



No.026 / 31 de mayo de 2024

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 4 de junio de 2024 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
BCOLOMBIA	496,803	16,590,000,000
BOGOTA	22,416	660,000,000
BVC	2,222	30,000,000
CELSIA	526,456	2,090,000,000
CEMARGOS	750,220	6,160,000,000
CNEC	30,533	430,000,000
CORFICOLCF	100,584	1,520,000,000
ECOPETROL	46,034,047	102,660,000,000
EXITO	171,882	410,000,000
GEB	1,701,743	4,020,000,000
GRUPOARGOS	396,733	6,210,000,000
GRUPOSURA	40,847	1,320,000,000
ICOLCAP	306,906	4,210,000,000
ISA	501,531	9,380,000,000
NUTRESA	13,086	590,000,000
PFAVAL	6,601,576	2,880,000,000
PFBCOLOM	1,839,804	60,830,000,000
PFCEMARGOS	85,185	590,000,000



Boletín informativo

Nemotécnico	VMD Acciones	VMD Efectivo
PFDVVNDA	83,611	1,800,000,000
PFGRUPOARG	89,343	1,030,000,000
PFGRUPSURA	158,345	3,360,000,000

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