



Boletín Normativo

No.018 / Abril 1 de 2022

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.6., 1.4.7. y 1.4.10. del Reglamento de Funcionamiento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., se publica:

TABLA DE CONTENIDO

No.	Circular	Páginas
17	ASUNTO: MODIFICACIÓN DEL ARTÍCULO 6.6.1.4. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A.- CRCC S.A. EN RELACIÓN CON LOS PARÁMETROS PARA EL CÁLCULO DE GARANTÍA POR POSICIÓN.	4



Boletín Normativo

MODIFICACIÓN DEL ARTÍCULO 6.6.1.4. DE LA CIRCULAR ÚNICA DE LA CÁMARA DE RIESGO CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA S.A. – CRCC S.A. EN RELACIÓN CON LOS PARÁMETROS PARA EL CÁLCULO DE GARANTÍA POR POSICIÓN.

Artículo Primero. Modifíquese el artículo 6.6.1.4. de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A., el cual quedará así:

"Artículo 6.6.1.4. Parámetros para el cálculo de Garantía por Posición.

Para efectos del control de riesgo se agrupan las Operaciones de Contado sobre Divisas por su plazo remanente, de conformidad con la siguiente tabla:

Grupos de Compensación, Fluctuación total y Fluctuación para llamados a Garantías Extraordinarias.

Grupo de Compensación	Plazo Remanente	Fluctuación Total	LOLE
Spot	T+0	6.30%	LOLE Vigente
N1	T+1	6.30%	LOLE Vigente
N2	T+2	6.30%	LOLE Vigente
N3	T+3	6.30%	LOLE Vigente

La Fluctuación para llamados a Garantías Extraordinarias se calcula diariamente y corresponde al 50% de la Fluctuación Total y se publica a través del Sistema de la Cámara.

El LOLE en Pesos (COP) será el equivalente al LOLE en Dólares (USD) multiplicado por la TRM vigente.

Crédito sobre Garantías (valor porcentual) a aplicar sobre la garantía de cada posición compensada.

Orden o prioridad de compensación de los Grupos de Compensación.



Boletín Normativo

Grupos de Compensación	Spot	N1	N2	N3
Spot	100 %	0%	0%	0%
N1		100 %	0%	0%
N2			100 %	0%
N3				100 %

La prioridad a la hora de compensar posiciones será la siguiente:

Grupos de Compensación	Spot	N1	N2	N3
Spot	1	-	-	-
N1		2	-	-
N2			3	-
N3				4

Delta para formar un Spread.

Parejas de Grupos de Compensación	Delta para formar un Spread
Spot/N1	1/1
Spot/N2	1/1
Spot/N3	1/1
N1/N2	1/1
N1/N3	1/1
N2/N3	1/1



Boletín Normativo

Artículo Segundo. Vigencia. La presente modificación de la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. – CRCC S.A. rige a partir del cuatro (4) de abril de 2022.

(Original firmado)
AMPARO TOVAR GÓMEZ
Suplente del Gerente