



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 17 de junio de 2019

No. 074

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 18 de junio 2019 hasta el 25 de junio de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.547.000.000	197.772
CELSIA	934.000.000	219.775
CEMARGOS	6.412.000.000	878.402
CORFICOLCF	2.833.000.000	113.664

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	70.520.000.000	25.276.119
GEB	5.126.000.000	2.351.372
EXITO	4.863.000.000	335.373
GRUPOARGOS	3.988.000.000	233.213
GRUPOSURA	9.141.000.000	272.039
ISA	8.095.000.000	431.511
NUTRESA	2.860.000.000	110.256
PFAVAL	8.874.000.000	7.273.407
PFBCOLOM	73.802.000.000	1.846.907
PFDVVNDA	4.577.000.000	114.417
PFGRUPSURA	2.602.000.000	84.381
ICOLCAP	7.131.000.000	461.854
BOGOTA	690.000.000	10.404
PFGRUPOARG	1.554.000.000	111.003

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías