



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 12 de noviembre de 2019

No. 140

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)
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 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 12 de noviembre de 2019 hasta el 15 de noviembre de 2019 para los Activos elegibles para Operaciones del Segmento de Derivados Financieros son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	8.248.000.000	193.332
CELSIA	935.000.000	213.387
CEMARGOS	6.283.000.000	910.621
CORFICOLCF	2.300.000.000	78.765
ECOPETROL	60.201.000.000	19.233.609
GEB	3.910.000.000	1.801.657
GRUPOARGOS	5.873.000.000	320.951
EXITO	9.734.000.000	542.609

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
GRUPOSURA	8.543.000.000	260.312
ISA	6.814.000.000	337.336
NUTRESA	2.807.000.000	110.412
PFAVAL	9.014.000.000	6.392.801
PFBCOLOM	66.697.000.000	1.488.099
PFDAVVNDA	4.411.000.000	98.724
PFGRUPSURA	2.921.000.000	103.961
ICOLCAP	9.839.000.000	593.507
BOGOTA	1.041.000.000	11.708
PFGRUPOARG	1.066.000.000	81.215

Jaime Andrés Restrepo

Subgerente de Riesgo y Metodologías