Boletín informativo

No.044 / Marzo 24 de 2021

ASUNTO: PUBLICACIÓN DE LOS ACTIVOS ELEGIBLES PARA REALIZAR OPERACIONES DE TRANSFERENCIA TEMPORAL DE VALORES O TTV Y SUS HAIRCUTS DE OPERACIONES O PORCENTAJES DE CASTIGO RESPECTIVOS, DE ACUERDO CON LO ESTABLECIDO EN LOS ARTÍCULOS 4.8.1.2. 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.

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Aseguramos el cumplimiento de las transacciones generando seguridad y transparencia al mercado de capitales colombiano.

A. OPERACIONES TTV SOBRE ACCIONES ELEGIBLES REFERENTES AL ARTÍCULO 4.8.1.2.

Los Activos elegibles por la Cámara para la Compensación y Liquidación de Operaciones TTV son las siguientes:

Activo
AAPL
AGROCHAL
AMZN
BAC
BBVACOL
BCOLOMBIA
BMC
BOGOTA
BVC
C
CELSIA
CEMARGOS
CLH
CNEC
COLTEJER
COLTEL
CONCIVILES
CONCONCRET

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA
Aseguramos el cumplimiento de las transacciones generando seguridad y transparencia al mercado de capitales colombiano.

Activo
COOMEVAEPS
CORFERIAS
CORFICOLCF
CREDIFAMI
ECOPETROL
ELCONDOR
EMPAQUES
ENKA
ESTRA
ETB
EXITO
FABRICATO
FAMILIA
FB
FGNTOLIMA
GASNATURAL
GASORIENTE
GE
GEB
GRUBOLIVAR
GRUPOARGOS
GRUPOAVAL
GRUPOSURA

Activo
HCOLSEL
ICOLCAP
INCASTILLA
INESA
INVENSA
ISA
JNJ
JPM
MARLY
MAYAGUEZ
MINEROS
MOAT
NUTRESA
OCCIDENTE
ORBIS
PAZRIO
PFAVAL
PFAVH
PFBBVACOL
PFBCOLOM
PFCARPAK
PFCEMARGOS
PFCORFICOL

Activo
PFDAVVNDA
PFE
PFGRUPOARG
PFGRUPSURA
PFVILLA051
PFVILLA053
PFVILLAS
PFVILLAS00
PFVILLASCA
POPULAR
PROMIGAS
PROTECCION
RIOPAILA
RIOPAILIND
SANFELIPE
TERPEL
TGLSC
TITAN
VALINDUSTR
VALSIMESA
VILLAS

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA
Aseguramos el cumplimiento de las transacciones generando seguridad y transparencia al mercado de capitales colombiano.

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 TTV, 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 TTV REFERENTES AL ARTÍCULO 4.5.3.12

Los Haircuts sobre las Operaciones TTV utilizados para la determinación de la Garantía Exigida en una Operación TTV, serán calculados para todos los Activos susceptibles de realizar Operaciones TTV a partir de la siguiente fórmula:

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

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 los Activos elegibles para Operaciones TTV son los siguientes:

Activo	Haircut TTV
AGROCHAL	200,0%
BMC	200,0%
COLTEL	200,0%
CONCIVILES	200,0%
COOMEVAEPS	200,0%
CORFERIAS	200,0%
CREDIFAMI	200,0%
EMPAQUES	200,0%
ESTRA	200,0%
FAMILIA	200,0%
FGNTOLIMA	200,0%
GASORIENTE	200,0%
INCASTILLA	200,0%
INESA	200,0%
INVENSA	200,0%
MARLY	200,0%
MAYAGUEZ	200,0%
ORBIS	200,0%
PAZRIO	200,0%
PFBBVACOL	200,0%

Activo	Haircut TTV
PFVILLA051	200,0%
PFVILLA053	200,0%
PFVILLAS	200,0%
PFVILLAS00	200,0%
PFVILLASCA	200,0%
RIOPAILA	200,0%
RIOPAILIND	200,0%
SANFELIPE	200,0%
TGLSC	200,0%
TITAN	200,0%
VALINDUSTR	200,0%
VALSIMESA	200,0%
COLTEJER	200,0%
POPULAR	200,0%
VILLAS	200,0%
PFCARPAK	200,0%
GASNATURAL	158,0%
PROTECCION	171,0%
FABRICATO	200,0%
ENKA	200,0%
BBVACOL	160,0%
ELCONDOR	168,0%
GRUBOLIVAR	160,0%
MINEROS	160,0%
OCCIDENTE	160,0%
PFCORFICOL	160,0%
PROMIGAS	160,0%
TERPEL	160,0%
CONCONCRET	171,0%
HCOLSEL	137,0%
CLH	158,0%
PFAVH	200,0%
ETB	159,0%
CNEC	147,0%
ECOPETROL	144,0%

Activo	Haircut TTV
PFCEMARGOS	144,0%
PFGRUPOARG	144,0%
ÉXITO	141,0%
BCOLOMBIA	138,0%
PFAVAL	134,0%
PFGRUPSURA	136,0%
CORFICOLCF	131,0%
GRUPOAVAL	148,0%
GRUPOARGOS	134,0%
PFBCOLOM	131,0%
ISA	129,0%
CELSIA	127,0%
PFDAVVNDA	125,0%
GRUPOSURA	127,0%
CEMARGOS	125,0%
BVC	124,0%
GEB	121,0%
BOGOTA	120,0%
NUTRESA	118,0%
ICOLCAP	113,0%
AAPL	125,0%
AMZN	135,0%
BAC	158,0%
C	165,0%
FB	126,0%
GE	134,0%
JNJ	117,0%
JPM	140,0%
MOAT	120,0%
PFE	118,0%

El presente boletín entrará en vigencia a partir del 24/03/2021

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías

CÁMARA DE RIESGO
CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

Aseguramos el cumplimiento de las transacciones generando seguridad y transparencia al mercado de capitales colombiano.