



# BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 21 de septiembre de 2020

No. 134

**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, 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 22 de septiembre 2020 hasta el 28 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.243.000.000	238.277
CELSIA	1.020.000.000	224.369
CEMARGOS	2.958.000.000	629.324
CORFICOLCF	1.629.000.000	62.413
ECOPETROL	57.134.000.000	27.013.883
GEB	5.187.000.000	2.034.034
GRUPOARGOS	4.266.000.000	370.995
GRUPOSURA	5.792.000.000	258.787

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
ISA	8.271.000.000	408.661
NUTRESA	3.348.000.000	152.875
PFAVAL	10.350.000.000	11.311.120
PFBCOLOM	59.938.000.000	2.314.209
PFDAVVNDA	3.435.000.000	121.046
PFGRUPSURA	1.321.000.000	68.729
ICOLCAP	7.396.000.000	605.069
BOGOTA	923.000.000	13.578

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de septiembre 2020 hasta el 28 de septiembre 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	50.016.204
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.451.663
BAC	1.000.000.000.000	60.458.935
BBVACOL	14.000.000	45.222
BCOLOMBIA	6.243.000.000	238.277
BMC	-	-
BOGOTA	923.000.000	13.578
BVC	370.000.000	32.733
C	1.000.000.000.000	21.176.707
CARTON	90.000.000	9.185
CELSIA	1.020.000.000	224.369
CEMARGOS	2.958.000.000	629.324
CLH	1.181.000.000	420.972
CNEC	1.406.000.000	139.439
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	88.000.000	260.649
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.629.000.000	62.413
CREDIFAMI	-	-

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	57.134.000.000	27.013.883
ELCONDOR	75.000.000	70.017
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	29.000.000	3.867.880
ESTRA	-	-
ETB	204.000.000	955.940
EXITO	315.000.000	27.584
FABRICATO	14.000.000	3.423.118
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.460.309
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	82.231.784
GEB	5.187.000.000	2.034.034
GRUBOLIVAR	116.000.000	1.810
GRUPOARGOS	4.266.000.000	370.995
GRUPOAVAL	29.000.000	32.343
GRUPOSURA	5.792.000.000	258.787
HCOLSEL	3.893.000.000	346.956
ICOLCAP	7.396.000.000	605.069
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	8.271.000.000	408.661
JNJ	1.000.000.000.000	6.114.328
JPM	1.000.000.000.000	17.705.754
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	445.000.000	118.687
MOAT	83.408.000.000	407.447
NUTRESA	3.348.000.000	152.875
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD Efectivo</b>	<b>VMD acciones</b>
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	21.807
PFAVAL	10.350.000.000	11.311.120
PFAVH	275.000.000	1.341.934
PFBBVACOL	5.000.000	18.469
PFBCOLOM	59.938.000.000	2.314.209
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	308.000.000	80.352
PFCORFICOL	555.000.000	25.712
PFDAVVNDA	3.435.000.000	121.046
PFE	1.000.000.000.000	26.103.334
PFGRUPOARG	534.000.000	58.859
PFGRUPSURA	1.321.000.000	68.729
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.641
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	576.000.000	78.952
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	210.000.000	25.182
TGLSC	1.000.000	71
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.781
VILLAS	1.000.000	163

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 22 de septiembre 2020 hasta el 28 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
AAPL	50.016.204
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.451.663
BAC	60.458.935
BBVACOL	45.222
BCOLOMBIA	238.277
BMC	-
BOGOTA	13.578
BVC	32.733
C	21.176.707
CARTON	9.185
CELSIA	224.369
CEMARGOS	629.324
CLH	420.972
CNEC	139.439
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	260.649
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	62.413
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	27.013.883
ELCONDOR	70.017
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.867.880
ESTRA	-
ETB	955.940
EXITO	27.584
FABRICATO	3.423.118
FAMILIA	2.114
FB	20.460.309
FGNTOLIMA	-

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	82.231.784
GEB	2.034.034
GRUBOLIVAR	1.810
GRUPOARGOS	370.995
GRUPOAVAL	32.343
GRUPOSURA	258.787
HCOLSEL	346.956
ICOLCAP	605.069
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	408.661
JNJ	6.114.328
JPM	17.705.754
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	118.687
MOAT	407.447
NUTRESA	152.875
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	21.807
PFAVAL	11.311.120
PFAVH	1.341.934
PFBBVACOL	18.469
PFBCOLOM	2.314.209
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	80.352
PFCORFICOL	25.712
PFDVVNDA	121.046
PFE	26.103.334
PFGRUPOARG	58.859
PFGRUPSURA	68.729
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.641
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

<b>Nemotécnico</b>	<b>VMD acciones</b>
POPULAR	47.361
PROMIGAS	78.952
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	25.182
TGLSC	71
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.781
VILLAS	163

Jaime Andrés Restrepo  
Subgerente de Riesgo y Metodologías