



Boletín informativo

No.053 / Abril 05 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 06 de abril 2021 hasta el 12 de abril de 2021 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
BCOLOMBIA	257,198
BOGOTA	5,889
CELSIA	215,680



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
CEMARGOS	389,832
CLH	38,112
CNEC	132,651
CORFICOLCF	64,153
ECOPETROL	32,541,363
EXITO	11,141
GEB	1,843,321
GRUPOARGOS	168,449
GRUPOSURA	273,607
ISA	321,175
NUTRESA	132,971
PFAVAL	7,738,971
PFBCOLOM	1,474,008
PFCEMARGOS	53,932
PFDAVVNDA	131,489
PFGRUPOARG	25,295
PFGRUPSURA	55,299
BVC	40,201
ICOLCAP	554,578





Boletín informativo

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