



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 05 de Marzo de 2018

No. 013

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 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 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 06 de Marzo hasta el 12 de Marzo de 2018 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
BCOLOMBIA	8.460.000.000	277.029
BOGOTA	843.000.000	12.675
CELSIA	1.453.000.000	322.942

Nemotécnico	VMP Efectivo	VMP acciones
CEMARGOS	2.424.000.000	252.541
CLH	2.290.000.000	243.651
CNEC	637.000.000	67.750
CORFICOLCF	1.539.000.000	65.780
ECOPETROL	102.030.000.000	41.140.971
EEB	2.865.000.000	1.421.600
EXITO	7.882.000.000	476.558
GRUPOARGOS	4.553.000.000	246.102
GRUPOSURA	6.025.000.000	158.133
ISA	4.340.000.000	328.764
NUTRESA	2.518.000.000	93.877
PFAVAL	6.434.000.000	5.252.077
PFAVH	2.503.000.000	794.731
PFBCOLOM	48.683.000.000	1.609.898
PFCEMARGOS	794.000.000	99.261
PFDVVNDA	5.066.000.000	168.874
PFGRUPOARG	1.024.000.000	62.758
PFGRUPSURA	2.781.000.000	80.506