



Boletín informativo

No.176 / Diciembre 07 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 09 de diciembre 2020 hasta el 14 de diciembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.763.000.000	221.003
CELSIA	822.000.000	175.569
CEMARGOS	2.559.000.000	483.800
CORFICOLCF	1.914.000.000	61.156
ECOPETROL	65.397.000.000	29.551.482
GEB	2.389.000.000	896.063
GRUPOARGOS	3.089.000.000	237.651
GRUPOSURA	5.305.000.000	226.313
ISA	6.757.000.000	285.088
NUTRESA	2.563.000.000	105.953
PFAVAL	11.345.000.000	10.221.015
PFBCOLOM	47.626.000.000	1.561.506
PFDAVVNDA	3.167.000.000	105.030
PFGRUPSURA	1.433.000.000	74.580
ICOLCAP	6.492.000.000	477.406
BOGOTA	571.000.000	7.640

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de diciembre 2020 hasta el 14 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	70.109.661
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	4.721.810
BAC	1.000.000.000.000	58.639.685
BBVACOL	16.000.000	52.391
BCOLOMBIA	6.763.000.000	221.003



**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	571.000.000	7.640
BVC	304.000.000	26.728
C	1.000.000.000.000	24.168.063
CARTON	20.000.000	1.998
CELSIA	822.000.000	175.569
CEMARGOS	2.559.000.000	483.800
CLH	1.935.000.000	598.144
CNEC	1.961.000.000	177.831
COLTEJER	1.000.000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	115.000.000	313.120
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.914.000.000	61.156
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	65.397.000.000	29.551.482
ELCONDOR	76.000.000	65.533
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	52.000.000	4.865.777
ESTRA	-	-
ETB	169.000.000	788.053
EXITO	175.000.000	12.638
FABRICATO	16.000.000	3.286.212
FAMILIA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
FB	1.000.000.000.000	19.300.884
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	94.484.471
GEB	2.389.000.000	896.063
GRUBOLIVAR	179.000.000	2.748
GRUPOARGOS	3.089.000.000	237.651
GRUPOAVAL	77.000.000	70.371
GRUPOSURA	5.305.000.000	226.313
HCOLSEL	5.840.000.000	465.970
ICOLCAP	6.492.000.000	477.406
INCASTILLA	-	-
INESA	11.000.000	26.662
INVENSA	34.000.000	66.935
ISA	6.757.000.000	285.088
JNJ	1.000.000.000.000	6.577.660
JPM	1.000.000.000.000	15.698.305
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	433.000.000	110.259
MOAT	70.881.000.000	324.622
NUTRESA	2.563.000.000	105.953
OCCIDENTE	41.000.000	1.181
ORBIS	-	-
PAZRIO	1.000.000	75.359
PFAVAL	11.345.000.000	10.221.015
PFAVH	44.000.000	272.026
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	47.626.000.000	1.561.506



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	231.000.000	54.315
PFCORFICOL	432.000.000	16.610
PFDVVNDA	3.167.000.000	105.030
PFE	1.000.000.000.000	29.825.595
PFGRUPOARG	330.000.000	33.504
PFGRUPSURA	1.433.000.000	74.580
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.973
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	3.000.000	680
POPULAR	1.000.000	4.391
PROMIGAS	437.000.000	54.228
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4.000.000	7.395
TERPEL	357.000.000	42.672
TGLSC	-	1.668
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	4.000.000	748
VILLAS	33.000.000	7.300



Boletín informativo

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 09 de diciembre 2020 hasta el 14 de diciembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	70.109.661
AGROCHAL	-
AMZN	4.721.810
BAC	58.639.685
BBVACOL	52.391
BCOLOMBIA	221.003
BMC	2.300
BOGOTA	7.640
BVC	26.728
C	24.168.063
CARTON	1.998
CELSIA	175.569
CEMARGOS	483.800
CLH	598.144
CNEC	177.831
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	313.120
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	61.156
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	29.551.482



**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	65.533
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	4.865.777
ESTRA	-
ETB	788.053
EXITO	12.638
FABRICATO	3.286.212
FAMILIA	-
FB	19.300.884
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	94.484.471
GEB	896.063
GRUBOLIVAR	2.748
GRUPOARGOS	237.651
GRUPOAVAL	70.371
GRUPOSURA	226.313
HCOLSEL	465.970
ICOLCAP	477.406
INCASTILLA	-
INESA	26.662
INVENSA	66.935
ISA	285.088
JNJ	6.577.660
JPM	15.698.305
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	110.259
MOAT	324.622
NUTRESA	105.953





Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
OCCIDENTE	1.181
ORBIS	-
PAZRIO	75.359
PFAVAL	10.221.015
PFAVH	272.026
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.561.506
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	54.315
PFCORFICOL	16.610
PFDVVNDA	105.030
PFE	29.825.595
PFGRUPOARG	33.504
PFGRUPSURA	74.580
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.973
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	680
POPULAR	4.391
PROMIGAS	54.228
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7.395
TERPEL	42.672
TGLSC	1.668
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	748
VILLAS	7.300



**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

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente

