



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 19 de octubre de 2020

No. 149

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 20 de octubre 2020 hasta el 26 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.733.000.000	235.619
CELSIA	871.000.000	189.406
CEMARGOS	2.447.000.000	536.524
CORFICOLCF	1.438.000.000	55.334
ECOPETROL	53.028.000.000	28.206.592
GEB	2.880.000.000	1.134.448
GRUPOARGOS	3.121.000.000	285.024
GRUPOSURA	5.057.000.000	241.035

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	7.164.000.000	331.684
NUTRESA	3.287.000.000	148.056
PFAVAL	9.488.000.000	10.542.098
PFBCOLOM	45.621.000.000	1.844.779
PFDAVVNDA	2.754.000.000	106.191
PFGRUPSURA	1.134.000.000	64.319
ICOLCAP	7.278.000.000	608.774
BOGOTA	686.000.000	10.097

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de octubre 2020 hasta el 26 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	58.687.883
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.598.250
BAC	1.000.000.000.000	57.846.738
BBVACOL	12.000.000	42.139
BCOLOMBIA	5.733.000.000	235.619
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	686.000.000	10.097
BVC	280.000.000	25.429
C	1.000.000.000.000	22.279.094
CARTON	81.000.000	8.237
CELSIA	871.000.000	189.406
CEMARGOS	2.447.000.000	536.524
CLH	1.257.000.000	448.255
CNEC	2.059.000.000	203.264
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	84.000.000	247.031
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.438.000.000	55.334
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	53.028.000.000	28.206.592
ELCONDOR	67.000.000	64.707
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	28.000.000	3.808.561
ESTRA	-	-
ETB	161.000.000	819.384
EXITO	276.000.000	24.665
FABRICATO	14.000.000	3.365.038
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.857.557
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	86.941.960
GEB	2.880.000.000	1.134.448
GRUBOLIVAR	103.000.000	1.640
GRUPOARGOS	3.121.000.000	285.024
GRUPOAVAL	41.000.000	47.204
GRUPOSURA	5.057.000.000	241.035
HCOLSEL	4.310.000.000	393.237
ICOLCAP	7.278.000.000	608.774
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	7.164.000.000	331.684
JNJ	1.000.000.000.000	5.950.107
JPM	1.000.000.000.000	16.090.121
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	391.000.000	109.662
MOAT	72.437.000.000	329.923
NUTRESA	3.287.000.000	148.056
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	15.417
PFAVAL	9.488.000.000	10.542.098
PFAVH	202.000.000	1.104.022
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	45.621.000.000	1.844.779
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	281.000.000	74.131
PFCORFICOL	527.000.000	24.964
PFDVVNDA	2.754.000.000	106.191
PFE	1.000.000.000.000	24.610.696
PFGRUPOARG	497.000.000	54.384
PFGRUPSURA	1.134.000.000	64.319
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	9.000.000	1.750
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	14.000.000	49.023
PROMIGAS	567.000.000	76.844
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	199.000.000	23.788
TGLSC	39.000.000	1.727
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.817
VILLAS	1.000.000	144

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 20 de octubre 2020 hasta el 26 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	58.687.883
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.598.250
BAC	57.846.738
BBVACOL	42.139
BCOLOMBIA	235.619
BMC	2.300
BOGOTA	10.097
BVC	25.429
C	22.279.094
CARTON	8.237
CELSIA	189.406
CEMARGOS	536.524
CLH	448.255
CNEC	203.264
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	247.031
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	55.334
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.206.592
ELCONDOR	64.707
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.808.561
ESTRA	-
ETB	819.384
EXITO	24.665
FABRICATO	3.365.038
FAMILIA	2.114
FB	20.857.557
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	86.941.960
GEB	1.134.448
GRUBOLIVAR	1.640
GRUPOARGOS	285.024
GRUPOAVAL	47.204
GRUPOSURA	241.035
HCOLSEL	393.237
ICOLCAP	608.774
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	331.684
JNJ	5.950.107
JPM	16.090.121
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	109.662
MOAT	329.923
NUTRESA	148.056
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	15.417
PFAVAL	10.542.098
PFAVH	1.104.022
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.844.779
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	74.131
PFCORFICOL	24.964
PFDVVNDA	106.191
PFE	24.610.696
PFGRUPOARG	54.384
PFGRUPSURA	64.319
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.750
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	49.023
PROMIGAS	76.844
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	23.788
TGLSC	1.727
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.817
VILLAS	144

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías