



## Boletín informativo

### No.065 / 09 de junio de 2022

**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 1 o a través de la cuenta de correo electrónico: [operacionescrcc@camaraderiesgo.com.co](mailto: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.
CNEC	CANACOL ENERGY LTD
CORFICOLCF	CORPORACION FINANCIERA COLOMBIANA CORFICOLOMBIANA
ECOPETROL	ECOPETROL S.A.
GEB	GRUPO DE ENERGÍA DE BOGOTA
SDGEB	
GRUPOARGOS	GRUPO ARGOS S.A.
GRUPOSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.
ICOLCAP	FONDO BURSATIL ISHARES COLCAP
ISA	INTERCONEXION ELECTRICA S.A. E.S.P.



## Boletín informativo

NUTRESA	GRUPO NUTRESA S.A.
PFAVAL	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES S.A.
PFBCOLOM	BANCOLOMBIA S.A.
PFDVVNDA	BANCO DAVIVIENDA S.A.
PFGRUPSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.

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 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 4.5.3.12

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:

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

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
BCOLOMBIA	27%
CEMARGOS	25%
CNEC	35%
CORFICOLCF	29%
ECOPETROL	41%



## Boletín informativo

Nemo	%Castigo CRCC
GEB	22%
SDGEB	
GRUPOARGOS	35%
GRUPOSURA	26%
ICOLCAP	21%
ISA	26%
NUTRESA	22%
PFAVAL	29%
PFBCOLOM	30%
PFDVVNDA	25%
PFGRUPSURA	43%

La actualización de este parámetro entrará en vigencia será a partir del 10 de junio de 2022.

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgos y Metodologías