



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 16 de Octubre de 2018

No. 092

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 17 de Octubre Hasta 22 de Octubre de 2018.

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ECOPETROL	119.244.000.000	30.188.421
PFBCOLOM	58.139.000.000	1.875.462
ISA	3.798.000.000	287.744
NUTRESA	2.211.000.000	93.681

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
PFAVAL	9.911.000.000	8.849.202
EXITO	3.283.000.000	231.871
GRUPOARGOS	3.644.000.000	240.373
GRUPOSURA	8.396.000.000	254.113
PFGRUPSURA	2.943.000.000	92.557
CEMARGOS	3.214.000.000	440.305
BCOLOMBIA	4.543.000.000	151.239
CLH	1.317.000.000	236.037
CORFICOLCF	1.918.000.000	88.482
EEB	3.012.000.000	1.469.265
PFAVH	668.000.000	321.771
PFDVVNDA	4.575.000.000	137.300
PFGRUPOARG	1.231.000.000	93.148
CELSIA	1.569.000.000	361.412
ICOLCAP	5.294.000.000	355.299

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías