



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 20 de agosto de 2019

No. 099

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 21 de agosto 2019 hasta el 26 de agosto de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	10.076.000.000	248.169
CELSIA	902.000.000	204.100
CEMARGOS	3.934.000.000	541.861
CORFICOLCF	2.737.000.000	103.275
ECOPETROL	55.834.000.000	20.303.256
GEB	3.323.000.000	1.567.515
EXITO	6.783.000.000	393.451

GRUPOARGOS	3.416.000.000	215.909
GRUPOSURA	7.176.000.000	222.713
ISA	8.211.000.000	456.169
NUTRESA	3.715.000.000	145.559
PFAVAL	7.436.000.000	6.021.032
PFBCOLOM	67.783.000.000	1.561.824
PFDAVVNDA	4.967.000.000	118.260
PFGRUPSURA	2.260.000.000	74.228
ICOLCAP	7.608.000.000	487.711
BOGOTA	688.000.000	9.805
PFGRUPOARG	906.000.000	67.493

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías