



Boletín informativo

No.081 / 08 de septiembre 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

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.
CELSIA	CELSIA S.A. E.S.P.
CEMARGOS	CEMENTOS ARGOS S.A.
CNEC	CANACOL ENERGY LTD.
CORFICOLCF	CORPORACION FINANCIERA COLOMBIANA CORFICOLOMBIANA.
ECOPETROL	ECOPETROL S.A.
GE	GENERAL ELECTRIC CO.
GEB	GRUPO DE ENERGÍA DE BOGOTA.
GRUPOARGOS	GRUPO ARGOS S.A.
GRUPOSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.
ISA	INTERCONEXION ELECTRICA S.A. E.S.P.
NUTRESA	GRUPO NUTRESA S.A.



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.
APPLE	APPLE INC.
AMAZON	AMAZON.COM, INC.
BOFA	BANK OF AMERICA CORPORATION.
CITI	CITIBANK N.A.
PFIZER	PFIZER INC.
JP MORGAN	JPMORGAN CHASE & CO.
J&J	JOHNSON & JOHNSON INC.
HCOLSEL	FONDO BURSÁTIL GLOBAL X COLOMBIA
ICOLCAP	FONDO BURSATIL ISHARES COLCAP

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 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 4.5.3.12

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 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.



Boletín informativo

Los Haircuts de la Operación para las acciones elegibles para Operaciones Repo son los siguientes:

Nemo	%Castigo CRCC
BCOLOMBIA	28,77%
CELSIA	18,34%
CEMARGOS	32,87%
CNEC	28,77%
CORFICOLCF	24,56%
ECOPETROL	32,58%
GE	23,80%
GEB	18,18%
GRUPOARGOS	30,98%
GRUPOSURA	30,69%
ISA	19,92%
NUTRESA	22,26%
PFAVAL	26,38%
PFBCOLOM	24,71%
PFDVVNDA	27,28%
PFGRUPSURA	38,37%
APPLE	16,62%
AMAZON	19,32%
BOFA	19,48%
CITI	21,06%



Boletín informativo

Nemo	%Castigo CRCC
PFIZER	13,32%
JP MORGAN	17,26%
J&J	13,49%
HCOLSEL	27,28%
ICOLCAP	24,56%

La actualización de este parámetro entrará en vigencia será a partir del 09 de septiembre de 2022.

Jose Manuel Suarez

Subgerente de Riesgos y Metodologías