



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 18 de agosto de 2020

No. 115

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 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 19 de agosto 2020 hasta el 24 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.847.000.000	232.561
CELSIA	1.120.000.000	258.960
CEMARGOS	2.038.000.000	505.048
CORFICOLCF	1.585.000.000	62.363
ECOPETROL	57.901.000.000	26.318.847
GEB	4.988.000.000	2.113.414
GRUPOARGOS	5.219.000.000	508.673
GRUPOSURA	5.415.000.000	264.126

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.282.000.000	405.957
NUTRESA	2.923.000.000	144.006
PFAVAL	12.930.000.000	14.913.335
PFBCOLOM	63.709.000.000	2.542.262
PFDAVVNDA	3.344.000.000	123.298
PFGRUPSURA	1.005.000.000	59.959
ICOLCAP	6.703.000.000	573.426
BOGOTA	895.000.000	13.762

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de agosto 2020 hasta el 24 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	35.647.947
AGROCHAL	0	0
AMZN	1.000.000.000.000	4.242.408
BAC	1.000.000.000.000	64.784.413
BBVACOL	21.000.000	65.484
BCOLOMBIA	5.847.000.000	232.561
BMC	0	0
BOGOTA	895.000.000	13.762
BVC	406.000.000	35.676
C	1.000.000.000.000	19.994.285
CARTON	125.000.000	12.674
CELSIA	1.120.000.000	258.960
CEMARGOS	2.038.000.000	505.048
CLH	595.000.000	336.076
CNEC	1.632.000.000	158.451
COLTEJER	0	0
COLTEL	0	0
CONCIVILES	0	0
CONCONCRET	74.000.000	224.395
COOMEVAEPS	0	0
CORFERIAS	0	0
CORFICOLCF	1.585.000.000	62.363
CREDIFAMI	0	0

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	0	0
DESCAUCANO	0	0
ECOPETROL	57.901.000.000	26.318.847
ELCONDOR	73.000.000	72.279
ELECTULUA	0	0
EMPAQUES	0	0
ENKA	17.000.000	2.118.495
ESTRA	0	0
ETB	208.000.000	1.044.722
EXITO	364.000.000	34.442
FABRICATO	19.000.000	3.502.281
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	19.092.053
FGNTOLIMA	0	0
GASNATURAL	15.000.000	176
GASORIENTE	0	0
GE	1.000.000.000.000	81.054.436
GEB	4.988.000.000	2.113.414
GRUBOLIVAR	136.000.000	2.159
GRUPOARGOS	5.219.000.000	508.673
GRUPOAVAL	32.000.000	35.877
GRUPOSURA	5.415.000.000	264.126
HCOLSEL	2.926.000.000	272.209
ICOLCAP	6.703.000.000	573.426
INCASTILLA	0	0
INESA	0	0
INVENSA	0	0
ISA	8.282.000.000	405.957
JNJ	1.000.000.000.000	6.701.944
JPM	1.000.000.000.000	17.173.583
MARLY	0	0
MAYAGUEZ	0	0
MINEROS	433.000.000	110.945
MOAT	101.833.000.000	484.737
NUTRESA	2.923.000.000	144.006
OCCIDENTE	38.000.000	1.063

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	0	0
PAZRIO	3.000.000	353.405
PFAVAL	12.930.000.000	14.913.335
PFAVH	694.000.000	3.384.246
PFBBVACOL	7.000.000	27.500
PFBCOLOM	63.709.000.000	2.542.262
PFCARPAK	0	0
PFCEMARGOS	222.000.000	64.270
PFCORFICOL	511.000.000	24.685
PFDVVVDA	3.344.000.000	123.298
PFE	1.000.000.000.000	25.841.851
PFGRUPOARG	395.000.000	50.171
PFGRUPSURA	1.005.000.000	59.959
PFVILLA051	0	0
PFVILLA053	0	0
PFVILLAS	6.000.000	1.188
PFVILLAS00	0	0
PFVILLASCA	0	28
POPULAR	15.000.000	52.228
PROMIGAS	362.000.000	53.210
PROTECCION	0	0
RIOPAILA	0	0
RIOPAILIND	0	0
SANFELIPE	0	0
TERPEL	140.000.000	20.047
TGLSC	20.000.000	1.378
TITAN	0	0
VALINDUSTR	0	0
VALSIMESA	9.000.000	1.938
VILLAS	1.000.000	175

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 19 de agosto 2020 hasta el 24 de agosto de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	35.647.947
AGROCHAL	0
AMZN	4.242.408
BAC	64.784.413
BBVACOL	65.484
BCOLOMBIA	232.561
BMC	0
BOGOTA	13.762
BVC	35.676
C	19.994.285
CARTON	12.674
CELSIA	258.960
CEMARGOS	505.048
CLH	336.076
CNEC	158.451
COLTEJER	0
COLTEL	0
CONCIVILES	0
CONCONCRET	224.395
COOMEVAEPS	0
CORFERIAS	0
CORFICOLCF	62.363
CREDIFAMI	0
CSACOL	0
DESCAUCANO	0
ECOPETROL	26.318.847
ELCONDOR	72.279
ELECTULUA	0
EMPAQUES	0
ENKA	2.118.495
ESTRA	0
ETB	1.044.722
EXITO	34.442
FABRICATO	3.502.281
FAMILIA	2.114
FB	19.092.053

Nemotécnico	VMD acciones
FGNTOLIMA	0
GASNATURAL	176
GASORIENTE	0
GE	81.054.436
GEB	2.113.414
GRUBOLIVAR	2.159
GRUPOARGOS	508.673
GRUPOAVAL	35.877
GRUPOSURA	264.126
HCOLSEL	272.209
ICOLCAP	573.426
INCASTILLA	0
INESA	0
INVENSA	0
ISA	405.957
JNJ	6.701.944
JPM	17.173.583
MARLY	0
MAYAGUEZ	0
MINEROS	110.945
MOAT	484.737
NUTRESA	144.006
OCCIDENTE	1.063
ORBIS	0
PAZRIO	353.405
PFAVAL	14.913.335
PFAVH	3.384.246
PFBVACOL	27.500
PFBLOM	2.542.262
PFCARPAK	0
PFCMARGOS	64.270
PFCORFICOL	24.685
PFDVVNDA	123.298
PFE	25.841.851
PFGRUPOARG	50.171
PFGRUPSURA	59.959

Nemotécnico	VMD acciones
PFVILLA051	0
PFVILLA053	0
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	0
PFVILLASCA	28
POPULAR	52.228
PROMIGAS	53.210
PROTECCION	0
RIOPAILA	0
RIOPAILIND	0
SANFELIPE	0
TERPEL	20.047
TGLSC	1.378
TITAN	0
VALINDUSTR	0
VALSIMESA	1.938
VILLAS	175

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías