



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 14 de septiembre de 2020

No. 128

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.

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de septiembre 2020 hasta el 21 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.164.000.000	235.637
CELSIA	1.042.000.000	230.694
CEMARGOS	3.003.000.000	611.560
CORFICOLCF	1.715.000.000	63.513
ECOPETROL	52.746.000.000	26.047.459
GEB	4.775.000.000	1.969.113
GRUPOARGOS	4.612.000.000	378.070

GRUPOSURA	5.908.000.000	254.640
Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	7.862.000.000	383.864
NUTRESA	3.411.000.000	151.332
PFAVAL	10.989.000.000	11.879.920
PFBCOLOM	61.039.000.000	2.335.082
PFDAVVNDA	3.407.000.000	118.713
PFGRUPSURA	1.373.000.000	69.788
ICOLCAP	7.671.000.000	624.057
BOGOTA	965.000.000	13.990

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de septiembre 2020 hasta el 21 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	46.719.237
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.388.869
BAC	1.000.000.000.000	60.852.100
BBVACOL	18.000.000	60.010
BCOLOMBIA	6.164.000.000	235.637
BMC	-	-
BOGOTA	965.000.000	13.990
BVC	390.000.000	33.196
C	1.000.000.000.000	20.414.285
CARTON	101.000.000	10.222
CELSIA	1.042.000.000	230.694
CEMARGOS	3.003.000.000	611.560
CLH	1.161.000.000	413.889
CNEC	1.272.000.000	127.159
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	91.000.000	263.671
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.715.000.000	63.513

CREDIFAMI	-	-
Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	52.746.000.000	26.047.459
ELCONDOR	76.000.000	70.786
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	29.000.000	3.831.016
ESTRA	-	-
ETB	207.000.000	978.211
EXITO	316.000.000	27.743
FABRICATO	14.000.000	3.404.549
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.133.007
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	79.835.251
GEB	4.775.000.000	1.969.113
GRUBOLIVAR	128.000.000	1.984
GRUPOARGOS	4.612.000.000	378.070
GRUPOAVAL	28.000.000	30.131
GRUPOSURA	5.908.000.000	254.640
HCOLSEL	3.872.000.000	340.504
ICOLCAP	7.671.000.000	624.057
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	7.862.000.000	383.864
JNJ	1.000.000.000.000	6.152.460
JPM	1.000.000.000.000	17.549.323
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	465.000.000	121.122
MOAT	90.439.000.000	443.176
NUTRESA	3.411.000.000	151.332
OCCIDENTE	41.000.000	1.181

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	21.807
PFAVAL	10.989.000.000	11.879.920
PFAVH	322.000.000	1.502.801
PFBBVACOL	5.000.000	18.469
PFBCOLOM	61.039.000.000	2.335.082
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	330.000.000	82.565
PFCORFICOL	569.000.000	25.873
PFDAVVNDA	3.407.000.000	118.713
PFE	1.000.000.000.000	26.023.436
PFGRUPOARG	551.000.000	59.233
PFGRUPSURA	1.373.000.000	69.788
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	6.000.000	1.188
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	28
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	439.000.000	59.518
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	201.000.000	23.520
TGLSC	1.000.000	36
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.781
VILLAS	1.000.000	163

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 15 de septiembre 2020 hasta el 21 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	46.719.237
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.388.869
BAC	60.852.100
BBVACOL	60.010
BCOLOMBIA	235.637
BMC	-
BOGOTA	13.990
BVC	33.196
C	20.414.285
CARTON	10.222
CELSIA	230.694
CEMARGOS	611.560
CLH	413.889
CNEC	127.159
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	263.671
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	63.513
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	26.047.459
ELCONDOR	70.786
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.831.016
ESTRA	-
ETB	978.211
EXITO	27.743
FABRICATO	3.404.549
FAMILIA	2.114
FB	20.133.007
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	79.835.251
GEB	1.969.113
GRUBOLIVAR	1.984
GRUPOARGOS	378.070
GRUPOAVAL	30.131
GRUPOSURA	254.640
HCOLSEL	340.504
ICOLCAP	624.057
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	383.864
JNJ	6.152.460
JPM	17.549.323
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	121.122
MOAT	443.176
NUTRESA	151.332
OCCIDENTE	1.181
ORBIS	-
PAZRIO	21.807
PFAVAL	11.879.920
PFAVH	1.502.801
PFBBVACOL	18.469
PFBCOLOM	2.335.082
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	82.565
PFCORFICOL	25.873
PFDVVNDA	118.713
PFE	26.023.436
PFGRUPOARG	59.233
PFGRUPSURA	69.788
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	28

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.361
PROMIGAS	59.518
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	23.520
TGLSC	36
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.781
VILLAS	163

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías