



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 26 de octubre de 2020

No. 152

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 27 de octubre 2020 hasta el 03 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.852.000.000	234.179
CELSIA	814.000.000	176.612
CEMARGOS	2.433.000.000	531.057
CORFICOLCF	1.361.000.000	52.022
ECOPETROL	52.798.000.000	28.386.185
GEB	2.772.000.000	1.111.371
GRUPOARGOS	2.998.000.000	274.791
GRUPOSURA	4.888.000.000	231.307

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.526.000.000	308.697
NUTRESA	3.105.000.000	144.774
PFAVAL	9.496.000.000	10.491.566
PFBCOLOM	45.936.000.000	1.794.380
PFDVVNDA	2.826.000.000	103.906
PFGRUPSURA	1.053.000.000	59.924
ICOLCAP	7.171.000.000	598.554
BOGOTA	712.000.000	9.888

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 27 de octubre 2020 hasta el 03 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	60.373.335
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.636.108
BAC	1.000.000.000.000	57.025.695
BBVACOL	11.000.000	40.470
BCOLOMBIA	5.852.000.000	234.179
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	712.000.000	9.888
BVC	316.000.000	28.738
C	1.000.000.000.000	22.472.499
CARTON	35.000.000	3.505
CELSIA	814.000.000	176.612
CEMARGOS	2.433.000.000	531.057
CLH	1.274.000.000	454.061
CNEC	2.062.000.000	199.456
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	81.000.000	244.727
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.361.000.000	52.022
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	52.798.000.000	28.386.185
ELCONDOR	60.000.000	60.982
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	28.000.000	3.847.261
ESTRA	-	-
ETB	157.000.000	771.665
EXITO	257.000.000	23.140
FABRICATO	14.000.000	3.395.388
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.972.471
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	88.115.218
GEB	2.772.000.000	1.111.371
GRUBOLIVAR	110.000.000	1.768
GRUPOARGOS	2.998.000.000	274.791
GRUPOAVAL	41.000.000	47.636
GRUPOSURA	4.888.000.000	231.307
HCOLSEL	4.576.000.000	415.852
ICOLCAP	7.171.000.000	598.554
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	6.526.000.000	308.697
JNJ	1.000.000.000.000	5.883.168
JPM	1.000.000.000.000	15.874.769
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	392.000.000	106.214
MOAT	65.735.000.000	308.011
NUTRESA	3.105.000.000	144.774
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	15.417
PFAVAL	9.496.000.000	10.491.566
PFAVH	195.000.000	1.083.738
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	45.936.000.000	1.794.380
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	279.000.000	74.285
PFCORFICOL	541.000.000	24.925
PFDVVNDA	2.826.000.000	103.906
PFE	1.000.000.000.000	23.101.772
PFGRUPOARG	484.000.000	53.350
PFGRUPSURA	1.053.000.000	59.924
PVVILLA051	-	-
PVVILLA053	-	-
PVVILLAS	-	-
PVVILLAS00	-	-
PVVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	47.147
PROMIGAS	577.000.000	76.937
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	207.000.000	24.298
TGLSC	39.000.000	1.695
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	7.000.000	1.437
VILLAS	1.000.000	144

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 27 de octubre 2020 hasta el 03 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	60.373.335
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.636.108
BAC	57.025.695
BBVACOL	40.470
BCOLOMBIA	234.179
BMC	2.300
BOGOTA	9.888
BVC	28.738
C	22.472.499
CARTON	3.505
CELSIA	176.612
CEMARGOS	531.057
CLH	454.061
CNEC	199.456
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCRET	244.727
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	52.022
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.386.185
ELCONDOR	60.982
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.847.261
ESTRA	-
ETB	771.665
EXITO	23.140
FABRICATO	3.395.388
FAMILIA	2.114
FB	20.972.471
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	88.115.218
GEB	1.111.371
GRUBOLIVAR	1.768
GRUPOARGOS	274.791
GRUPOAVAL	47.636
GRUPOSURA	231.307
HCOLSEL	415.852
ICOLCAP	598.554
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	308.697
JNJ	5.883.168
JPM	15.874.769
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	106.214
MOAT	308.011
NUTRESA	144.774
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	15.417
PFAVAL	10.491.566
PFAVH	1.083.738
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.794.380
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	74.285
PFCORFICOL	24.925
PFDVVNDA	103.906
PFE	23.101.772
PFGRUPOARG	53.350
PFGRUPSURA	59.924
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	-
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.147
PROMIGAS	76.937
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	24.298
TGLSC	1.695
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.437
VILLAS	144

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente