



# BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 24 de agosto de 2020

No. 117

**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](mailto: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 25 de agosto 2020 hasta el 31 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.946.000.000	232.089
CELSIA	1.138.000.000	256.224
CEMARGOS	2.579.000.000	579.524
CORFICOLCF	1.641.000.000	63.890
ECOPETROL	57.596.000.000	26.420.191
GEB	5.178.000.000	2.109.142
GRUPOARGOS	5.600.000.000	510.027
GRUPOSURA	5.754.000.000	263.218

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
ISA	8.473.000.000	403.482
NUTRESA	2.960.000.000	143.533
PFAVAL	13.335.000.000	14.949.676
PFBCOLOM	65.150.000.000	2.537.006
PFDAVVNDA	3.399.000.000	122.536
PFGRUPSURA	1.132.000.000	64.905
ICOLCAP	7.181.000.000	594.962
BOGOTA	940.000.000	13.867

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de agosto 2020 hasta el 31 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
AAPL	1.000.000.000.000	35.949.384
AGROCHAL	0	0
AMZN	1.000.000.000.000	4.265.279
BAC	1.000.000.000.000	64.676.651
BBVACOL	20.000.000	66.091
BCOLOMBIA	5.946.000.000	232.089
BMC	0	0
BOGOTA	940.000.000	13.867
BVC	406.000.000	35.764
C	1.000.000.000.000	20.051.306
CARTON	125.000.000	12.674
CELSIA	1.138.000.000	256.224
CEMARGOS	2.579.000.000	579.524
CLH	691.000.000	347.341
CNEC	1.337.000.000	130.532
COLTEJER	0	0
COLTEL	0	0
CONCIVILES	0	0
CONCONCRET	80.000.000	227.401
COOMEVAEPS	0	0
CORFERIAS	0	0
CORFICOLCF	1.641.000.000	63.890
CREDIFAMI	0	0

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
CSACOL	0	0
DESCAUCANO	0	0
ECOPETROL	57.596.000.000	26.420.191
ELCONDOR	72.000.000	70.419
ELECTULUA	0	0
EMPAQUES	0	0
ENKA	20.000.000	2.509.017
ESTRA	0	0
ETB	200.000.000	976.575
EXITO	414.000.000	36.627
FABRICATO	18.000.000	3.431.126
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	19.228.455
FGNTOLIMA	0	0
GASNATURAL	15.000.000	176
GASORIENTE	0	0
GE	1.000.000.000.000	78.536.388
GEB	5.178.000.000	2.109.142
GRUBOLIVAR	138.000.000	2.137
GRUPOARGOS	5.600.000.000	510.027
GRUPOAVAL	32.000.000	34.874
GRUPOSURA	5.754.000.000	263.218
HCOLSEL	3.802.000.000	344.060
ICOLCAP	7.181.000.000	594.962
INCASTILLA	0	0
INESA	0	0
INVENSA	0	0
ISA	8.473.000.000	403.482
JNJ	1.000.000.000.000	6.607.026
JPM	1.000.000.000.000	17.218.148
MARLY	0	0
MAYAGUEZ	0	0
MINEROS	452.000.000	115.808
MOAT	102.261.000.000	485.626
NUTRESA	2.960.000.000	143.533
OCCIDENTE	34.000.000	966

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
ORBIS	0	0
PAZRIO	3.000.000	353.405
PFAVAL	13.335.000.000	14.949.676
PFAVH	520.000.000	2.939.399
PFBBVACOL	7.000.000	27.500
PFBCOLOM	65.150.000.000	2.537.006
PFCARPAK	0	0
PFCEMARGOS	243.000.000	68.075
PFCORFICOL	506.000.000	24.510
PFDVVNDA	3.399.000.000	122.536
PFE	1.000.000.000.000	25.741.521
PFGRUPOARG	444.000.000	53.671
PFGRUPSURA	1.132.000.000	64.905
PFVILLA051	0	0
PFVILLA053	0	0
PFVILLAS	6.000.000	1.188
PFVILLAS00	0	0
PFVILLASCA	0	28
POPULAR	13.000.000	46.463
PROMIGAS	382.000.000	54.648
PROTECCION	0	0
RIOPAILA	0	0
RIOPAILIND	0	0
SANFELIPE	0	0
TERPEL	146.000.000	20.987
TGLSC	20.000.000	1.378
TITAN	0	0
VALINDUSTR	0	0
VALSIMESA	9.000.000	1.938
VILLAS	1.000.000	175

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 25 de agosto 2020 hasta el 31 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
AAPL	35.949.384
AGROCHAL	0
AMZN	4.265.279
BAC	64.676.651
BBVACOL	66.091
BCOLOMBIA	232.089
BMC	0
BOGOTA	13.867
BVC	35.764
C	20.051.306
CARTON	12.674
CELSIA	256.224
CEMARGOS	579.524
CLH	347.341
CNEC	130.532
COLTEJER	0
COLTEL	0
CONCIVILES	0
CONCONCRET	227.401
COOMEVAEPS	0
CORFERIAS	0
CORFICOLCF	63.890
CREDIFAMI	0
CSACOL	0
DESCAUCANO	0
ECOPETROL	26.420.191
ELCONDOR	70.419
ELECTULUA	0
EMPAQUES	0
ENKA	2.509.017
ESTRA	0
ETB	976.575
EXITO	36.627
FABRICATO	3.431.126
FAMILIA	2.114
FB	19.228.455
FGNTOLIMA	0

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
GASNATURAL	176
GASORIENTE	0
GE	78.536.388
GEB	2.109.142
GRUBOLIVAR	2.137
GRUPOARGOS	510.027
GRUPOAVAL	34.874
GRUPOSURA	263.218
HCOLSEL	344.060
ICOLCAP	594.962
INCASTILLA	0
INESA	0
INVENSA	0
ISA	403.482
JNJ	6.607.026
JPM	17.218.148
MARLY	0
MAYAGUEZ	0
MINEROS	115.808
MOAT	485.626
NUTRESA	143.533
OCCIDENTE	966
ORBIS	0
PAZRIO	353.405
PFAVAL	14.949.676
PFAVH	2.939.399
PFBBVACOL	27.500
PFBCOLOM	2.537.006
PFCARPAK	0
PFCEMARGOS	68.075
PFCORFICOL	24.510
PFDAVVNDA	122.536
PFE	25.741.521
PFGRUPOARG	53.671
PFGRUPSURA	64.905
PFVILLA051	0

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
PFVILLA053	0
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	0
PFVILLASCA	28
POPULAR	46.463
PROMIGAS	54.648
PROTECCION	0
RIOPAILA	0
RIOPAILIND	0
SANFELIPE	0
TERPEL	20.987
TGLSC	1.378
TITAN	0
VALINDUSTR	0
VALSIMESA	1.938
VILLAS	175

Jaime Andrés Restrepo  
Subgerente de Riesgo y Metodologías