



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 11 de mayo de 2020

No. 061

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 12 de mayo 2020 hasta el 18 de mayo de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

| Nemotécnico | VMD Efectivo | VMD acciones |
|-------------|----------------|--------------|
| BCOLOMBIA | 4.764.000.000 | 198.502 |
| CELSIA | 1.029.000.000 | 241.341 |
| CEMARGOS | 3.104.000.000 | 836.753 |
| CORFICOLCF | 2.014.000.000 | 78.074 |
| ECOPETROL | 49.907.000.000 | 24.464.333 |
| GEB | 4.613.000.000 | 2.116.047 |
| GRUPOARGOS | 2.562.000.000 | 288.563 |
| GRUPOSURA | 4.904.000.000 | 240.173 |

| Nemotécnico | VMD Efectivo | VMD acciones |
|--------------------|---------------------|---------------------|
| ISA | 7.559.000.000 | 424.679 |
| NUTRESA | 3.226.000.000 | 141.985 |
| PFAVAL | 7.543.000.000 | 9.370.778 |
| PFBCOLOM | 52.198.000.000 | 2.130.521 |
| PFDAVVNDA | 3.471.000.000 | 127.524 |
| PFGRUPSURA | 2.476.000.000 | 136.178 |
| ICOLCAP | 6.625.000.000 | 585.937 |
| BOGOTA | 699.000.000 | 11.124 |

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías