



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 16 de septiembre de 2019

No. 113

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 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	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 03 de septiembre 2019 hasta el 09 de septiembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.806.000.000	220.931
CELSIA	934.000.000	214.769
CEMARGOS	4.671.000.000	616.280
CORFICOLCF	2.071.000.000	78.987
ECOPETROL	58.960.000.000	20.331.079
GEB	3.367.000.000	1.548.217
GRUPOARGOS	4.624.000.000	258.920

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	6.926.000.000	204.921
ISA	8.969.000.000	464.740
NUTRESA	3.581.000.000	141.524
PFAVAL	7.381.000.000	5.721.653
PFBCOLOM	66.876.000.000	1.585.479
PFDAVVNDA	4.553.000.000	109.967
PFGRUPSURA	1.960.000.000	62.615
ICOLCAP	7.896.000.000	494.653
BOGOTA	719.000.000	9.715
PFGRUPOARG	955.000.000	68.823

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías