



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 25 de junio de 2019

No. 075

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 26 de junio 2019 hasta el 02 de julio de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.410.000.000	217.870
CELSIA	877.000.000	205.371
CEMARGOS	6.616.000.000	877.465
CORFICOLCF	2.485.000.000	98.594

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	75.710.000.000	25.069.581
GEB	3.920.000.000	1.836.075
EXITO	4.826.000.000	334.187
GRUPOARGOS	3.800.000.000	217.635
GRUPOSURA	7.933.000.000	230.339
ISA	8.174.000.000	430.647
NUTRESA	3.632.000.000	144.706
PFAVAL	8.965.000.000	7.003.987
PFBCOLOM	74.934.000.000	1.832.119
PFDVVNDA	4.415.000.000	110.655
PFGRUPSURA	2.601.000.000	81.832
ICOLCAP	7.282.000.000	460.961
BOGOTA	641.000.000	9.365
PFGRUPOARG	887.000.000	63.351

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías