



Boletín informativo

No.027 / 09 de junio de 2023

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%	3.0
Entre un 150% y 200%	4.0
Mayor a un 200%	5.0

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	14.0%
Entre un 125% y 150%	3.0	28.0%
Entre un 150% y 200%	4.0	52.0%
Mayor a un 200%	5.0	73.0%

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 a partir del 13 de junio de 2023 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
BCOLOMBIA	203.266
BOGOTA	19.153
CELSIA	228.049
CEMARGOS	895.486
CLH	5.751
CNEC	6.425
CORFICOLCF	142.409
ECOPETROL	52.094.615
EXITO	13.726
GEB	671.988



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD acciones
GRUPOARGOS	113.971
GRUPOSURA	202.226
ISA	289.814
NUTRESA	32.335
PFAVAL	4.252.511
PFBCOLOM	2.026.123
PFCEMARGOS	51.087
PFDAVVNDA	101.350
PFGRUPOARG	21.644
PFGRUPSURA	48.064
BVC	63.139
ICOLCAP	357.976

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 de Deuda Pública TES	Quinientos (500)

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

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgos y Metodologías