Boletín informativo

No.044 / 06 de octubre de 2023

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 3 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.
CEMARGOS	CEMENTOS ARGOS S.A.
CORFICOLCF	CORPORACION FINANCIERA COLOMBIANA CORFICOLOMBIANA
ECOPETROL	ECOPETROL S.A.
GRUPOARGOS	GRUPO ARGOS S.A.
ICOLCAP	FONDO BURSATIL ISHARES COLCAP
ISA	INTERCONEXION ELECTRICA S.A. E.S.P.
PFAVAL	GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORES S.A.

Nemo	Razón Social
PFBCOLOM	BANCOLOMBIA S.A.
PFGRUPSURA	GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA S.A.
HCOLSEL	FONDO BURSATIL HORIZONS COLOMBIA SELECT DE S&P
GEB	GRUPO ENERGÍA DE BOGOTÁ S.A. E.S.P.
NUTRESA	GRUPO NUTRESA S.A.
PFDAVVNDA	BANCO DAVIVIENDA 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 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:

Haircut Operación = (1-0,75 * Fluctuación Total) * Fluctuación Total +0,75 * Fluctuación Total

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	Haircut
BCOLOMBIA	25%
CEMARGOS	32%
CORFICOLCF	22%
ECOPETROL	24%
GRUPOARGOS	33%
ICOLCAP	21%
ISA	27%
PFAVAL	25%
PFBCOLOM	25%
PFGRUPSURA	36%
HCOLSEL	26%
GEB	22%
NUTRESA	41%
PFDAVVNDA	21%

Los literales A y B del presente Boletín estarán vigentes a partir del 16 de octubre de 2023.

José Manuel Suárez Jiménez
Subgerente de Riesgos y Metodologías