



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 23 de diciembre de 2019

No. 161

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 23 de diciembre 2019 hasta el 27 de diciembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.315.000.000	190.186
CELSIA	1.167.000.000	266.446
CEMARGOS	9.433.000.000	1.363.080
CORFICOLCF	2.106.000.000	69.038
ECOPETROL	51.672.000.000	15.563.878
GEB	4.013.000.000	1.815.820
GRUPOARGOS	5.847.000.000	318.451

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.867.000.000	269.037
ISA	5.790.000.000	310.615
NUTRESA	3.094.000.000	124.270
PFAVAL	10.322.000.000	7.168.055
PFBCOLOM	70.754.000.000	1.534.797
PFDAVVNDA	4.349.000.000	98.942
PFGRUPSURA	5.014.000.000	176.562
ICOLCAP	9.890.000.000	591.532
BOGOTA	985.000.000	11.318
PFGRUPOARG	979.000.000	74.180

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías