

Artículo 6.10.1.2. Reglas para evitar la concentración de la liquidez en moneda extranjera en un solo Proveedor de Liquidez.

(Este artículo fue modificado mediante Circular No. 8 del 26 de marzo de 2021, publicada en el Boletín Normativo No. 037 del 26 de marzo de 2021, modificación que rige a partir del 29 de marzo de 2021.)

Además de los límites de concentración de la liquidez en moneda extranjera en un solo Proveedor de Liquidez establecidos por el Banco de la República, la Cámara tendrá en cuenta los siguientes mecanismos:

1. Número de Proveedores de Liquidez habilitados para operar en moneda extranjera y Monto Dedicado por los Proveedores de Liquidez en Dólares: La Cámara hará un seguimiento periódico a cualquier modificación en el número de Proveedores de Liquidez y/o en el Monto Dedicado por los Proveedores de Liquidez en Dólares.

2. Determinación del Límite de Obligación Latente de Entrega – LOLE: La Cámara determinará el Límite de Obligación Latente de Entrega – LOLE en la Moneda Elegible bajo los siguientes lineamientos:

- a. En función de la sumatoria del monto individual, total dedicado y de la cantidad de los Proveedores de Liquidez disponibles.
- b. El Gerente o quien este delegue podrá reducir el Límite de Obligación Latente de Entrega – LOLE cuando se presente la disminución o retiro de uno o varios Proveedores de Liquidez que causen el incremento en la concentración del monto dedicado por uno o varios Proveedores de Liquidez en Dólares por encima del límite autorizado por el Banco de la República. La medida de reducción adoptada será informada a la Junta Directiva en su siguiente sesión.

Artículo 6.10.1.3. Operaciones con Intermediarios del Mercado Cambiario distintos de los Proveedores de Liquidez.

De conformidad con lo dispuesto en el artículo 4.3.1. del Reglamento, la Cámara también podrá celebrar operaciones de compra y venta de Moneda Elegible de contado o de derivados que sean necesarias para el adecuado cumplimiento de su función de Compensación y Liquidación, con otros intermediarios del mercado cambiario.

Las operaciones que celebre la Cámara con los intermediarios del mercado cambiario distintos de los Proveedores de Liquidez en desarrollo de lo dispuesto en el inciso anterior quedan sujetas a las mismas reglas establecidas para la celebración de las operaciones con Proveedores de Liquidez contenidas en el Reglamento y en la presente Circular. Por lo tanto, cualquier derecho, prerrogativa u obligación consagrada para los Proveedores de Liquidez y las operaciones que se realicen con éstos serán aplicables a los intermediarios del mercado cambiario y a las operaciones que realice la Cámara con éstos.

Artículo 6.10.1.4 Operaciones con los Proveedores de Liquidez.

(Este artículo fue modificado mediante Circular No. 7 del 11 de marzo de 2021, publicada en el Boletín Normativo No. 036 del 11 de marzo de 2021, modificación que rige a partir del 12 de marzo de 2021.)

En el evento que se presente un retardo en el pago de la Liquidación al Vencimiento por parte de un Miembro, la Cámara seguirá los siguientes lineamientos:

Dentro de los quince (15) minutos siguientes al retardo del Miembro en el pago de la Liquidación según el horario establecido en la presente Circular, artículo 6.7.1.1, numeral 3, etapa 1, la Cámara procederá a cotizar con los Proveedores de Liquidez las operaciones de Compra y venta necesarias para cumplir con su función de Compensación y Liquidación.

En caso de que el Miembro en retardo tenga Operaciones Aceptadas cuya Fecha Valor sea distinta al Día Hábil en curso, la Cámara en forma concurrente y simultánea o en un momento posterior, según lo considere, podrá celebrar con los Proveedores de Liquidez o intermediarios del mercado cambiario cuantas Operaciones de compra y venta de Moneda Elegible contrarias sean necesarias, para disminuir el riesgo de las Operaciones Aceptadas pendientes de Liquidación cuya Fecha Valor sea distinta al Día Hábil en curso o acudir directamente al Procedimiento de Compensación y Liquidación Anticipada.

La Cámara mantendrá las Garantías del Miembro en retardo y podrá solicitarle Garantías adicionales.



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

La Cámara podrá devolver en la fecha de retardo las Garantías o el remanente de las mismas a los Miembros que estuvieron en retardo y que hayan efectuado el cumplimiento del pago de la Liquidación al Vencimiento en la fecha de retardo después de la hora establecida en la Circular, artículo 6.7.1.1, numeral 3, etapa 1, siempre y cuando dichas Garantías o el remanente de las mismas no se requieran para cubrir las tarifas, intereses, obligaciones, costos y gastos y otras obligaciones relacionadas con tales montos por el uso de Proveedores de Liquidez, de acuerdo con el cálculo que para el efecto realice la Cámara, ni se requieran para cubrir otras Operaciones Aceptadas cuya Fecha Valor sea distinta al Día Hábil en curso.

La Cámara devolverá las Garantías y el pago de recursos a que el Miembro en retardo tenga derecho, previa deducción de los conceptos y todos los compromisos con los Proveedores de Liquidez, con los intermediarios del mercado cambiario y/o el Banco de la República.

Una vez la Cámara cierre con los Proveedores de Liquidez las operaciones Swap necesarias para dar cumplimiento con su función de Compensación y Liquidación, los Proveedores de Liquidez darán instrucciones al Sistema de Pagos Autorizado para que entregue el Monto por Transferir a la Cámara.

Recibida la Moneda Elegible en las cuentas de liquidación de la Cámara por parte de los Proveedores de Liquidez, la Cámara dará instrucciones apropiadas al Sistema de Pagos Autorizado para que se transfieran a los Proveedores de Liquidez o al banco corresponsal designado por el Proveedor de Liquidez el monto de dólares y/o Pesos de la negociación. Para esto utilizará los recursos que el Miembro en retardo debía recibir por el cumplimiento de la Liquidación de las Operaciones aceptadas; si este monto no es suficiente la Cámara hará efectivas las Garantías constituidas por el Miembro en retardo.

En el primer Día Bancario posterior a la fecha de cumplimiento inicialmente prevista para la Primera Parte de un Swap a un Día, la Cámara le confirmará al Proveedor de Liquidez el cumplimiento de la segunda parte de la operación y éste deberá dar instrucciones apropiadas al Sistema de Pagos Autorizado relevante para transferir a la cuenta de la Cámara los Pesos y/o Dólares; la Cámara por su parte realizará las transferencias correspondientes.

Cuando la Cámara ha acordado un Swap a un Día con el Proveedor de Liquidez, en el evento en que el Miembro Liquidador no entregue los Pesos y/o Dólares producto de la Liquidación al Vencimiento antes de

1011



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Las 8:00 a.m., la Cámara realizará una Compra de Moneda Elegible para completar la Segunda Parte de dicho Swap a un Día. La Cámara enviará dicha Solicitud de Cotización de Compra en primer lugar al Proveedor de Liquidez con quien celebró el Swap, y en caso de no ser posible lo hará con cualquier Otro Proveedor de Liquidez.

La Cámara establecerá los montos a transferir a los Proveedores de Liquidez y para esto hará efectivas las Garantías del Miembro Liquidador en retardo. En el evento en que las Garantías antes mencionadas no sean suficientes para atender los montos a pagar a dichos Proveedores de Liquidez, la Cámara requerirá al Miembro Liquidador para que entregue la suma faltante en el plazo que aquella establezca para el efecto, que podrá ser de inmediato.



1012



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

ANEXOS

ANEXO 1

SOLICITUD DE ADMISIÓN Y MODIFICACIÓN COMO MIEMBRO

Anexo 1.1. Carta de solicitud de admisión como Miembro

(Este Anexo fue modificado mediante Circular 14 del 8 de agosto de 2017, publicada en el Boletín Normativo No. 015 del 8 de agosto de 2017, mediante Circular 7 del 9 de mayo de 2018, publicada en el Boletín Normativo No. 010 del 9 de mayo de 2018, mediante Circular No. 44 del 28 de octubre de 2020, publicada en el Boletín Normativo No. 118 del 28 de octubre de 2020, y mediante Circular No. 54 del 09 de diciembre de 2020, publicada en el Boletín Normativo No. 157 del 09 de diciembre de 2020, modificación que rige a partir del 10 de diciembre de 2020.)

 Cámara de Riesgo Central de Contraparte	FORMATO	Código: FO GMI 010
	SOLICITUD DE ADMISIÓN COMO MIEMBRO DE LA	Versión: 1.0
	CRCC S.A.	Página 1 de 4

Bogotá,

Doctor

Gerente

Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A.

Ciudad

Asunto: Solicitud de Admisión como Miembro

El/La suscrito (a), _____, identificado (a) con la Cédula de Ciudadanía No. _____ expedida en la ciudad de _____, obrando en nombre y representación de _____, sociedad legalmente constituida, con domicilio principal en



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

_____, con NIT. _____, en mi calidad de representante legal, atentamente solicito que la sociedad que represento sea admitida como Miembro de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. - CRCC S.A. en la modalidad de Miembro (*Liquidador General, Liquidador Individual, No Liquidador*) en el (los) segmento(s) de (*Derivados Financieros, Renta Fija, Renta Variable, Swaps, Divisas*).

Así mismo certifico que la sociedad cumple con todos los requisitos establecidos en el Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. - CRCC S.A., y demás normas aplicables, para solicitar ser admitido a la misma en la calidad de **Miembro (*Liquidador General, Liquidador Individual, No Liquidador*)**.

En cumplimiento de los requisitos de vinculación exigidos por la CRCC S.A., me permito allegar los documentos relacionados en la Lista de Verificación de Documentos, necesarios para el trámite de la presente solicitud.

Cordialmente,

(Nombre y Cédula)

Creación	
----------	--

Modificación	
--------------	--

Código de Miembro Asignado por la CRCC				
--	--	--	--	--

Miembro General	Liquidador	
-----------------	------------	--

Miembro Individual	Liquidador	
--------------------	------------	--

Miembro No Liquidador	
-----------------------	--

1014

Segmento Derivados Financieros	
-----------------------------------	--

Segmento Renta Fija	
---------------------	--

Segmento Renta Variable	
----------------------------	--

Segmento Swaps	
----------------	--

Segmento Divisas	
------------------	--

1. Datos Generales.

1. Nombre Comercial		2. NIT.	
3. Razón Social			
4. Fecha de Constitución			
5. Dirección Oficina Principal		6. Ciudad:	
7. Teléfono Oficina Principal		8. Fax:	
9. Website.			
10. Tipo de Entidad			
11. Código Superintendencia Financiera.			
12. Nombre del Representante Legal			
13. Tipo de Identificación del Representante Legal		14. No. de Identificación del Representante Legal	
15. Cargo			
16. Nombre de la Entidad Auditora (Si aplica)			
17. Nombre de la Entidad de Revisoría Fiscal (Si aplica)			
18. Nombre del Revisor Fiscal Principal		19. No. De Identificación	

1015

20. Nombre del Revisor Fiscal Suplente		21. No. De Identificación	
--	--	---------------------------	--

2. Información Financiera. (último corte envío Superintendencia Financiera)

22. Patrimonio Técnico o Adecuado	
23. Gastos Operacionales Totales/ Margen Financiero Bruto.	
24. ROA	
25. ROE	
26. Relación de Solvencia	

3. Calificación.

AGENCIA CALIFICADORA	CONCEPTO	CALIFICACIÓN
27.	28.	29.

4. Registro de Cuentas de Compensación y Liquidación.

CUENTA DE DEPÓSITO DECEVAL

30. Código de Entidad		31. Código de Depositante Directo	
-----------------------	--	-----------------------------------	--



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

CUENTA BANCO REPUBLICA

32. Código Depositante Directo DCV	
34. Código Entidad en el CUD	

33. Código entidad	
35. No. Cuenta CUD	

AGENTE DE PAGOS

36. Nombre Entidad	
38. Código Entidad en el CUD	

37. Nit Agente de Pagos	
39. No. Cuenta CUD	

AGENTE CUSTODIO

40. Nombre Entidad	
42. Código Depositante Directo DVL	
44. Código Depositante Directo DCV	

41. Nit Agente Custodio	
43. Código de Entidad	
45. Código de entidad	

1017



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

	46. Nombre del Cargo	47. Nombres y Apellidos	48. Teléfono y Extensión	49. Celular	50. Email	51. Dirección Correspondencia	52. Teléfono Residencia
Gerente o Director de Riesgos							
Gerente o Director de Operaciones							
Gerente o Director del Departamento Jurídico							
Gerente o Director del Departamento de Contabilidad							
Oficial de Cumplimiento.							
Contralor Normativo							
Oficial de Cumplimiento							
Gerente o Director del Departamento de Tecnología.							

1018

CUENTA BANCO CORRESPONSAL (si aplica)

53. Nombre Entidad	
55. Dirección Entidad	
57. Número de Cuenta	
59. Código Swift	

54. NIT Entidad	
56. Ciudad	
58. Número ABA	

5. Información de Referencia.

Anexe el resumen de la hoja de vida del recurso humano asociado a las funciones de compensación y liquidación de operaciones².

53. Las actividades de Back Office están ubicadas en:

La Oficina de la Dirección General registrada en el punto 1.

Otra ubicación

Dirección					
Ciudad		Teléfono:		Extensión	
Nombre del Responsable.			Cargo		
Email del Responsable.					

54. En caso que las actividades de Back Office estén subcontratadas.

Nombre de la Entidad	
----------------------	--

² Con la entrega de este formulario la entidad certifica que el personal relacionado en la sección 5 cuenta con la capacitación y los medios para administrar las operaciones frente a la CRCC.



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Dirección					
Ciudad		Teléfono:		Extensión	
Nombre del Administrador			Cargo		
Email del Administrador		Teléfono:		Extensión	

Representante Legal
C.C.



1020



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Anexo 1.2. Carta de solicitud de modificación de la condición de Miembro no Liquidador a Miembro Liquidador.

Doctor

Gerente
Cámara de Riesgo Central de
Contraparte de Colombia S.A.
Ciudad

Asunto: Solicitud de admisión de un Miembro no Liquidador en la modalidad de Miembro Liquidador.

El/La suscrito (a), _____, identificado (a) con la Cédula de Ciudadanía No. _____ expedida en la ciudad de _____, obrando en nombre y representación de _____, con NIT. _____, Miembro no Liquidador de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., de conformidad con lo dispuesto en el artículo 1.2.1.12. de la Circular Única de la CRCC S.A., atentamente solicito la modificación de la condición de la sociedad que represento de Miembro no Liquidador a Miembro Liquidador _____ (Liquidador General o Individual).

Certifico que la sociedad cumple con todos los requisitos establecidos en el Reglamento de Funcionamiento de la CRCC S.A., y demás normas aplicables para ser admitido como Miembro Liquidador _____ (Liquidador General o Individual)

En cumplimiento de los requisitos exigidos por la CRCC S.A., me permito allegar los documentos relacionados en la Lista de Chequeo para solicitar el cambio de condición de Miembro no Liquidador a Miembro Liquidador, necesarios para el trámite de la presente solicitud.

Cordialmente,

(Nombre y Cédula)



Cámara de Riesgo Central de Contraparte

Anexo 1.3. Carta de solicitud de modificación de la condición de Miembro Liquidador Individual a Miembro Liquidador General.

Doctor

Gerente

Cámara de Riesgo Central de
Contraparte de Colombia S.A.
Ciudad

Asunto: Solicitud de admisión de un Miembro Liquidador Individual en la modalidad de Miembro Liquidador General.

El/La suscrito (a), _____, identificado (a) con la Cédula de Ciudadanía No. _____ expedida en la ciudad de _____, obrando en nombre y representación de _____, con NIT. _____, Miembro Liquidador Individual de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., de conformidad con lo dispuesto en el artículo 1.2.1.13. de la Circular Única de la CRCC S.A., atentamente solicito la modificación de la condición de la sociedad que represento de Miembro Liquidador Individual a Miembro Liquidador General.

Certifico que la sociedad cumple con todos los requisitos establecidos en el Reglamento de Funcionamiento de la CRCC S.A., y demás normas aplicables para ser admitido como Miembro Liquidador General.

En cumplimiento de los requisitos exigidos por la CRCC S.A., me permito allegar los documentos relacionados en la Lista de Chequeo para solicitar el cambio de condición de Miembro Liquidador Individual a Miembro Liquidador General, necesarios para el trámite de la presente solicitud.

Cordialmente,

1022