



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 07 de octubre de 2019

No. 125

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 08 de octubre 2019 hasta el 15 de octubre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.307.000.000	206.119
CELSIA	964.000.000	221.898
CEMARGOS	7.142.000.000	942.260
CORFICOLCF	2.611.000.000	92.314
ECOPETROL	61.041.000.000	20.762.395
GEB	3.605.000.000	1.631.085
GRUPOARGOS	6.589.000.000	372.288
EXITO	7.312.000.000	414.966

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.474.000.000	257.575
ISA	8.378.000.000	442.797
NUTRESA	3.059.000.000	119.136
PFAVAL	7.541.000.000	5.801.110
PFBCOLOM	66.196.000.000	1.514.789
PFDAVVNDA	4.605.000.000	109.426
PFGRUPSURA	2.004.000.000	67.235
ICOLCAP	8.501.000.000	528.179
BOGOTA	909.000.000	11.367
PFGRUPOARG	983.000.000	72.466

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías