



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 30 de marzo de 2020

No. 042

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	33%
Entre un 150% y 200%	4	62%
Mayor a un 200%	5	90%

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 31 de marzo 2020 hasta el 06 de abril de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	4.842.000.000	188.395
CELSIA	1.068.000.000	254.384
CEMARGOS	3.220.000.000	805.001
CORFICOLCF	2.090.000.000	83.595
ECOPETROL	42.564.000.000	22.883.677
GEB	4.744.000.000	2.166.311
GRUPOARGOS	3.659.000.000	268.237
GRUPOSURA	5.159.000.000	234.502

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	6.742.000.000	406.162
NUTRESA	2.602.000.000	133.315
PFAVAL	7.705.000.000	8.375.151
PFBCOLOM	52.643.000.000	1.939.682
PFDAVVNDA	3.782.000.000	123.985
PFGRUPSURA	2.331.000.000	137.141
ICOLCAP	7.495.000.000	637.381
BOGOTA	879.000.000	11.859

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías