BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 09 de noviembre de 2020 No. 157

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 10 de noviembre 2020 hasta el 17 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	**VMD Efectivo**	**VMD acciones**
BCOLOMBIA	4.922.000.000	193.003
CELSIA	729.000.000	167.587
CEMARGOS	2.459.000.000	538.683
CORFICOLCF	1.255.000.000	47.790
ECOPETROL	52.927.000.000	28.874.401
GEB	2.413.000.000	992.911
GRUPOARGOS	2.734.000.000	240.494
GRUPOSURA	4.518.000.000	220.398

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.427.000.000	296.173
NUTRESA	2.620.000.000	120.871
PFAVAL	9.117.000.000	9.964.314
PFBCOLOM	39.220.000.000	1.538.649
PFDAVVNDA	2.517.000.000	94.972
PFGRUPSURA	1.048.000.000	63.541
ICOLCAP	7.091.000.000	594.654
BOGOTA	598.000.000	8.425

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 10 de noviembre 2020 hasta el 17 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	64.180.238
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.718.532
BAC	1.000.000.000.000	58.849.050
BBVACOL	15.000.000	54.846
BCOLOMBIA	4.922.000.000	193.003
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	598.000.000	8.425
BVC	250.000.000	23.167
C	1.000.000.000.000	22.944.633
CARTON	42.000.000	4.234
CELSIA	729.000.000	167.587
CEMARGOS	2.459.000.000	538.683
CLH	1.801.000.000	557.335
CNEC	2.166.000.000	209.479
COLTEJER	1.000.000	408
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	68.000.000	208.872
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.255.000.000	47.790
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	52.927.000.000	28.874.401
ELCONDOR	38.000.000	38.748
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	26.000.000	3.619.635
ESTRA	-	-
ETB	69.000.000	347.358
EXITO	139.000.000	12.654
FABRICATO	8.000.000	1.989.577
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	21.262.237
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	139
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	89.689.561
GEB	2.413.000.000	992.911
GRUBOLIVAR	112.000.000	1.827
GRUPOARGOS	2.734.000.000	240.494
GRUPOAVAL	63.000.000	69.764
GRUPOSURA	4.518.000.000	220.398
HCOLSEL	4.629.000.000	425.223
ICOLCAP	7.091.000.000	594.654
INCASTILLA	-	-
INESA	56.000.000	134.199
INVENSA	44.000.000	87.120
ISA	6.427.000.000	296.173
JNJ	1.000.000.000.000	6.175.399
JPM	1.000.000.000.000	16.205.247
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	415.000.000	104.379
MOAT	67.700.000.000	321.675
NUTRESA	2.620.000.000	120.871
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	18.942
PFAVAL	9.117.000.000	9.964.314
PFAVH	136.000.000	962.413
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	39.220.000.000	1.538.649
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	280.000.000	73.908
PFCORFICOL	318.000.000	14.978
PFDAVVNDA	2.517.000.000	94.972
PFE	1.000.000.000.000	22.805.104
PFGRUPOARG	500.000.000	53.447
PFGRUPSURA	1.048.000.000	63.541
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	7.000.000	1.466
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	3.000.000	680
POPULAR	13.000.000	44.908
PROMIGAS	400.000.000	55.588
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	21.000.000	43.589
TERPEL	339.000.000	42.366
TGLSC	34.000.000	1.668
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	4.000.000	908
VILLAS	18.000.000	3.906

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 10 de noviembre 2020 hasta el 17 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	64.180.238
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.718.532
BAC	58.849.050
BBVACOL	54.846
BCOLOMBIA	193.003
BMC	2.300
BOGOTA	8.425
BVC	23.167
C	22.944.633
CARTON	4.234
CELSIA	167.587
CEMARGOS	538.683
CLH	557.335
CNEC	209.479
COLTEJER	408
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	208.872
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	47.790
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.874.401
ELCONDOR	38.748
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.619.635
ESTRA	-
ETB	347.358
EXITO	12.654
FABRICATO	1.989.577
FAMILIA	-
FB	21.262.237
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	139
GASORIENTE	-
GE	89.689.561
GEB	992.911
GRUBOLIVAR	1.827
GRUPOARGOS	240.494
GRUPOAVAL	69.764
GRUPOSURA	220.398
HCOLSEL	425.223
ICOLCAP	594.654
INCASTILLA	-
INESA	134.199
INVENSA	87.120
ISA	296.173
JNJ	6.175.399
JPM	16.205.247
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	104.379
MOAT	321.675
NUTRESA	120.871
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	18.942
PFAVAL	9.964.314
PFAVH	962.413
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.538.649
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	73.908
PFCORFICOL	14.978
PFDAVVNDA	94.972
PFE	22.805.104
PFGRUPOARG	53.447
PFGRUPSURA	63.541
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.466
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	680

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	44.908
PROMIGAS	55.588
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	43.589
TERPEL	42.366
TGLSC	1.668
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	908
VILLAS	3.906

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente