



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 01 de Octubre de 2018

No. 087

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 Riesgos y Operaciones 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)
Hasta un 100%	3
Hasta un 200%	4
Mayor a un 300%	5

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 para los Activos elegibles de Operaciones Repo son los siguientes y estarán vigentes desde el 02 de Octubre Hasta 08 de Octubre de 2018.

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	120.462.000.000	29.891.254
PFBCOLOM	59.667.000.000	1.906.284
ISA	4.091.000.000	305.744
NUTRESA	2.503.000.000	103.434

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFAVAL	10.383.000.000	8.912.404
EXITO	3.879.000.000	266.051
GRUPOARGOS	3.905.000.000	239.559
GRUPOSURA	8.718.000.000	250.804
PFGRUPSURA	3.221.000.000	94.741
CEMARGOS	3.248.000.000	421.799
BCOLOMBIA	5.118.000.000	160.434
CLH	1.367.000.000	253.131
CORFICOLCF	1.994.000.000	90.620
EEB	2.897.000.000	1.444.801
PFAVH	741.000.000	350.573
PFDVVNDA	4.983.000.000	145.709
PFGRUPOARG	1.376.000.000	95.021
CELSIA	1.546.000.000	356.157
ICOLCAP	5.314.000.000	349.266

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías