



Boletín informativo

No.088 / 27 de octubre de 2022

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO CON 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 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 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 125%	2.5
Entre un 125% 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 con el incremento del horizonte de tiempo (días) necesario para cerrar la posición según se muestra en la siguiente tabla:



Boletín informativo

% Sobre el Volumen Medio Diario	Horizonte de Tiempo (días)	% de incremento en la Garantía por Posición.
Entre un 100% y 125%	2.5	14%
Entre un 125% y 150%	3	28%
Entre un 150% y 200%	4	52%
Mayor a un 200%	5	73%

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 el 28 de octubre de 2022 hasta el 28 de noviembre de 2022 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
BCOLOMBIA	141.953
BOGOTA	6.253
CELSIA	199.118
CEMARGOS	279.095
CLH	258.782
CNEC	65.899
CORFICOLCF	41.173
ECOPETROL	33.551.151
EXITO	53.511
GEB	809.263
GRUPOARGOS	126.950



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
GRUPOSURA	36.338
ISA	231.573
NUTRESA	19.730
PFAVAL	4.354.624
PFBCOLOM	1.589.621
PFCEMARGOS	34.415
PFDVVNDA	74.295
PFGRUPOARG	26.365
PFGRUPSURA	34.002
BVC	9.181
ICOLCAP	155.586

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	Quinientos (500)

Estos valores se actualizarán por lo menos una vez al año.

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías