

**ASUNTO: PROCEDIMIENTO PARA LA COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES FORWARD NDF USD/COP, IRS, OIS, OIS IBR FORMACIÓN Y REPO Y TTV DE RENTA VARIABLE CON OCASIÓN DEL FESTIVO DEL 13 DE JULIO DE 2026 EN VIRTUD DE LA LEY 2578 DE 2026.**

Cualquier aclaración que requiera, favor comunicarse con la Subgerencia de Riesgos y Operaciones de la CRCC S.A. vía telefónica al número (601) 3277000 Opción 3 o a través de la cuenta de correo electrónico: [operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co](mailto:operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co)

Nos permitimos informar que en cumplimiento de lo establecido en el artículo 6 de la ley 2578 del 1 de junio de 2026, en el cual se declara el Día de Nuestra Señora del Rosario de Chiquinquirá, que se conmemora el 9 de julio de cada año, como fiesta nacional la cual, en virtud de la Ley 51 de 1983, se traslada al lunes 13 de julio de 2026, la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. informa que:

---

## **A. COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES FORWARD NDF USD/COP CON VENCIMIENTO EL 13 DE JULIO DE 2026.**

Considerando que el día 13 de julio de 2026 no corresponde a un día hábil de operación de la Cámara en Colombia, y de conformidad con lo establecido en el Artículo 2.7.2.19. de la Circular Única de la CRCC, las Operaciones Forward NDF USD/COP cuya Fecha de Vencimiento corresponda al 13 de julio de 2026 serán objeto del siguiente tratamiento:

- 1) La nueva Fecha de Vencimiento de las Operaciones Forward NDF USD/COP con vencimiento original el 13 de julio de 2026 será el día hábil de operación de la Cámara en Colombia inmediatamente siguiente, esto es, el 14 de julio de 2026.
- 2) La nueva Fecha de Liquidación de las referidas operaciones será el 15 de julio de 2026, en cumplimiento del ciclo de liquidación T+1 aplicable a este tipo de contratos.

3) Para efectos del cálculo del valor de liquidación, se tomará como referencia la Tasa Representativa del Mercado (TRM) calculada y certificada por la Superintendencia Financiera de Colombia correspondiente al día 14 de julio de 2026, de conformidad con lo dispuesto en la normativa aplicable.

## **B. COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES IRS, OIS Y OIS IBR FORMACIÓN CON VENCIMIENTO EL 13 DE JULIO DE 2026.**

Considerando que el día 13 de julio de 2026 no corresponde a un día hábil de operación de la Cámara en Colombia, y de conformidad con lo establecido en el Artículo 5.7.2.2. de la Circular Única de la CRCC, las Operaciones de Swap de Tasa de Interés (IRS), Swap de Tasa Overnight (OIS) y OIS IBR Formación cuya Fecha de Vencimiento corresponda al 13 de julio de 2026 se sujetarán a la convención de ajuste de fecha conocida como Modified Following, conforme a las siguientes reglas:

- 1) Dado que el 13 de julio de 2026 es un día no hábil, la Fecha de Vencimiento de las operaciones IRS, OIS y OIS IBR Formación afectadas se trasladará al día hábil inmediatamente siguiente, esto es, el 14 de julio de 2026.
- 2) El traslado al 14 de julio de 2026 se aplica en tanto dicho día pertenece al mismo mes calendario (julio), cumpliéndose la condición exigida por la convención Modified Following.

## **C. COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN DE LAS OPERACIONES REPO Y TTV DE RENTA VARIABLE CON FLUJO DE REGRESO EL 13 DE JULIO DE 2026.**

Considerando que el día 13 de julio de 2026 no corresponde a un día hábil de operación de la Cámara en Colombia, las Operaciones Repo y TTV de Renta Variable cuyo flujo de regreso corresponda al 13 de julio de 2026 serán objeto de anticipo conforme al siguiente procedimiento:

- Las Operaciones Repo y TTV de Renta Variable con Fecha de Vencimiento del flujo de regreso prevista para el 13 de julio de 2026 deberán ser anticipadas, para lo cual los Miembros involucrados

en la operación deberán realizar el anticipo a través de CRCC Portal. En tal sentido, la Cámara liquidará todas las operaciones Repo y TTV el 10 de julio de 2026.

## **D. DISPOSICIÓN DE CARÁCTER GENERAL SOBRE EL FESTIVO DEL DÍA 9 DE JULIO DE 2026, TRASLADADO AL 13 DE JULIO DE 2026 EN VIRTUD DE LA LEY 2578 DE 2026.**

El tratamiento de esta fiesta nacional se regirá por los mismos lineamientos, criterios y disposiciones aplicables a los demás días festivos oficiales.

CAMILO ARENAS RODRÍGUEZ

**Subgerente de Riesgos y Operaciones**