



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 28 de septiembre de 2020

No. 137

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 29 de septiembre 2020 hasta el 05 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.929.000.000	235.269
CELSIA	965.000.000	217.807
CEMARGOS	2.675.000.000	582.697
CORFICOLCF	1.555.000.000	58.533
ECOPETROL	53.050.000.000	27.630.366
GEB	3.084.000.000	1.243.746
GRUPOARGOS	3.194.000.000	288.298
GRUPOSURA	5.082.000.000	244.319

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	7.958.000.000	390.497
NUTRESA	3.311.000.000	148.998
PFAVAL	9.422.000.000	10.399.387
PFBCOLOM	53.449.000.000	2.129.443
PFDAVVNDA	3.184.000.000	116.625
PFGRUPSURA	1.208.000.000	66.899
ICOLCAP	7.192.000.000	599.696
BOGOTA	692.000.000	10.176

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de septiembre 2020 hasta el 05 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
AAPL	1.000.000.000.000	52.847.684
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.492.160
BAC	1.000.000.000.000	59.247.909
BBVACOL	12.000.000	40.540
BCOLOMBIA	5.929.000.000	235.269
BMC	-	-
BOGOTA	692.000.000	10.176
BVC	374.000.000	33.590
C	1.000.000.000.000	21.467.720
CARTON	81.000.000	8.237
CELSIA	965.000.000	217.807
CEMARGOS	2.675.000.000	582.697
CLH	1.197.000.000	426.639
CNEC	1.462.000.000	143.347
COLTEJER	-	272
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCONCRET	82.000.000	234.692
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.555.000.000	58.533
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	53.050.000.000	27.630.366
ELCONDOR	74.000.000	68.456
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	29.000.000	3.825.963
ESTRA	-	-
ETB	180.000.000	887.080
EXITO	297.000.000	26.962
FABRICATO	14.000.000	3.375.887
FAMILIA	9.000.000	2.114
FB	1.000.000.000.000	20.585.540
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	146
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	83.632.710
GEB	3.084.000.000	1.243.746
GRUBOLIVAR	108.000.000	1.681
GRUPOARGOS	3.194.000.000	288.298
GRUPOAVAL	28.000.000	31.346
GRUPOSURA	5.082.000.000	244.319
HCOLSEL	3.952.000.000	361.668
ICOLCAP	7.192.000.000	599.696
INCASTILLA	-	-
INESA	101.000.000	241.736
INVENSA	54.000.000	107.304
ISA	7.958.000.000	390.497
JNJ	1.000.000.000.000	6.000.433
JPM	1.000.000.000.000	17.854.349
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	403.000.000	111.948
MOAT	81.487.000.000	391.454
NUTRESA	3.311.000.000	148.998
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	21.807
PFAVAL	9.422.000.000	10.399.387
PFAVH	244.000.000	1.198.181
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	53.449.000.000	2.129.443
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	312.000.000	78.723
PFCORFICOL	549.000.000	25.531
PFDVVNDA	3.184.000.000	116.625
PFE	1.000.000.000.000	26.032.409
PFGRUPOARG	511.000.000	56.719
PFGRUPSURA	1.208.000.000	66.899
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	9.000.000	1.641
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	47.361
PROMIGAS	574.000.000	78.567
PROTECCION	-	-
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	38.000.000	79.783
TERPEL	202.000.000	24.733
TGLSC	27.000.000	1.395
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	9.000.000	1.781
VILLAS	1.000.000	163

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 29 de septiembre 2020 hasta el 05 de octubre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	52.847.684
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.492.160
BAC	59.247.909
BBVACOL	40.540
BCOLOMBIA	235.269
BMC	-
BOGOTA	10.176
BVC	33.590
C	21.467.720
CARTON	8.237
CELSIA	217.807
CEMARGOS	582.697
CLH	426.639
CNEC	143.347
COLTEJER	272
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	234.692
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	58.533
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	27.630.366
ELCONDOR	68.456
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.825.963
ESTRA	-
ETB	887.080
EXITO	26.962
FABRICATO	3.375.887
FAMILIA	2.114
FB	20.585.540
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	146
GASORIENTE	-
GE	83.632.710
GEB	1.243.746
GRUBOLIVAR	1.681
GRUPOARGOS	288.298
GRUPOAVAL	31.346
GRUPOSURA	244.319
HCOLSEL	361.668
ICOLCAP	599.696
INCASTILLA	-
INESA	241.736
INVENSA	107.304
ISA	390.497
JNJ	6.000.433
JPM	17.854.349
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	111.948
MOAT	391.454
NUTRESA	148.998
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	21.807
PFAVAL	10.399.387
PFAVH	1.198.181
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	2.129.443
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	78.723
PFCORFICOL	25.531
PFDVVNDA	116.625
PFE	26.032.409
PFGRUPOARG	56.719
PFGRUPSURA	66.899
PFVILLA051	-
PFVILLA053	-
PFVILLAS	1.641
PFVILLAS00	-
PFVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	47.361
PROMIGAS	78.567
PROTECCION	-
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	79.783
TERPEL	24.733
TGLSC	1.395
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	1.781
VILLAS	163

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías