



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de Agosto de 2018

No. 066

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 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 perteneciente al Segmento de Derivados Financieros cuyo subyacente sean Acciones o el Índice Accionario COLCAP, 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)
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	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 para los Activos elegibles de Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes y estarán vigentes desde el 14 de Agosto Hasta 21 de Agosto de 2018.

Nemotécnico	VMD Efectivo
ECOPETROL	33.968.896
PFBCOLOM	2.068.600
EXITO	307.129
ISA	358.248

Nemotécnico	VMD Efectivo
NUTRESA	105.927
PFGRUPSURA	87.957
CEMARGOS	392.759
PFAVAL	8.759.815
GRUPOARGOS	199.590
GRUPOSURA	227.884
PFCEMARGOS	100.428
BOGOTA	11.313
CELSIA	310.749
EEB	1.472.463
CORFICOLCF	89.617
PFAVH	335.832
PFDVVNDA	153.046
BCOLOMBIA	247.752
CLH	222.717
PFGRUPOARG	80.089
CNEC	35.133

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías