



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 31 de agosto de 2020

No. 121

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 01 de septiembre 2020 hasta el 07 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.181.000.000	231.489
CELSIA	1.162.000.000	250.915
CEMARGOS	3.143.000.000	642.003
CORFICOLCF	1.810.000.000	67.052
ECOPETROL	57.626.000.000	26.494.636
GEB	5.033.000.000	2.046.026
GRUPOARGOS	5.988.000.000	508.333
GRUPOSURA	5.743.000.000	264.670

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.714.000.000	401.917
NUTRESA	3.270.000.000	149.449
PFAVAL	13.996.000.000	15.048.969
PFBCOLOM	68.499.000.000	2.537.000
PFDAVVNDA	3.490.000.000	121.611
PFGRUPSURA	1.312.000.000	72.494
ICOLCAP	7.777.000.000	621.898
BOGOTA	974.000.000	14.019

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de septiembre 2020 hasta el 07 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	39.731.287
AGROCHAL	-	-
AMZN	1.000.000.000.000	4.289.192
BAC	1.000.000.000.000	64.593.033
BBVACOL	19.000.000	60.276
BCOLOMBIA	6.181.000.000	231.489
BMC	-	-
BOGOTA	974.000.000	14.019
BVC	425.000.000	35.820
C	1.000.000.000.000	20.132.916
CARTON	115.000.000	11.645
CELSIA	1.162.000.000	250.915
CEMARGOS	3.143.000.000	642.003
CLH	835.000.000	372.932
CNEC	1.196.000.000	114.601
COLTEJER	-	-
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	91.000.000	243.813
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.810.000.000	67.052
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	57.626.000.000	26.494.636
ELCONDOR	75.000.000	71.145
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	27.000.000	3.537.609
ESTRA	-	-
ETB	210.000.000	988.625
EXITO	333.000.000	28.918
FABRICATO	18.000.000	3.303.702
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	19.724.617
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	78.468.785
GEB	5.033.000.000	2.046.026
GRUBOLIVAR	142.000.000	2.145
GRUPOARGOS	5.988.000.000	508.333
GRUPOAVAL	31.000.000	33.167
GRUPOSURA	5.743.000.000	264.670
HCOLSEL	3.865.000.000	335.303
ICOLCAP	7.777.000.000	621.898
INCASTILLA	-	-
INESA	-	-
INVENSA	-	-
ISA	8.714.000.000	401.917
JNJ	1.000.000.000.000	6.511.527
JPM	1.000.000.000.000	17.309.050
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	474.000.000	119.840
MOAT	103.152.000.000	479.401
NUTRESA	3.270.000.000	149.449
OCCIDENTE	34.000.000	966

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	3.000.000	353.405
PFAVAL	13.996.000.000	15.048.969
PFAVH	401.000.000	2.051.992
PFBBVACOL	5.000.000	18.469
PFBCOLOM	68.499.000.000	2.537.000
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	273.000.000	72.024
PFCORFICOL	560.000.000	25.572
PFDAVVNDA	3.490.000.000	121.611
PFE	1.000.000.000.000	25.808.755
PFGRUPOARG	518.000.000	57.592
PFGRUPSURA	1.312.000.000	72.494
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	6.000.000	1.188
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	-	28
POPULAR	13.000.000	47.719
PROMIGAS	392.000.000	55.185
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	-	-
TERPEL	138.000.000	18.151
TGLSC	-	-
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.938
VILLAS	1.000.000	169

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 01 de septiembre 2020 hasta el 07 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMDacciones
AAPL	39.731.287
AGROCHAL	-
AMZN	4.289.192
BAC	64.593.033
BBVACOL	60.276
BCOLOMBIA	231.489
BMC	-
BOGOTA	14.019
BVC	35.820
C	20.132.916
CARTON	11.645
CELSIA	250.915
CEMARGOS	642.003
CLH	372.932
CNEC	114.601
COLTEJER	-
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	243.813
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	67.052
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	26.494.636
ELCONDOR	71.145
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.537.609
ESTRA	-
ETB	988.625
EXITO	28.918
FABRICATO	3.303.702
FAMILIA	2.114
FB	19.724.617
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMDacciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	78.468.785
GEB	2.046.026
GRUBOLIVAR	2.145
GRUPOARGOS	508.333
GRUPOAVAL	33.167
GRUPOSURA	264.670
HCOLSEL	335.303
ICOLCAP	621.898
INCASTILLA	-
INESA	-
INVENSA	-
ISA	401.917
JNJ	6.511.527
JPM	17.309.050
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	119.840
MOAT	479.401
NUTRESA	149.449
OCCIDENTE	966
ORBIS	-
PAZRIO	353.405
PFAVAL	15.048.969
PFAVH	2.051.992
PFBBVACOL	18.469
PFBCOLOM	2.537.000
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	72.024
PFCORFICOL	25.572
PFDAVVNDA	121.611
PFE	25.808.755
PFGRUPOARG	57.592
PFGRUPSURA	72.494
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	28

Nemotécnico	VMDacciones
POPULAR	47.719
PROMIGAS	55.185
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	-
TERPEL	18.151
TGLSC	-
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.938
VILLAS	169

Jaime Andrés Restrepo
 Subgerente de Riesgo y Metodologías