



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 10 de agosto de 2020

No. 109

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 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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 11 de agosto 2020 hasta el 18 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.890.000.000	235.599
CELSIA	1.107.000.000	257.717
CEMARGOS	1.933.000.000	479.018
CORFICOLCF	1.605.000.000	61.917
ECOPETROL	57.335.000.000	26.421.580
GEB	4.982.000.000	2.129.147
GRUPOARGOS	5.322.000.000	513.747
GRUPOSURA	5.229.000.000	264.869

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.007.000.000	406.445
NUTRESA	2.969.000.000	143.414
PFAVAL	12.758.000.000	14.904.308
PFBCOLOM	63.210.000.000	2.557.032
PFDAVVNDA	3.109.000.000	115.490
PFGRUPSURA	1.033.000.000	60.784
ICOLCAP	6.601.000.000	572.260
BOGOTA	885.000.000	13.840

Los volúmenes Medios Diarios aplicables el 18 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	35.332.534
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	4.251.151
BAC	1.000.000.000.000	64.884.542
BBVACOL	20.000.000	65.010
BCOLOMBIA	5.890.000.000	235.599
BMC	-	-
BOGOTA	885.000.000	13.840
BVC	422.000.000	38.325
C	1.000.000.000.000	19.991.735
CARTON	142.000.000	14.423
CELSIA	1.107.000.000	257.717
CEMARGOS	1.933.000.000	479.018
CLH	596.000.000	335.886
CNEC	1.917.000.000	189.044
COLTEJER	-	-
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	73.000.000	194.834
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.605.000.000	61.917
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	18.768.000.000	8.648.820
ELCONDOR	74.000.000	74.454
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	17.000.000	2.122.908
ESTRA	-	-
ETB	271.000.000	1.320.559
EXITO	350.000.000	33.897
FABRICATO	19.000.000	3.490.071
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	18.917.763
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	15.000.000	176
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	81.028.194
GEB	4.982.000.000	2.129.147
GRUBOLIVAR	140.000.000	2.163
GRUPOARGOS	5.322.000.000	513.747
GRUPOAVAL	36.000.000	40.390
GRUPOSURA	5.229.000.000	264.869
HCOLSEL	2.833.000.000	267.024
ICOLCAP	6.601.000.000	572.260
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	8.007.000.000	406.445
JNJ	1.000.000.000.000	6.787.377
JPM	1.000.000.000.000	17.052.267
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	432.000.000	106.638
MOAT	99.388.000.000	485.009
NUTRESA	2.969.000.000	143.414
OCCIDENTE	38.000.000	1.063

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	3.000.000	334.367
PFAVAL	8.050.000.000	9.404.534
PFAVH	336.000.000	1.637.090
PFBBVACOL	7.000.000	27.500
PFBCOLOM	19.164.000.000	775.227
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	230.000.000	66.989
PFCORFICOL	506.000.000	24.682
PFDVVNDA	3.109.000.000	115.490
PFE	1.000.000.000.000	26.170.618
PFGRUPOARG	443.000.000	53.792
PFGRUPSURA	1.033.000.000	60.784
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	6.000.000	1.188
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	28
POPULAR	2.000.000	6.570
PROMIGAS	365.000.000	54.574
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	140.000.000	20.056
TGLSC	20.000.000	1.378
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	10.000.000	2.006
VILLAS	1.000.000	175

Los volúmenes Medios Diarios aplicables el 18 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	35.332.534
AGROCHAL	-
AMZN	4.251.151
BAC	64.884.542
BBVACOL	65.010
BCOLOMBIA	235.599
BMC	-
BOGOTA	13.840
BVC	38.325
C	19.991.735
CARTON	14.423
CELSIA	257.717
CEMARGOS	479.018
CLH	335.886
CNEC	189.044
COLTEJER	-
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	194.834
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	61.917
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	8.648.820
ELCONDOR	74.454
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	2.122.908
ESTRA	-
ETB	1.320.559
EXITO	33.897
FABRICATO	3.490.071
FAMILIA	2.114
FB	18.917.763
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	176
GASORIENTE	-
GE	81.028.194
GEB	2.129.147
GRUBOLIVAR	2.163
GRUPOARGOS	513.747
GRUPOAVAL	40.390
GRUPOSURA	264.869
HCOLSEL	267.024
ICOLCAP	572.260
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	406.445
JNJ	6.787.377
JPM	17.052.267
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	106.638
MOAT	485.009
NUTRESA	143.414
OCCIDENTE	1.063
ORBIS	-
PAZRIO	334.367
PFAVAL	9.404.534
PFAVH	1.637.090
PFBBVACOL	27.500
PFBCOLOM	775.227
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	66.989
PFCORFICOL	24.682
PFDVVNDA	115.490
PFE	26.170.618
PFGRUPOARG	53.792
PFGRUPSURA	60.784
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	28

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	6.570
PROMIGAS	54.574
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	20.056
TGLSC	1.378
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	2.006
VILLAS	175

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías