



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 24 de septiembre de 2018

No. 085

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A 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 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 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 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 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 25 de septiembre hasta el 01 de octubre de 2018 para los Activos cuyo subyacente sean acciones pertenecientes al índice accionario COLCAP del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD acciones
BCOLOMBIA	163.502
BOGOTA	8.078
CELSIA	347.004
CEMARGOS	453.912
CLH	255.899
CNEC	30.808
CORFICOLCF	91.279

Nemotécnico	VMD acciones
ECOPETROL	29.549.997
EEB	1.536.550
EXITO	255.896
GRUPOARGOS	246.697
GRUPOSURA	249.068
ISA	316.369
NUTRESA	102.913
PFAVAL	8.903.535
PFAVH	348.561
PFBCOLOM	1.917.090
PFCEMARGOS	91.917
PFDVVNDA	142.778
PFGRUPOARG	94.600
PFGRUPSURA	92.977

- El Volumen Medio Diario aplicable desde el 25 de septiembre de 2018 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	Dos mil (2.000)

Estos valores se actualizarán por lo menos una vez al año

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías