



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de julio de 2020

No. 095

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 14 de julio 2020 hasta el 21 de julio de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.360.000.000	214.582
CELSIA	938.000.000	223.313
CEMARGOS	1.392.000.000	379.731
CORFICOLCF	1.334.000.000	51.357
ECOPETROL	53.961.000.000	25.942.932
GEB	5.088.000.000	2.124.269
GRUPOARGOS	5.146.000.000	500.597
GRUPOSURA	5.342.000.000	263.397

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.292.000.000	420.908
NUTRESA	2.895.000.000	137.617
PFAVAL	12.260.000.000	14.389.664
PFBCOLOM	62.331.000.000	2.448.205
PFDAVVNDA	2.615.000.000	89.858
PFGRUPSURA	1.149.000.000	68.945
ICOLCAP	5.362.000.000	458.876
BOGOTA	874.000.000	13.625

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías