



Boletín informativo

No.037/ 05 de agosto de 2024

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 con 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 3 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.
GRUPOARGOS	GRUPO ARGOS S.A.
GXTESCOL	ETF DE DEUDA PÚBLICA
ICOLCAP	FONDO BURSATIL ISHARES COLCAP
ISA	INTERCONEXION ELECTRICA S.A. E.S.P.



Boletín informativo

Nemo	Razón Social
PFAVAL	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES S.A.
PFBCOLOM	BANCOLOMBIA S.A.
PFDVVNDA	BANCO DAVIVIENDA S.A
PFGRUPSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.
HCOLSEL	FONDO BURSATIL HORIZONS COLOMBIA SELECT DE S&P
GEB	GRUPO ENERGÍA DE BOGOTA S.A. E.S.P
PEI	PATRIMONIO AUTONOMO DE ESTRATEGIAS INMOBILIARIAS

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 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 fórmula:

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

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:



Boletín informativo

Nemo	Haircut
BCOLOMBIA	24%
CEMARGOS	21%
CORFICOLCF	23%
ECOPETROL	24%
GRUPOARGOS	24%
GXTESCOL	9%
ICOLCAP	18%
ISA	20%
PFAVAL	22%
PFBCOLOM	23%
PFDVVNDA	21%
PFGRUPSURA	31%
HCOLSEL	26%
GEB	19%
PEI	23%

Los literales A y B del presente Boletín estarán vigentes a partir del 15 de agosto de 2024.

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgos y Metodologías