



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 01 de Octubre de 2018

No. 087

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 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 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	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 Repo son los siguientes y estarán vigentes desde el 02 de Octubre Hasta 08 de Octubre de 2018.

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	120.462.000.000	120.462.000.000
PFBCOLOM	59.667.000.000	59.667.000.000
ISA	4.091.000.000	4.091.000.000
NUTRESA	2.503.000.000	2.503.000.000

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFAVAL	10.383.000.000	10.383.000.000
EXITO	3.879.000.000	3.879.000.000
GRUPOARGOS	3.905.000.000	3.905.000.000
GRUPOSURA	8.718.000.000	8.718.000.000
PFGRUPSURA	3.221.000.000	3.221.000.000
CEMARGOS	3.248.000.000	3.248.000.000
BCOLOMBIA	5.118.000.000	5.118.000.000
CLH	1.367.000.000	1.367.000.000
CORFICOLCF	1.994.000.000	1.994.000.000
EEB	2.897.000.000	2.897.000.000
PFAVH	741.000.000	741.000.000
PFDAVVNDA	4.983.000.000	4.983.000.000
PFGRUPOARG	1.376.000.000	1.376.000.000
CELSIA	1.546.000.000	1.546.000.000
ICOLCAP	5.314.000.000	5.314.000.000

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías