



No.003 / Enero 14 de 2021

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 4.5.3.12. 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 |
|-------------|---|
| BCOLOMBIA | BANCOLOMBIA S.A |
| 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 |
| PFGROUPSURA | GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A. |



Boletín informativo

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 4.5.3.12

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:

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

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 |
|-------------|---------------|
| BCOLOMBIA | 28% |
| CEMARGOS | 24% |
| CORFICOLCF | 28% |
| ECOPETROL | 41% |
| GEB | 21% |
| GRUPOARGOS | 34% |
| GRUPOSURA | 25% |
| ICOLCAP | 21% |
| ISA | 21% |
| NUTRESA | 21% |
| PFAVAL | 28% |
| PFBCOLOM | 29% |
| PFDVVNDA | 25% |
| PFGROUPSURA | 42% |

La actualización de este parámetro entrará en vigencia será a partir del 17 de enero del 2022.



Boletín informativo

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgos y Metodologías