



Boletín informativo

No.186 / Diciembre 28 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 29 de diciembre 2020 hasta el 4 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.775.000.000	253.234
CELSIA	984.000.000	209.857
CEMARGOS	2.733.000.000	479.408
CORFICOLCF	2.196.000.000	67.798
ECOPETROL	68.225.000.000	29.831.501
GEB	2.384.000.000	924.507
GRUPOARGOS	3.005.000.000	218.041
GRUPOSURA	6.424.000.000	260.178
ISA	7.017.000.000	280.666
NUTRESA	3.225.000.000	136.639
PFAVAL	11.913.000.000	10.053.089
PFBCOLOM	58.514.000.000	1.659.026
PFDVVNDA	4.302.000.000	120.313
PFGRUPSURA	1.979.000.000	90.736
ICOLCAP	8.055.000.000	556.370
BOGOTA	599.000.000	7.995

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de diciembre 2020 hasta el 4 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	74.724.397
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	4.298.662
BAC	1.000.000.000.000	57.500.023
BBVACOL	19.000.000	59.855
BCOLOMBIA	8.775.000.000	253.234
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	599.000.000	7.995



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BVC	411.000.000	34.635
C	1.000.000.000.000	23.182.439
CARTON	6.000.000	637
CELSIA	984.000.000	209.857
CEMARGOS	2.733.000.000	479.408
CLH	1.998.000.000	610.098
CNEC	1.934.000.000	183.448
COLTEJER	1.000.000	376
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	136.000.000	356.390
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	2.196.000.000	67.798
CREDIFAMI	-	-
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	68.225.000.000	29.831.501
ELCONDOR	88.000.000	73.679
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	62.000.000	5.810.723
ESTRA	-	-
ETB	198.000.000	918.667
EXITO	196.000.000	14.677
FABRICATO	15.000.000	2.926.589
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	18.118.803
FGNTOLIMA	-	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GASNATURAL	-	-
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	95.100.358
GEB	2.384.000.000	924.507
GRUBOLIVAR	229.000.000	3.433
GRUPOARGOS	3.005.000.000	218.041
GRUPOAVAL	76.000.000	66.358
GRUPOSURA	6.424.000.000	260.178
HCOLSEL	6.304.000.000	472.374
ICOLCAP	8.055.000.000	556.370
INCASTILLA	-	-
INESA	11.000.000	26.662
INVENSA	34.000.000	66.935
ISA	7.017.000.000	280.666
JNJ	1.000.000.000.000	6.459.470
JPM	1.000.000.000.000	14.740.197
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	467.000.000	113.384
MOAT	67.483.000.000	314.068
NUTRESA	3.225.000.000	136.639
OCCIDENTE	134.000.000	3.951
ORBIS	-	-
PAZRIO	1.000.000	168.032
PFAVAL	11.913.000.000	10.053.089
PFAVH	42.000.000	223.616
PFBVACOL	-	-
PFBCELOM	58.514.000.000	1.659.026
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	341.000.000	76.556



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFCORFICOL	612.000.000	23.439
PFDVVNDA	4.302.000.000	120.313
PFE	1.000.000.000.000	31.831.581
PFGRUPOARG	518.000.000	48.513
PFGRUPSURA	1.979.000.000	90.736
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	10.000.000	2.261
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	3.000.000	810
POPULAR	3.000.000	12.294
PROMIGAS	187.000.000	23.681
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	4.000.000	7.395
TERPEL	353.000.000	42.102
TGLSC	-	1.720
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	6.000.000	1.138
VILLAS	64.000.000	11.974

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de diciembre 2020 hasta el 4 de enero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	74.724.397
AGROCHAL	-



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
AMZN	4.298.662
BAC	57.500.023
BBVACOL	59.855
BCOLOMBIA	253.234
BMC	2.300
BOGOTA	7.995
BVC	34.635
C	23.182.439
CARTON	637
CELSIA	209.857
CEMARGOS	479.408
CLH	610.098
CNEC	183.448
COLTEJER	376
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	356.390
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	67.798
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	29.831.501
ELCONDOR	73.679
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	5.810.723
ESTRA	-
ETB	918.667



**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	14.677
FABRICATO	2.926.589
FAMILIA	-
FB	18.118.803
FGNTOLIMA	-
GASNATURAL	-
GASORIENTE	-
GE	95.100.358
GEB	924.507
GRUBOLIVAR	3.433
GRUPOARGOS	218.041
GRUPOAVAL	66.358
GRUPOSURA	260.178
HCOLSEL	472.374
ICOLCAP	556.370
INCASTILLA	-
INESA	26.662
INVENSA	66.935
ISA	280.666
JNJ	6.459.470
JPM	14.740.197
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	113.384
MOAT	314.068
NUTRESA	136.639
OCCIDENTE	3.951
ORBIS	-
PAZRIO	168.032
PFAVAL	10.053.089
PFAVH	223.616



**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	1.659.026
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	76.556
PFCORFICOL	23.439
PFDVVNDA	120.313
PFE	31.831.581
PFGRUPOARG	48.513
PFGRUPSURA	90.736
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	2.261
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	810
POPULAR	12.294
PROMIGAS	23.681
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	7.395
TERPEL	42.102
TGLSC	1.720
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.138
VILLAS	11.974

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente