



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 17 de noviembre de 2020

No. 164

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 18 de noviembre 2020 hasta el 23 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.214.000.000	198.016
CELSIA	721.000.000	165.713
CEMARGOS	2.741.000.000	571.013
CORFICOLCF	1.439.000.000	52.776
ECOPETROL	57.902.000.000	28.950.890
GEB	2.427.000.000	990.626
GRUPOARGOS	2.854.000.000	249.066
GRUPOSURA	4.885.000.000	224.812

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.847.000.000	304.032
NUTRESA	2.582.000.000	120.020
PFAVAL	9.357.000.000	10.071.784
PFBCOLOM	40.940.000.000	1.537.923
PFDAVVNDA	2.503.000.000	91.685
PFGRUPSURA	1.164.000.000	68.466
ICOLCAP	7.196.000.000	583.645
BOGOTA	578.000.000	8.322

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 18 de noviembre 2020 hasta el 23 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	66.301.727
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.780.241
BAC	1.000.000.000.000	60.630.359
BBVACOL	15.000.000	52.821
BCOLOMBIA	5.214.000.000	198.016
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	578.000.000	8.322
BVC	258.000.000	24.035
C	1.000.000.000.000	23.447.906
CARTON	36.000.000	3.687
CELSIA	721.000.000	165.713
CEMARGOS	2.741.000.000	571.013
CLH	1.858.000.000	577.144
CNEC	2.121.000.000	199.147
COLTEJER	1.000.000	473
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	69.000.000	205.794
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.439.000.000	52.776
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	57.902.000.000	28.950.890
ELCONDOR	39.000.000	39.326
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	26.000.000	3.528.920
ESTRA	-	-
ETB	70.000.000	351.255
EXITO	139.000.000	12.603
FABRICATO	13.000.000	2.680.915
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	21.427.260
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	2.000.000	26
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	91.488.522
GEB	2.427.000.000	990.626
GRUBOLIVAR	144.000.000	2.335
GRUPOARGOS	2.854.000.000	249.066
GRUPOAVAL	64.000.000	68.988
GRUPOSURA	4.885.000.000	224.812
HCOLSEL	5.086.000.000	450.053
ICOLCAP	7.196.000.000	583.645
INCASTILLA	-	-
INESA	56.000.000	134.199
INVENSA	44.000.000	87.120
ISA	6.847.000.000	304.032
JNJ	1.000.000.000.000	6.362.342
JPM	1.000.000.000.000	16.611.809
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	397.000.000	103.847
MOAT	72.580.000.000	337.907
NUTRESA	2.582.000.000	120.020
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	18.942
PFAVAL	9.357.000.000	10.071.784
PFAVH	137.000.000	938.448
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	40.940.000.000	1.537.923
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	294.000.000	73.649
PFCORFICOL	389.000.000	17.673
PFDVVVDA	2.503.000.000	91.685
PFE	1.000.000.000.000	28.093.791
PFGRUPOARG	491.000.000	53.415
PFGRUPSURA	1.164.000.000	68.466
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	9.000.000	1.973
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	3.000.000	680
POPULAR	1.000.000	4.263
PROMIGAS	402.000.000	54.445
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	21.000.000	43.589
TERPEL	341.000.000	42.789
TGLSC	-	1.668
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	4.000.000	908
VILLAS	34.000.000	7.577

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 18 de noviembre 2020 hasta el 23 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	66.301.727
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.780.241
BAC	60.630.359
BBVACOL	52.821
BCOLOMBIA	198.016
BMC	2.300
BOGOTA	8.322
BVC	24.035
C	23.447.906
CARTON	3.687
CELSIA	165.713
CEMARGOS	571.013
CLH	577.144
CNEC	199.147
COLTEJER	473
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	205.794
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	52.776
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.950.890
ELCONDOR	39.326
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.528.920
ESTRA	-
ETB	351.255
EXITO	12.603
FABRICATO	2.680.915
FAMILIA	-
FB	21.427.260
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	26
GASORIENTE	-
GE	91.488.522
GEB	990.626
GRUBOLIVAR	2.335
GRUPOARGOS	249.066
GRUPOAVAL	68.988
GRUPOSURA	224.812
HCOLSEL	450.053
ICOLCAP	583.645
INCASTILLA	-
INESA	134.199
INVENSA	87.120
ISA	304.032
JNJ	6.362.342
JPM	16.611.809
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	103.847
MOAT	337.907
NUTRESA	120.020
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	18.942
PFAVAL	10.071.784
PFAVH	938.448
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.537.923
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	73.649
PFCORFICOL	17.673
PFDVVNDA	91.685
PFE	28.093.791
PFGRUPOARG	53.415
PFGRUPSURA	68.466
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.973
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	680

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	4.263
PROMIGAS	54.445
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	43.589
TERPEL	42.789
TGLSC	1.668
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	908
VILLAS	7.577

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente