



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 05 de octubre de 2020

No. 142

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 06 de octubre 2020 hasta el 13 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.719.000.000	233.412
CELSIA	953.000.000	205.211
CEMARGOS	2.451.000.000	539.925
CORFICOLCF	1.461.000.000	55.116
ECOPETROL	53.267.000.000	27.888.381
GEB	3.114.000.000	1.260.845
GRUPOARGOS	3.330.000.000	289.079
GRUPOSURA	4.954.000.000	241.429

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	7.594.000.000	379.707
NUTRESA	3.258.000.000	148.085
PFAVAL	9.141.000.000	10.190.633
PFBCOLOM	51.131.000.000	2.040.355
PFDAVVNDA	2.881.000.000	106.092
PFGRUPSURA	1.280.000.000	71.131
ICOLCAP	7.156.000.000	602.949
BOGOTA	680.000.000	10.001

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 06 de octubre 2020 hasta el 13 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	54.882.451
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.518.360
BAC	1.000.000.000.000	57.564.100
BBVACOL	12.000.000	39.366
BCOLOMBIA	5.719.000.000	233.412
BMC	-	-
BOGOTA	680.000.000	10.001
BVC	305.000.000	27.716
C	1.000.000.000.000	21.687.526
CARTON	81.000.000	8.237
CELSIA	953.000.000	205.211
CEMARGOS	2.451.000.000	539.925
CLH	1.216.000.000	433.492
CNEC	1.451.000.000	146.301
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	81.000.000	238.416
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.461.000.000	55.116
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	53.267.000.000	27.888.381
ELCONDOR	67.000.000	68.377
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	28.000.000	3.816.222
ESTRA	-	-
ETB	176.000.000	854.506
EXITO	288.000.000	25.717
FABRICATO	14.000.000	3.405.441
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.666.806
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	84.462.497
GEB	3.114.000.000	1.260.845
GRUBOLIVAR	109.000.000	1.731
GRUPOARGOS	3.330.000.000	289.079
GRUPOAVAL	28.000.000	31.259
GRUPOSURA	4.954.000.000	241.429
HCOLSEL	4.058.000.000	372.092
ICOLCAP	7.156.000.000	602.949
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	7.594.000.000	379.707
JNJ	1.000.000.000.000	5.923.125
JPM	1.000.000.000.000	17.195.787
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	384.000.000	107.829
MOAT	80.570.000.000	378.894
NUTRESA	3.258.000.000	148.085
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	19.356
PFAVAL	9.141.000.000	10.190.633
PFAVH	227.000.000	1.147.383
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	51.131.000.000	2.040.355
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	280.000.000	75.694
PFCORFICOL	536.000.000	25.370
PFDVVNDA	2.881.000.000	106.092
PFE	1.000.000.000.000	24.889.323
PFGRUPOARG	528.000.000	56.142
PFGRUPSURA	1.280.000.000	71.131
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.641
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	554.000.000	78.748
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	199.000.000	24.002
TGLSC	20.000.000	1.008
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.817
VILLAS	1.000.000	163

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 06 de octubre 2020 hasta el 13 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	54.882.451
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.518.360
BAC	57.564.100
BBVACOL	39.366
BCOLOMBIA	233.412
BMC	-
BOGOTA	10.001
BVC	27.716
C	21.687.526
CARTON	8.237
CELSIA	205.211
CEMARGOS	539.925
CLH	433.492
CNEC	146.301
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	238.416
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	55.116
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	27.888.381
ELCONDOR	68.377
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.816.222
ESTRA	-
ETB	854.506
EXITO	25.717
FABRICATO	3.405.441
FAMILIA	2.114
FB	20.666.806
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	84.462.497
GEB	1.260.845
GRUBOLIVAR	1.731
GRUPOARGOS	289.079
GRUPOAVAL	31.259
GRUPOSURA	241.429
HCOLSEL	372.092
ICOLCAP	602.949
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	379.707
JNJ	5.923.125
JPM	17.195.787
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	107.829
MOAT	378.894
NUTRESA	148.085
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	19.356
PFAVAL	10.190.633
PFAVH	1.147.383
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	2.040.355
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	75.694
PFCORFICOL	25.370
PFDVVNDA	106.092
PFE	24.889.323
PFGRUPOARG	56.142
PFGRUPSURA	71.131
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.641
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.361
PROMIGAS	78.748
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	24.002
TGLSC	1.008
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.817
VILLAS	163

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías