



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 06 de Agosto de 2018

No. 064

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 2.5.1.7. 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 327 70 00 opción 1 o a través de la cuenta de correo electrónico: operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co.

A. GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES

En caso 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 perteneciente al Segmento de Derivados Financieros cuyo subyacente sean Acciones o el Índice Accionario COLCAP, supere el 100% del Volumen Medio Diario, será considerada esta 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 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	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%

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 para los Activos elegibles de Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes y estarán vigentes desde el 08 de Agosto Hasta 13 de Agosto de 2018.

Nemotécnico	VMD Efectivo
ECOPETROL	35.109.978
PFBCOLOM	2.274.845
EXITO	310.089
ISA	358.423

Nemotécnico	VMD Efectivo
NUTRESA	107.735
PFGRUPSURA	88.107
CEMARGOS	397.175
PFAVAL	8.677.636
GRUPOARGOS	200.197
GRUPOSURA	226.681
PFCEMARGOS	94.003
BOGOTA	10.965
CELSIA	290.484
EEB	1.434.996
CORFICOLCF	88.400
PFAVH	310.852
PFDVVNDA	152.344
BCOLOMBIA	265.042
CLH	218.885
PFGRUPOARG	78.552
CNEC	37.058

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías

