



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 03 de noviembre de 2020

No. 155

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

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.807.000.000	237.002
CELSIA	799.000.000	189.912
CEMARGOS	2.453.000.000	538.613
CORFICOLCF	1.414.000.000	54.393
ECOPETROL	51.506.000.000	28.758.025
GEB	2.742.000.000	1.142.471
GRUPOARGOS	2.895.000.000	272.606
GRUPOSURA	4.752.000.000	236.442

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.710.000.000	321.682
NUTRESA	3.033.000.000	142.115
PFAVAL	9.064.000.000	10.184.001
PFBCOLOM	43.670.000.000	1.782.455
PFDAVVNDA	2.596.000.000	103.298
PFGRUPSURA	1.025.000.000	61.348
ICOLCAP	6.884.000.000	595.873
BOGOTA	688.000.000	10.116

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de noviembre 2020 hasta el 10 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	62.648.840
AGROCHAL	44.000.000	87.178
AMZN	1.000.000.000.000	4.666.750
BAC	1.000.000.000.000	57.563.750
BBVACOL	15.000.000	53.004
BCOLOMBIA	5.807.000.000	237.002
BMC	3.000.000	2.300
BOGOTA	688.000.000	10.116
BVC	245.000.000	23.977
C	1.000.000.000.000	22.774.183
CARTON	42.000.000	4.234
CELSIA	799.000.000	189.912
CEMARGOS	2.453.000.000	538.613
CLH	1.693.000.000	528.249
CNEC	2.353.000.000	223.845
COLTEJER	1.000.000	408
COLTEL	-	-
CONCIVILES	-	-
CONCRET	78.000.000	242.909
COOMEVAEPS	-	-
CORFERIAS	-	-
CORFICOLCF	1.414.000.000	54.393
CREDIFAMI	-	-

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
CSACOL	-	-
DESCAUCANO	-	-
ECOPETROL	51.506.000.000	28.758.025
ELCONDOR	32.000.000	34.587
ELECTULUA	-	-
EMPAQUES	-	-
ENKA	28.000.000	3.797.019
ESTRA	-	-
ETB	136.000.000	677.992
EXITO	221.000.000	20.583
FABRICATO	7.000.000	1.601.022
FAMILIA	-	-
FB	1.000.000.000.000	21.237.226
FGNTOLIMA	-	-
GASNATURAL	12.000.000	139
GASORIENTE	-	-
GE	1.000.000.000.000	89.376.669
GEB	2.742.000.000	1.142.471
GRUBOLIVAR	107.000.000	1.753
GRUPOARGOS	2.895.000.000	272.606
GRUPOAVAL	41.000.000	47.968
GRUPOSURA	4.752.000.000	236.442
HCOLSEL	4.548.000.000	427.120
ICOLCAP	6.884.000.000	595.873
INCASTILLA	-	-
INESA	56.000.000	134.199
INVENSA	44.000.000	87.120
ISA	6.710.000.000	321.682
JNJ	1.000.000.000.000	6.017.786
JPM	1.000.000.000.000	15.947.238
MARLY	-	-
MAYAGUEZ	-	-
MINEROS	390.000.000	108.395
MOAT	64.929.000.000	316.658
NUTRESA	3.033.000.000	142.115
OCCIDENTE	40.000.000	1.151

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ORBIS	-	-
PAZRIO	-	18.942
PFAVAL	9.064.000.000	10.184.001
PFAVH	156.000.000	990.573
PFBBVACOL	-	-
PFBCOLOM	43.670.000.000	1.782.455
PFCARPAK	-	-
PFCEMARGOS	274.000.000	73.844
PFCORFICOL	516.000.000	25.135
PFDAVVNDA	2.596.000.000	103.298
PFE	1.000.000.000.000	22.657.119
PFGRUPOARG	469.000.000	54.592
PFGRUPSURA	1.025.000.000	61.348
PFVILLA051	-	-
PFVILLA053	-	-
PFVILLAS	-	-
PFVILLAS00	-	-
PFVILLASCA	-	-
POPULAR	13.000.000	44.908
PROMIGAS	531.000.000	79.142
PROTECCION	5.000.000	41
RIOPAILA	-	-
RIOPAILIND	-	-
SANFELIPE	21.000.000	43.589
TERPEL	338.000.000	42.316
TGLSC	30.000.000	1.695
TITAN	-	-
VALINDUSTR	-	-
VALSIMESA	4.000.000	908
VILLAS	1.000.000	144

Los volúmenes Medios Diarios aplicables desde el 04 de noviembre 2020 hasta el 10 de noviembre de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones de contado son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
AAPL	62.648.840
AGROCHAL	87.178
AMZN	4.666.750
BAC	57.563.750
BBVACOL	53.004
BCOLOMBIA	237.002
BMC	2.300
BOGOTA	10.116
BVC	23.977
C	22.774.183
CARTON	4.234
CELSIA	189.912
CEMARGOS	538.613
CLH	528.249
CNEC	223.845
COLTEJER	408
COLTEL	-
CONCIVILES	-
CONCONCRET	242.909
COOMEVAEPS	-
CORFERIAS	-
CORFICOLCF	54.393
CREDIFAMI	-
CSACOL	-
DESCAUCANO	-
ECOPETROL	28.758.025
ELCONDOR	34.587
ELECTULUA	-
EMPAQUES	-
ENKA	3.797.019
ESTRA	-
ETB	677.992
EXITO	20.583
FABRICATO	1.601.022
FAMILIA	-
FB	21.237.226
FGNTOLIMA	-

Nemotécnico	VMD acciones
GASNATURAL	139
GASORIENTE	-
GE	89.376.669
GEB	1.142.471
GRUBOLIVAR	1.753
GRUPOARGOS	272.606
GRUPOAVAL	47.968
GRUPOSURA	236.442
HCOLSEL	427.120
ICOLCAP	595.873
INCASTILLA	-
INESA	134.199
INVENSA	87.120
ISA	321.682
JNJ	6.017.786
JPM	15.947.238
MARLY	-
MAYAGUEZ	-
MINEROS	108.395
MOAT	316.658
NUTRESA	142.115
OCCIDENTE	1.151
ORBIS	-
PAZRIO	18.942
PFAVAL	10.184.001
PFAVH	990.573
PFBBVACOL	-
PFBCOLOM	1.782.455
PFCARPAK	-
PFCEMARGOS	73.844
PFCORFICOL	25.135
PFDVVNDA	103.298
PFE	22.657.119
PFGRUPOARG	54.592
PFGRUPSURA	61.348
PVVILLA051	-
PVVILLA053	-
PVVILLAS	-
PVVILLAS00	-
PVVILLASCA	-

Nemotécnico	VMD acciones
POPULAR	44.908
PROMIGAS	79.142
PROTECCION	41
RIOPAILA	-
RIOPAILIND	-
SANFELIPE	43.589
TERPEL	42.316
TGLSC	1.695
TITAN	-
VALINDUSTR	-
VALSIMESA	908
VILLAS	144

Oscar A. Leiva Villamizar
Gerente