



Boletín Normativo de Reglamento y Circulares.

No.058 / septiembre 30 de 2021

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4., 1.4.5. 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
28	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 EN EL SEGMENTO DE DIVISAS.	3





Boletín Normativo de Reglamento y Circulares.

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 EN EL SEGMENTO DE DIVISAS.

De conformidad con lo previsto en los artículos 1.4.4., 1.4.5. y 1.4.10. del Reglamento de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. - CRCC S.A. se publica la 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 en el Segmento de Divisas.

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	6.90%	LOLE Vigente
N2	T+2	9.60%	LOLE Vigente
N3	T+3	9.60%	LOLE Vigente

La Fluctuación para llamados a Garantías Extraordinarias, se calcula diariamente 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 de Reglamento y Circulares.

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

“

Artículo Segundo. Vigencia. La presente modificación a la Circular Única de la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. - CRCC S.A. rige a partir del 1 de octubre de 2021.

(Original firmado)
OSCAR LEIVA VILLAMIZAR
Gerente

