



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 07 de septiembre de 2020

No. 124

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 08 de septiembre 2020 hasta el 14 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.440.000.000	236.246
CELSIA	1.181.000.000	256.679
CEMARGOS	3.241.000.000	641.691
CORFICOLCF	1.771.000.000	64.924
ECOPETROL	57.571.000.000	26.839.536
GEB	4.884.000.000	2.017.988
GRUPOARGOS	5.288.000.000	429.951
GRUPOSURA	6.120.000.000	268.409

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.453.000.000	405.218
NUTRESA	3.501.000.000	152.502
PFAVAL	12.929.000.000	13.609.643
PFBCOLOM	70.867.000.000	2.554.690
PFDAVVNDA	3.664.000.000	123.531
PFGRUPSURA	1.357.000.000	71.140
ICOLCAP	7.974.000.000	630.345
BOGOTA	978.000.000	14.069

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de septiembre 2020 hasta el 14 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	44.169.214
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.356.871
BAC	1.000.000.000.000	65.205.884
BBVACOL	21.000.000	71.055
BCOLOMBIA	6.440.000.000	236.246
BMC	-	-
BOGOTA	978.000.000	14.069
BVC	391.000.000	32.941
C	1.000.000.000.000	20.351.916
CARTON	113.000.000	11.483
CELSIA	1.181.000.000	256.679
CEMARGOS	3.241.000.000	641.691
CLH	1.089.000.000	405.716
CNEC	1.231.000.000	120.706
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	94.000.000	253.399
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.771.000.000	64.924
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	57.571.000.000	26.839.536
ELCONDOR	75.000.000	71.017
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	29.000.000	3.921.451
ESTRA	-	-
ETB	205.000.000	990.724
EXITO	333.000.000	28.690
FABRICATO	17.000.000	3.272.001
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.049.546
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	79.429.311
GEB	4.884.000.000	2.017.988
GRUBOLIVAR	142.000.000	2.169
GRUPOARGOS	5.288.000.000	429.951
GRUPOAVAL	29.000.000	30.681
GRUPOSURA	6.120.000.000	268.409
HCOLSEL	4.014.000.000	344.078
ICOLCAP	7.974.000.000	630.345
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	8.453.000.000	405.218
JNJ	1.000.000.000.000	6.514.704
JPM	1.000.000.000.000	17.525.042
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	476.000.000	123.417
MOAT	98.520.000.000	471.023
NUTRESA	3.501.000.000	152.502
OCCIDENTE	34.000.000	958

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	949
PFAVAL	12.929.000.000	13.609.643
PFAVH	434.000.000	2.045.192
PFBBVACOL	5.000.000	18.469
PFBCOLOM	70.867.000.000	2.554.690
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	319.000.000	80.526
PFCORFICOL	567.000.000	25.760
PFDAVVNDA	3.664.000.000	123.531
PFE	1.000.000.000.000	26.088.779
PFGRUPOARG	542.000.000	59.112
PFGRUPSURA	1.357.000.000	71.140
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	6.000.000	1.188
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	-	28
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	393.000.000	54.637
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	153.000.000	19.144
TGLSC	1.000.000	35
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.938
VILLAS	1.000.000	169

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 08 de septiembre 2020 hasta el 14 de septiembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	44.169.214
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.356.871
BAC	65.205.884
BBVACOL	71.055
BCOLOMBIA	236.246
BMC	-
BOGOTA	14.069
BVC	32.941
C	20.351.916
CARTON	11.483
CELSIA	256.679
CEMARGOS	641.691
CLH	405.716
CNEC	120.706
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	253.399
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	64.924
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	26.839.536
ELCONDOR	71.017
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.921.451
ESTRA	-
ETB	990.724
EXITO	28.690
FABRICATO	3.272.001
FAMILIA	2.114
FB	20.049.546
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	79.429.311
GEB	2.017.988
GRUBOLIVAR	2.169
GRUPOARGOS	429.951
GRUPOAVAL	30.681
GRUPOSURA	268.409
HCOLSEL	344.078
ICOLCAP	630.345
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	405.218
JNJ	6.514.704
JPM	17.525.042
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	123.417
MOAT	471.023
NUTRESA	152.502
OCCIDENTE	958
ORBIS	-
PAZRIO	949
PFAVAL	13.609.643
PFAVH	2.045.192
PFBBVACOL	18.469
PFBCOLOM	2.554.690
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	80.526
PFCORFICOL	25.760
PFDVVNDA	123.531
PFE	26.088.779
PFGRUPOARG	59.112
PFGRUPSURA	71.140
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.188
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	28

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.361
PROMIGAS	54.637
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	19.144
TGLSC	35
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.938
VILLAS	169

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías