



Boletín informativo

No.012 / Enero 25 de 2021

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 2.5.1.7. 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 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 perteneciente al Segmento de Derivados Financieros, supere el 100% del Volumen Medio Diario, será considerada esta 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)
Entre un 100% y 150%	3
Entre un 150% y 200%	4
Mayor a un 200%	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	22%
Entre un 150% y 200%	4	41%
Mayor a un 200%	5	58%

El incremento de las fluctuaciones 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 26 de enero 2021 hasta el 01 de febrero de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
BCOLOMBIA	242.411
BOGOTA	7.266
CELSIA	194.365



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CEMARGOS	500.526
CLH	606.717
CNEC	175.559
CORFICOLCF	67.421
ECOPETROL	30.347.643
EXITO	15.742
GEB	963.166
GRUPOARGOS	206.825
GRUPOSURA	272.527
ISA	301.839
NUTRESA	132.214
PFAVAL	8.535.278
PFBCOLOM	1.628.056
PFCEMARGOS	80.590
PFDAVVNDA	123.801
PFGRUPOARG	47.182
PFGRUPSURA	92.820
BVC	30.403
ICOLCAP	495.100

El Volumen Medio Diario considerado para los productos cuyo subyacente sean Títulos sobre de Deuda Pública TES del Segmento de Derivados Financieros es el siguiente:

Subyacente	Número de contratos
Activos cuyo subyacente sean Títulos sobre de Deuda Pública TES	Dos mil (2.000)

Estos valores se actualizarán por lo menos una vez al año

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías