSA	34.000.000	66.935
ISA	7.227.000.000	295.116
JNJ	1.000.000.000.000	6.473.859
JPM	1.000.000.000.000	15.647.434
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	434.000.000	111.347
MOAT	69.657.000.000	325.228
NUTRESA	2.704.000.000	113.298
OCCIDENTE	134.000.000	3.951
ORBIS	-	-
PAZRIO	1.000.000	75.359
PFAVAL	11.201.000.000	9.912.472
PFAVH	42.000.000	254.416
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	54.270.000.000	1.664.736
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	258.000.000	59.620



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	486.000.000	19.513
PFDVVNDA	3.614.000.000	107.812
PFE	1.000.000.000.000	30.615.402
PFGRUPOARG	390.000.000	39.261
PFGRUPSURA	1.633.000.000	82.547
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.973
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	3.000.000	810
POPULAR	1.000.000	4.391
PROMIGAS	420.000.000	53.898
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4.000.000	7.395
TERPEL	352.000.000	42.673
TGLSC	-	1.668
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6.000.000	1.138
VILLAS	33.000.000	7.354

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de diciembre 2020 hasta el 21 de diciembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	71.211.986
AGROCHAL	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AMZN	4.655.601
BAC	59.000.381
BBVACOL	64.068
BCOLOMBIA	231.905
BMC	2.300
BOGOTA	8.182
BVC	33.332
C	24.132.359
CARTON	2.464
CELSIA	188.333
CEMARGOS	510.854
CLH	601.723
CNEC	179.947
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	324.287
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	62.795
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	29.720.563
ELCONDOR	73.075
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.498.732
ESTRA	-
ETB	829.953



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de
las transacciones generando
seguridad y transparencia al
mercado de capitales colombiano.*



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
EXITO	14.951
FABRICATO	3.038.099
FAMILIA	-
FB	19.308.154
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	95.580.623
GEB	971.269
GRUBOLIVAR	3.057
GRUPOARGOS	238.229
GRUPOAVAL	67.933
GRUPOSURA	238.153
HCOLSEL	477.105
ICOLCAP	529.443
INCASTILLA	-
INESA	26.662
INVENSA	66.935
ISA	295.116
JNJ	6.473.859
JPM	15.647.434
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	111.347
MOAT	325.228
NUTRESA	113.298
OCCIDENTE	3.951
ORBIS	-
PAZRIO	75.359
PFAVAL	9.912.472
PFAVH	254.416



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

*Aseguramos el cumplimiento de
las transacciones generando
seguridad y transparencia al
mercado de capitales colombiano.*



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.664.736
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	59.620
PFCORFICOL	19.513
PFDVVNDA	107.812
PFE	30.615.402
PFGRUPOARG	39.261
PFGRUPSURA	82.547
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.973
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	810
POPULAR	4.391
PROMIGAS	53.898
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7.395
TERPEL	42.673
TGLSC	1.668
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.138
VILLAS	7.354

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente