



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 16 de junio de 2020

No. 080

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE VOLÚMENES MEDIO DIARIOS CONSIDERADOS PARA EL CÁLCULO DE LAS GARANTÍAS POR GRANDES POSICIONES, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN EL ARTÍCULO 4.5.3.4. 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	28%
Entre un 150% y 200%	4	52%
Mayor a un 200%	5	73%

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 17 de junio 2020 hasta el 23 de junio de 2020 para los Activos elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
BCOLOMBIA	5.894.000.000	229.344
CELSIA	691.000.000	164.756
CEMARGOS	1.802.000.000	511.217
CORFICOLCF	1.671.000.000	62.570
ECOPETROL	54.423.000.000	25.610.988
GEB	4.945.000.000	2.099.792
GRUPOARGOS	4.558.000.000	477.787
GRUPOSURA	5.049.000.000	257.591

Nemotécnico	VMD Efectivo	VMD acciones
ISA	8.011.000.000	425.655
NUTRESA	3.088.000.000	144.964
PFAVAL	12.155.000.000	13.891.609
PFBCOLOM	62.581.000.000	2.352.652
PFDVVNDA	3.782.000.000	127.334
PFGRUPSURA	1.928.000.000	116.821
ICOLCAP	6.052.000.000	521.682
BOGOTA	821.000.000	12.638

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías