



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 28 de octubre de 2019

No. 134

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 29 de octubre 2019 hasta el 05 de noviembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.918.000.000	190.800
CELSIA	914.000.000	210.128
CEMARGOS	6.047.000.000	823.813
CORFICOLCF	1.979.000.000	68.486
ECOPETROL	60.881.000.000	19.993.685
GEB	3.783.000.000	1.727.599
GRUPOARGOS	6.147.000.000	334.802
EXITO	7.480.000.000	418.788

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.341.000.000	251.533
ISA	7.804.000.000	390.200
NUTRESA	2.889.000.000	111.537
PFAVAL	8.647.000.000	6.405.409
PFBCOLOM	68.284.000.000	1.549.091
PFDAVVNDA	4.727.000.000	108.925
PFGRUPSURA	2.467.000.000	82.236
ICOLCAP	9.139.000.000	555.421
BOGOTA	959.000.000	11.313
PFGRUPOARG	1.005.000.000	72.116

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías