

BOLETÍN INFORMATIVO No. 128

Bogotá D.C., septiembre 20 de 2021

MODIFICACIONES EN LOS PARÁMETROS UTILIZADOS PARA EL CÁLCULO DE LA GARANTÍA

DERIVEX S.A. (en adelante "Derivex") informa que la Cámara de Riesgo Central de Contraparte de Colombia S.A. (en adelante "CRCC"), mediante Boletín Normativo No. 055 del 14 de septiembre de 2021, ha modificado los parámetros para el cálculo de la garantía por posición y fluctuaciones de estrés de los contratos futuros de energía eléctrica, el cual rige a partir del 20 de septiembre de 2021.

A continuación, se encuentra el ajuste realizado por la CRCC a los parámetros utilizados para el cálculo de la garantía del contrato futuro sobre Electricidad Mensual (ELM) y el Contrato Mini de Futuro sobre Electricidad Mensual (ELS):

Estructura de Garantías	
Vencimientos	Garantía
1 al 4	23,40%
5 al 8	11,90%
9 al 18	11,30%
19 al 24	11,30%
25 al 72	10,00%

En el siguiente link se encuentra el Boletín publicado por la CRCC sobre el particular:

<https://www.camaraderiesgo.com/regulacion/boletines-normativos-de-reglamento-y-circulares-2021/>

Más información.**Derivex – Mercado de Derivados de *Commodities* Energéticos****Teléfono: (+57) -(1) 6074848 Ext. 2091****Correo electrónico: Info@derivex.com.co**