



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 04 de junio de 2019

No. 068

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.3. 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	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 desde el 05 de junio 2019 hasta el 10 de junio de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.559.000.000	202.107
CELSIA	1.028.000.000	242.517
CEMARGOS	6.392.000.000	876.873
CORFICOLCF	2.677.000.000	114.686

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	71.910.000.000	26.007.343
GEB	5.146.000.000	2.427.584
EXITO	4.460.000.000	316.304
GRUPOARGOS	4.135.000.000	238.738
GRUPOSURA	9.543.000.000	286.919
ISA	6.846.000.000	422.584
NUTRESA	3.306.000.000	132.879
PFAVAL	8.031.000.000	6.834.511
PFBCOLOM	72.770.000.000	1.842.270
PFDVVNDA	4.198.000.000	110.022
PFGRUPSURA	2.345.000.000	77.385
ICOLCAP	6.795.000.000	452.189
BOGOTA	695.000.000	10.532
PFGRUPOARG	1.568.000.000	109.038

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías