



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 26 de diciembre de 2017

No. 057

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.3. 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 Operaciones y Riesgos de la CRCC S.A. vía telefónica al número 327 70 00 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 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)	
	Mínimo	Máximo
Hasta un 100%	1	2
Hasta un 200%	2	4
Mayor a un 300%	3	6

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 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 27 de Diciembre de 2017 hasta el 03 de Enero de 2018 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
BCOLOMBIA	9.433.000.000	318.688
BOGOTA	1.206.000.000	17.630
CELSIA	930.000.000	193.977

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
CEMARGOS	3.789.000.000	332.398
CLH	2.006.000.000	186.048
CNEC	854.000.000	82.437
CORFICOLCF	2.478.000.000	85.744
ECOPETROL	62.010.000.000	30.622.151
EEB	2.415.000.000	1.195.333
EXITO	7.008.000.000	425.744
GRUPOARGOS	5.817.000.000	279.940
GRUPOSURA	6.058.000.000	148.914
ISA	4.610.000.000	322.854
NUTRESA	2.126.000.000	75.946
PFAVAL	9.315.000.000	7.192.899
PFAVH	1.633.000.000	546.247
PFBCOLOM	70.626.000.000	2.386.011
PFCEMARGOS	856.000.000	87.393
PFDVVNDA	4.748.000.000	160.192
PFGRUPOARG	1.295.000.000	69.619
PFGRUPSURA	3.093.000.000	79.749