



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 30 de septiembre de 2019

No. 123

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 01 de octubre 2019 hasta el 07 de octubre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.799.000.000	199.986
CELSIA	1.003.000.000	224.999
CEMARGOS	6.969.000.000	926.699
CORFICOLCF	2.562.000.000	92.161
ECOPETROL	61.602.000.000	20.602.661
GEB	3.622.000.000	1.650.305
GRUPOARGOS	6.171.000.000	354.646
EXITO	7.241.000.000	410.929

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	7.966.000.000	241.091
ISA	8.189.000.000	442.654
NUTRESA	3.128.000.000	123.426
PFAVAL	7.514.000.000	5.825.062
PFBCOLOM	64.520.000.000	1.490.750
PFDAVVNDA	4.636.000.000	110.434
PFGRUPSURA	1.851.000.000	61.715
ICOLCAP	8.344.000.000	517.592
BOGOTA	885.000.000	11.061
PFGRUPOARG	855.000.000	63.310

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías