



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de agosto de 2020

No. 112

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE LOS ACTIVOS ELEGIBLES PARA REALIZAR OPERACIONES DE REPORTO O REPO Y SUS HAIRCUTS DE OPERACIONES O PORCENTAJES DE CASTIGO RESPECTIVOS, DE ACUERDO A LO ESTABLECIDO EN LOS ARTÍCULOS 4.8.1.1. Y 4.5.3.10. 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. OPERACIONES REPO SOBRE ACCIONES ELEGIBLES REFERENTES AL ARTÍCULO 4.8.1.1.

Las acciones elegibles por la Cámara para la Compensación y Liquidación de Operaciones Repo son las siguientes:

Nemo	Razón Social
BOGOTA	BANCO DE BOGOTA
BCOLOMBIA	BANCOLOMBIA S.A
CELSIA	CELSIA S.A E.S.P ANTES COLINVERS
CEMARGOS	CEMENTOS ARGOS S.A.
CORFICOLCF	CORPORACION FINANCIERA COLOMBIANA CORFICOLOMBIANA
ECOPETROL	ECOPETROL S.A.
GEB	GRUPO DE ENERGÍA DE BOGOTA
GRUPOARGOS	GRUPO ARGOS S.A.
GRUPOSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.
ICOLCAP	FONDO BURSATIL ISHARES COLCAP
ISA	INTERCONEXION ELECTRICA S.A. E.S.P.
NUTRESA	GRUPO NUTRESA S.A.
PFAVAL	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES S.A.
PFBCOLOM	BANCOLOMBIA S.A.
PFDAVVNDA	BANCO DAVIVIENDA S.A
PFGRUPSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.

Las acciones elegibles serán evaluadas por lo menos una vez al mes. En caso de que una acción pierda su condición de ser elegible para Operaciones Repo, se informara al Comité de Riesgos, en la siguiente sesión y se informará a los Miembros por medio de Boletín Informativo por la Cámara, sin perjuicio de la modificación a la presente Circular.

B. HAIRCUT SOBRE LAS OPERACIONES REPO REFERENTES AL ARTÍCULO 4.5.3.10

Los Haircuts sobre las Operaciones Repo utilizados para la determinación del importe efectivo del flujo de salida de una Operación Repo, serán calculados para todos los Activos susceptibles de realizar Operaciones Repo a partir de la siguiente formula:

$$\mathbf{Haircut\ Operación} = (1 - 0,75 * \mathbf{Fluctuación\ Total}) * \mathbf{Fluctuación\ Total} + 0,75 * \mathbf{Fluctuación\ Total}$$

En donde la Fluctuación Total hace referencia a la descrita en el Artículo 4.5.3.1. de la Circular Única de la Cámara.

Los Haircuts de la Operación para las acciones elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemo	% Castigo CRCC
BOGOTA	18%
BCOLOMBIA	32%
CELSIA	24%
CEMARGOS	22%
CORFICOLCF	30%
ECOPETROL	36%
GEB	19%
GRUPOARGOS	29%
GRUPOSURA	23%
ICOLCAP	14%
ISA	25%
NUTRESA	16%
PFAVAL	31%
PFBCOLOM	26%
PFDVVNDA	24%
PFGRUPSURA	30%

La actualización de este parámetro entrará en vigencia será a partir del 18 de agosto del 2020.

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías