



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 23 de junio de 2020

No. 084

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 24 de junio 2020 hasta el 30 de junio de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	6.072.000.000	221.755
CELSIA	872.000.000	214.171
CEMARGOS	2.176.000.000	588.209
CORFICOLCF	1.672.000.000	58.669
ECOPETROL	55.190.000.000	25.789.920
GEB	5.625.000.000	2.267.973
GRUPOARGOS	5.442.000.000	501.099
GRUPOSURA	5.088.000.000	263.610

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.105.000.000	429.733
NUTRESA	3.039.000.000	147.533
PFAVAL	12.005.000.000	14.123.534
PFBCOLOM	63.047.000.000	2.379.149
PFDVVNDA	3.817.000.000	127.220
PFGRUPSURA	1.624.000.000	102.409
ICOLCAP	5.976.000.000	507.524
BOGOTA	944.000.000	13.788

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías