BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 21 de febrero de 2020

No. 021

ASUNTO: PUESTA EN PRODUCCIÓN DE LA CONSULTA DEL ESTRÉS TEST DE LA GARANTÍA COLECTIVA EN EL PORTAL WEB 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: <u>operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co</u>.

A. ESTRÉS TEST DE LA GARANTÍA COLECTIVA

Con el fin que los Miembros de la Cámara puedan replicar completamente el modelo de riesgos, atendiendo las recomendaciones del mercado, IOSCO y los Principios para Infraestructuras del Mercado Financiero (PFMI), a partir del 24 de febrero del 2020 se encontrará disponible para los Miembros Liquidadores una consulta en el Portal Web de la CRCC, la cual es calculada diariamente, con la siguiente información: i) el saldo definitivo agregado de los dos Miembros Liquidadores con mayor exposición al riesgo de cada Segmento; ii) el Importe del Fondo de Garantía Colectiva de cada Segmento restando las Aportaciones agregadas de los dos Miembros Liquidadores con mayor saldo definitivo; y iii) el saldo definitivo del Miembro Liquidador que realiza la consulta.

Para poder acceder a esta consulta, es necesario que el Administrador del Portal Web de cada Miembro realice el siguiente procedimiento:



1. Acceder al Portal Web de la CRCC a la opción Administrar usuarios.

2. Seleccionar al usuario del Portal Web al cual se le quiera otorgar permisos para realizar la consulta y quitar los permisos sobre el menú Operativa diaria.

* + Administrar Usuarios + Administrar Usuarios + Agregar Usuario			
Administrar Usuarios			
Agregar Usuario Mostrar siolo los usuarios en los que: Totor x	Estado * Activo * Dirección IP null segresar lab direccióntel (P* segarados por []		
astado: D Hitro Opcienes de actualización: Seleccione * P Actu	Módulos		
Nombre de Usuario 0		edulos	Operaciones Editar
Constantiation x Constant and the second se	Otasis Mercado Ocenta Propiosi Educidador Individual OP-Cuenta Progras del Miembro Liquidador Individual OF-Cuenta de Terceros del Miembro Liquidador Individual T-Cuenta de Terceros del Miembro Liquidador Individual OF-Cuenta de Terceros del Miembro Liquidador Individual OF-Cuenta de Terceros del Miembro Liquidador Individual OF-Cuenta de Terceros del Miembro Liquidador Individual		

- 3. Guardar la modificación a los permisos.
- 4. Volver a seleccionar al usuario del Portal Web sobre el que se quieren otorgar los permisos y seleccionar el menú de Operativa Diaria

		🛪 🖹 Manuales 🛔 sadmon	
* + Administrar Usuarios + Administrar Usuarios + Agregar Usuario			
Administrar Usuarios	VAUE ID		
+ Agregar Usuario	Estado * Activo *		
Mostrar sólo los usuarios en los que: Estado: Todos "	Direction IP null Impreseriable directionable (IP's separadas por []		
Opciones de actualización: Selectone • Actu	Mdoluks " Mdoloto " Stream and the second s		
Nombre de Usuario 🍳	Scuertas regiona del miemetro Lapudador Individual Contabilidad Contabilidad Encres del Miembro Liquidador Individual Contabilidad		
Juan Selection Choris Planar	Informes Alustes Gobierno Corporativo Administrar Usuarios ♥ Datas Mericado ♥ Openativo Diciria]		Editar
Superior dates a:	OP-Cuenta Propias del Miembro Luguidador Individual On-Cuenta de Proceso del Miembro Luguidador Individual T-Cuentas Propias del Miembro Luguidador Individual T-Cuentas Propias del Miembro Luguidador Individual Ocestion Garantiae		

- 5. Guardar la modificación realizada.
- Para comprobar que el procedimiento se realizó de manera correcta, el usuario sobre el cual se modificaron los permisos deberá ingresar al Portal Web de la CRCC y validar que tenga habilitada la opción Stress Test de la Garantía Colectiva

	000						*	D Manu	ales 🛔	rhenao	
Datos del Mercado		liquidación									
Operativa Diaria	•	Cuentas >									
% Tarifas	•	Miembro No Liquidador Operaciones									
Administración del Sistema		* Operaciones	and the second		CRCC+CI		to Central de l	Contraparte	0.000	a dimine P	·
		Posición Abierta >	Fecha 01/			= 21/02/202			O Buscar	2 Limpiar Po	rmulario
Simuladores		* Posición Abierta	Dep. D Negociació		Miembro		Cuenta CRCC ¢	Tipo IL :	Titulos o		
Banco de la Republica		Garantías > • Garantías Diarias, Depositadas y Exigidas	22								
Gestión Garantías		" Detalle de Garantías Depositadas	1	20							1
+ SAS	•	 Movimiento Garantias Riesgo en Situación de Estrés Test 	al: 244								
3 Simultaneas		Stress Test de la Garantía Colectiva Primas >									
 Renta Variable 		Consulta Prima Opciones Variation Margin >									
Contado		 ** Variation Margin ** Variation Margin Pendiente 									
		Tablas Garantías									
https://10.211.28.112/PortalWeb/faces/pages/o	operacionDiar	ia/garantias/garantiasEstresTestColectiva.xhtml	_								

Una vez los permisos se hayan otorgado, el usuario podrá acceder a la siguiente pantalla, en la que podrá consultar, con fecha de la sesión anterior, el saldo definitivo del Miembro Liquidador en cada Segmento, su ranking diario frente a los saldos definitivos de los demás Miembros Liquidadores participantes en cada Segmento, la suma de los saldos definitivos de los dos Miembros con mayor exposición y el Importe del Fondo de Garantía Colectiva de cada Segmento, restando las Aportaciones de los dos Miembros Liquidadores con mayor exposición

			🌴 🖺 Manuales 🛔 dpulido
rantías + Stress Test dela Garantía Colectiva			
s Test dela Garantía Colectiva			
			Seleccione Fecha: 20/02/2020 8 P Buscar P Limplar Formulari
Segmento C2		Segmento C7	
Posición Miembro	Saldo Definitivo	Posición Miembro	Saldo Definitivo
3 M	\$3.00	2 M	\$3.97
(1 of 1)	1 3 .	(1 of	(1) 14 44 1 80 81 3
	Total: 1		Total: 1
Sumatoria de saldos definitivo Resto Fondo de Garantía	os \$15.878.102.704 as \$84.950.000.000	Sumatoria de s Resto For	saldos definitivos \$9.634.486.389 ndo de Garantías \$114.500.000.000
Segmento Renta Variable C8 y CV		Segmento C9	
Posición Miembro	Saldo Definitivo	Posición Miembro	Saldo Definitivo
2 8	\$4.35		No hay Stress Test para este segmento.
(1 of 1) 🚥 🤜	1	(1	of 1) 14 44 30 31
1	Total: 1		Total: 0
Sumatoria de saldos definitivo	\$9.619.935.601	Sumatoria de s	aldos definitivos \$0
Resto Fondo de Garantía	\$8,640,000,000	Resto Fo	ndo de Garantías \$1.680.000.000

Jaime Andrés Restrepo Subgerente de Riesgo y Metodologías