



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 25 de noviembre de 2019

No. 145

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 26 de noviembre 2019 hasta el 2 de diciembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.500.000.000	176.890
CELSIA	912.000.000	207.327
CEMARGOS	6.154.000.000	929.647
CORFICOLCF	2.113.000.000	73.356
ECOPETROL	56.770.000.000	17.908.372
GEB	3.884.000.000	1.785.738
GRUPOARGOS	5.691.000.000	311.989
EXITO	8.295.000.000	552.980

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.430.000.000	250.580
ISA	5.843.000.000	312.780
NUTRESA	2.681.000.000	105.144
PFAVAL	8.830.000.000	6.307.279
PFBCOLOM	62.926.000.000	1.420.459
PFDAVVNDA	3.790.000.000	87.213
PFGRUPSURA	3.183.000.000	112.698
ICOLCAP	9.690.000.000	596.950
BOGOTA	940.000.000	11.468
PFGRUPOARG	1.050.000.000	78.494

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías