



Boletín informativo

No.166 / Noviembre 23 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 24 de noviembre 2020 hasta el 30 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.795.000.000	209.372
CELSIA	707.000.000	160.621
CEMARGOS	2.707.000.000	566.341
CORFICOLCF	1.457.000.000	52.231
ECOPETROL	62.839.000.000	29.186.574
GEB	2.397.000.000	959.025
GRUPOARGOS	3.051.000.000	256.418
GRUPOSURA	4.931.000.000	226.818
ISA	6.536.000.000	288.203
NUTRESA	2.563.000.000	118.056
PFAVAL	9.697.000.000	10.239.760
PFBCOLOM	42.914.000.000	1.567.357
PFDAVVNDA	2.771.000.000	100.402
PFGRUPSURA	1.260.000.000	72.062
ICOLCAP	6.643.000.000	528.262
BOGOTA	563.000.000	7.881

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 24 de noviembre 2020 hasta el 30 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	67.123.781
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.765.649
BAC	1.000.000.000.000	60.270.027
BBVACOL	14.000.000	49.684
BCOLOMBIA	5.795.000.000	209.372



**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 Efectivo	VMD acciones
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	563.000.000	7.881
BVC	262.000.000	23.991
C	1.000.000.000.000	23.618.089
CARTON	36.000.000	3.687
CELSIA	707.000.000	160.621
CEMARGOS	2.707.000.000	566.341
CLH	1.852.000.000	574.327
CNEC	1.968.000.000	185.806
COLTEJER	1.000.000	473
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	76.000.000	225.611
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.457.000.000	52.231
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	62.839.000.000	29.186.574
ELCONDOR	40.000.000	39.445
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	26.000.000	3.631.848
ESTRA	-	-
ETB	170.000.000	825.123
EXITO	160.000.000	12.725
FABRICATO	13.000.000	2.742.210
FAMILIA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
FB	1.000.000.000.000	21.421.242
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	2.000.000	26
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	92.391.422
GEB	2.397.000.000	959.025
GRUBOLIVAR	153.000.000	2.467
GRUPOARGOS	3.051.000.000	256.418
GRUPOAVAL	65.000.000	68.716
GRUPOSURA	4.931.000.000	226.818
HCOLSEL	5.213.000.000	450.338
ICOLCAP	6.643.000.000	528.262
INCASTILLA	-	-
INESA	56.000.000	134.199
INVENSA	44.000.000	87.120
ISA	6.536.000.000	288.203
JNJ	1.000.000.000.000	6.435.992
JPM	1.000.000.000.000	16.569.348
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	393.000.000	104.561
MOAT	75.269.000.000	346.067
NUTRESA	2.563.000.000	118.056
OCCIDENTE	40.000.000	1.151
ORBIS	-	-
PAZRIO	1.000.000	112.598
PFAVAL	9.697.000.000	10.239.760
PFAVH	93.000.000	619.603
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	42.914.000.000	1.567.357



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	288.000.000	73.969
PFCORFICOL	404.000.000	17.940
PFDVVNDA	2.771.000.000	100.402
PFE	1.000.000.000.000	28.639.856
PFGRUPOARG	426.000.000	46.215
PFGRUPSURA	1.260.000.000	72.062
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.973
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	3.000.000	680
POPULAR	1.000.000	4.263
PROMIGAS	394.000.000	53.931
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	21.000.000	43.589
TERPEL	341.000.000	42.432
TGLSC	-	1.668
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	4.000.000	908
VILLAS	34.000.000	7.577



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 24 de noviembre 2020 hasta el 30 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	67.123.781
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.765.649
BAC	60.270.027
BBVACOL	49.684
BCOLOMBIA	209.372
BMC	2.300
BOGOTA	7.881
BVC	23.991
C	23.618.089
CARTON	3.687
CELSIA	160.621
CEMARGOS	566.341
CLH	574.327
CNEC	185.806
COLTEJER	473
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	225.611
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	52.231
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	29.186.574



**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
ELCONDOR	39.445
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.631.848
ESTRA	-
ETB	825.123
EXITO	12.725
FABRICATO	2.742.210
FAMILIA	-
FB	21.421.242
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	26
GASORIENTE	-
GE	92.391.422
GEB	959.025
GRUBOLIVAR	2.467
GRUPOARGOS	256.418
GRUPOAVAL	68.716
GRUPOSURA	226.818
HCOLSEL	450.338
ICOLCAP	528.262
INCASTILLA	-
INESA	134.199
INVENSA	87.120
ISA	288.203
JNJ	6.435.992
JPM	16.569.348
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	104.561
MOAT	346.067
NUTRESA	118.056



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	112.598
PFAVAL	10.239.760
PFAVH	619.603
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.567.357
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	73.969
PFCORFICOL	17.940
PFDVVNDA	100.402
PFE	28.639.856
PFGRUPOARG	46.215
PFGRUPSURA	72.062
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.973
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	680
POPULAR	4.263
PROMIGAS	53.931
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	43.589
TERPEL	42.432
TGLSC	1.668
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	908
VILLAS	7.577



Boletín informativo

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente

