



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 12 de Febrero de 2018

No. 010

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 Operaciones y Riesgos de la CRCC S.A. vía telefónica al número 327 70 00 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 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)	
	Mínimo	Máximo
Hasta un 100%	1	2
Hasta un 200%	2	4
Mayor a un 300%	3	6

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 13 de Febrero hasta el 19 de Febrero de 2018 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
BCOLOMBIA	8.227.000.000	264.544
BOGOTA	792.000.000	12.001
CELSIA	1.193.000.000	249.685

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
CEMARGOS	2.940.000.000	279.990
CLH	2.679.000.000	260.049
CNEC	833.000.000	84.114
CORFICOLCF	1.975.000.000	77.263
ECOPETROL	96.733.000.000	39.563.397
EEB	2.295.000.000	1.135.918
EXITO	7.754.000.000	443.101
GRUPOARGOS	4.746.000.000	236.821
GRUPOSURA	5.654.000.000	147.230
ISA	4.454.000.000	318.159
NUTRESA	2.502.000.000	92.666
PFAVAL	7.057.000.000	5.668.479
PFAVH	1.499.000.000	526.859
PFBCOLOM	57.098.000.000	1.826.555
PFCEMARGOS	770.000.000	88.148
PFDVVNDA	5.125.000.000	164.671
PFGRUPOARG	1.186.000.000	67.226
PFGRUPSURA	2.560.000.000	70.902