



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 09 de noviembre de 2019

No. 154

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

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	7.980.000.000	189.993
CELSIA	1.121.000.000	253.540
CEMARGOS	8.633.000.000	1.338.473
CORFICOLCF	2.206.000.000	75.549
ECOPETROL	58.631.000.000	17.767.037
GEB	4.028.000.000	1.839.074
GRUPOARGOS	5.632.000.000	318.576
EXITO	6.913.000.000	523.701

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.505.000.000	257.883
ISA	6.202.000.000	335.230
NUTRESA	3.035.000.000	118.545
PFAVAL	9.440.000.000	6.671.547
PFBCOLOM	66.246.000.000	1.511.769
PFDAVVNDA	4.428.000.000	104.178
PFGRUPSURA	4.653.000.000	166.176
ICOLCAP	9.776.000.000	598.189
BOGOTA	991.000.000	11.522
PFGRUPOARG	1.037.000.000	79.136

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías