



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 29 de julio de 2019

No. 090

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 3277000 opción 1 o a través de la cuenta de correo electrónico: operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co.

A. GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES

En caso de 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 desde el 30 de julio 2019 hasta el 05 de agosto de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	9.548.000.000	244.072
CELSIA	790.000.000	176.108
CEMARGOS	4.544.000.000	592.427
CORFICOLCF	3.136.000.000	116.231
ECOPETROL	63.499.000.000	21.308.228
GEB	3.958.000.000	1.853.938
EXITO	6.299.000.000	359.529

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOARGOS	3.509.000.000	206.164
GRUPOSURA	7.593.000.000	222.009
ISA	8.583.000.000	447.028
NUTRESA	3.590.000.000	142.554
PFAVAL	8.076.000.000	6.334.202
PFBCOLOM	65.482.000.000	1.590.908
PFDAVVNDA	4.574.000.000	110.214
PFGRUPSURA	2.482.000.000	77.568
ICOLCAP	7.622.000.000	471.686
BOGOTA	636.000.000	8.921
PFGRUPOARG	927.000.000	64.481

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías