



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 09 de septiembre de 2019

No. 108

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 10 de septiembre 2019 hasta el 16 de septiembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.870.000.000	228.490
CELSIA	837.000.000	193.410
CEMARGOS	4.676.000.000	605.648
CORFICOLCF	2.174.000.000	82.960
ECOPETROL	56.738.000.000	20.048.708
GEB	3.295.000.000	1.528.822
EXITO	7.117.000.000	403.926

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOARGOS	4.594.000.000	250.245
GRUPOSURA	7.273.000.000	217.369
ISA	8.832.000.000	464.359
NUTRESA	3.671.000.000	143.979
PFAVAL	7.333.000.000	5.796.816
PFBCOLOM	65.540.000.000	1.560.469
PFDAVVNDA	4.524.000.000	110.135
PFGRUPSURA	2.180.000.000	70.632
ICOLCAP	7.788.000.000	490.413
BOGOTA	693.000.000	9.507
PFGRUPOARG	1.002.000.000	71.539

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías