

BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de Agosto de 2019

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 el área de riesgos y operaciones de la CRCC S.A. vía telefónica al número 327 70 00 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:

Acciones elegibles
BANCO DE BOGOTA
BANCOLOMBIA
CELSIA
CEMENTOS ARGOS
CORFICOLOMBIANA
ECOPETROL
GRUPO DE ENERGÍA DE BOGOTA
EXITO
GRUPO ARGOS
GRUPO SURA
ICOLCAP
ISA
NUTRESA
PREFERENCIAL AVAL
PREFERENCIAL BANCOLOMBIA
PREFERENCIAL DAVIVIENDA
PREFERENCIAL GRUPO SURA
PREFERENCIAL GRUPO ARGOS

Las acciones elegibles serán evaluadas por lo menos una vez al mes. En caso 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:

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

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
BOGOTA	23%
BCOLOMBIA	30%
CELSIA	26%
CEMARGOS	17%
CORFICOLCF	32%
ECOPETROL	21%
GEB	20%
EXITO	27%
GRUPOARGOS	19%
GRUPOSURA	14%
ICOLCAP	10%
ISA	27%
NUTRESA	18%
PFAVAL	18%
PFBCOLOM	19%
PFDVVNDA	27%
PFGRUPSURA	19%
PFGRUPOARG	19%

La actualización de este parámetro será realizada por la Cámara de manera mensual e informada a la Bolsa de Valores de Colombia S.A durante los primeros cinco (5) días hábiles de cada mes, posteriormente serán publicados a través de Boletín Informativo durante los cinco (5) días hábiles siguientes y su entrada en vigencia será el día quince (15) del mes en curso, en el caso en que este día sea no hábil, su entrada en vigencia será a partir del día hábil siguiente.

Jaime Andrés Restrepo

Subgerente de Riesgo y Metodologías