



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de octubre de 2020

No. 147

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 14 de octubre 2020 hasta el 19 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.064.000.000	233.416
CELSIA	902.000.000	194.380
CEMARGOS	2.456.000.000	528.749
CORFICOLCF	1.433.000.000	55.506
ECOPETROL	54.594.000.000	28.170.084
GEB	2.960.000.000	1.165.542
GRUPOARGOS	3.207.000.000	286.324
GRUPOSURA	5.008.000.000	240.764

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	7.376.000.000	341.460
NUTRESA	3.260.000.000	146.837
PFAVAL	9.267.000.000	10.239.290
PFBCOLOM	48.459.000.000	1.915.393
PFDVVNDA	2.766.000.000	102.429
PFGRUPSURA	1.243.000.000	67.319
ICOLCAP	7.255.000.000	599.727
BOGOTA	672.000.000	9.815

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de octubre 2020 hasta el 19 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	56.532.514
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.551.977
BAC	1.000.000.000.000	57.621.793
BBVACOL	12.000.000	40.995
BCOLOMBIA	6.064.000.000	233.416
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	672.000.000	9.815
BVC	269.000.000	24.687
C	1.000.000.000.000	22.000.039
CARTON	81.000.000	8.237
CELSIA	902.000.000	194.380
CEMARGOS	2.456.000.000	528.749
CLH	1.241.000.000	442.285
CNEC	1.940.000.000	196.103
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	81.000.000	241.324
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.433.000.000	55.506
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	54.594.000.000	28.170.084
ELCONDOR	71.000.000	68.450
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	28.000.000	3.808.561
ESTRA	-	-
ETB	170.000.000	836.092
EXITO	279.000.000	24.962
FABRICATO	14.000.000	3.375.036
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.792.169
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	85.945.492
GEB	2.960.000.000	1.165.542
GRUBOLIVAR	102.000.000	1.596
GRUPOARGOS	3.207.000.000	286.324
GRUPOAVAL	41.000.000	46.311
GRUPOSURA	5.008.000.000	240.764
HCOLSEL	4.122.000.000	371.748
ICOLCAP	7.255.000.000	599.727
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	7.376.000.000	341.460
JNJ	1.000.000.000.000	5.945.453
JPM	1.000.000.000.000	17.037.907
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	388.000.000	104.971
MOAT	78.548.000.000	358.769
NUTRESA	3.260.000.000	146.837
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	12.944
PFAVAL	9.267.000.000	10.239.290
PFAVH	219.000.000	1.103.859
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	48.459.000.000	1.915.393
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	287.000.000	74.933
PFCORFICOL	538.000.000	25.028
PFDVVNDA	2.766.000.000	102.429
PFE	1.000.000.000.000	25.060.991
PFGRUPOARG	522.000.000	54.833
PFGRUPSURA	1.243.000.000	67.319
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.641
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	557.000.000	77.494
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	194.000.000	23.452
TGLSC	27.000.000	1.338
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.817
VILLAS	1.000.000	144

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 14 de octubre 2020 hasta el 19 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	56.532.514
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.551.977
BAC	57.621.793
BBVACOL	40.995
BCOLOMBIA	233.416
BMC	2.300
BOGOTA	9.815
BVC	24.687
C	22.000.039
CARTON	8.237
CELSIA	194.380
CEMARGOS	528.749
CLH	442.285
CNEC	196.103
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	241.324
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	55.506
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.170.084
ELCONDOR	68.450
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.808.561
ESTRA	-
ETB	836.092
EXITO	24.962
FABRICATO	3.375.036
FAMILIA	2.114
FB	20.792.169
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	85.945.492
GEB	1.165.542
GRUBOLIVAR	1.596
GRUPOARGOS	286.324
GRUPOAVAL	46.311
GRUPOSURA	240.764
HCOLSEL	371.748
ICOLCAP	599.727
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	341.460
JNJ	5.945.453
JPM	17.037.907
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	104.971
MOAT	358.769
NUTRESA	146.837
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	12.944
PFAVAL	10.239.290
PFAVH	1.103.859
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.915.393
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	74.933
PFCORFICOL	25.028
PFDVVNDA	102.429
PFE	25.060.991
PFGRUPOARG	54.833
PFGRUPSURA	67.319
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.641
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.361
PROMIGAS	77.494
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	23.452
TGLSC	1.338
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.817
VILLAS	144

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías