



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 12 de agosto de 2019

No. 096

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 13 de agosto 2019 hasta el 20 de agosto de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	9.801.000.000	246.249
CELSIA	889.000.000	199.884
CEMARGOS	4.013.000.000	551.292
CORFICOLCF	2.768.000.000	104.918
ECOPETROL	60.094.000.000	21.197.002
GEB	3.612.000.000	1.708.019
EXITO	6.704.000.000	387.511

GRUPOARGOS	3.568.000.000	218.599
GRUPOSURA	7.194.000.000	222.739
ISA	7.782.000.000	460.481
NUTRESA	3.565.000.000	143.617
PFAVAL	7.635.000.000	6.182.135
PFBCOLOM	64.757.000.000	1.516.565
PFDAVVNDA	4.789.000.000	115.946
PFGRUPSURA	2.218.000.000	73.198
ICOLCAP	7.623.000.000	487.706
BOGOTA	666.000.000	9.352
PFGRUPOARG	961.000.000	71.007

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías