



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 09 de marzo de 2020

No. 030

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.4. 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	28%
Entre un 150% y 200%	4	52%
Mayor a un 200%	5	73%

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 marzo 2020 hasta el 16 de marzo de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.357.000.000	145.976
CELSIA	1.080.000.000	236.523
CEMARGOS	3.395.000.000	672.336
CORFICOLCF	2.668.000.000	83.361
ECOPETROL	59.362.000.000	20.020.831
GEB	5.016.000.000	2.051.590
GRUPOARGOS	3.785.000.000	239.882
GRUPOSURA	6.274.000.000	210.244

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.230.000.000	344.194
NUTRESA	2.945.000.000	124.578
PFAVAL	10.512.000.000	7.562.846
PFBCOLOM	68.077.000.000	1.769.142
PFDAVVNDA	4.317.000.000	111.562
PFGRUPSURA	3.699.000.000	142.257
ICOLCAP	9.850.000.000	644.233
BOGOTA	806.000.000	9.175

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías