



Boletín informativo

No.147 / Noviembre 02 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.



Boletín informativo

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
CORFERIAS
CORFICOLCF
CREDIFAMI
CSACOL
DESCAUCANO
ECOPETROL
ELCONDOR
ELECTULUA





Boletín informativo

Activo
EMPAQUES
ENKA
ESTRA
ETB
EXITO
FABRICATO
FAMILIA
FB
FGNTOLIMA
GASNATURAL
GASORIENTE
GE
GEB
GRUBOLIVAR
GRUPOARGOS
GRUPOAVAL
GRUPOSURA
HCOLSEL
ICOLCAP
INCASTILLA
INESA
INVENSA
ISA
JNJ
JPM
MARLY
MAYAGUEZ
MINEROS
MOAT
NUTRESA
OCCIDENTE
ORBIS
PAZRIO
PFAVAL



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

Activo
PFBBVACOL
PFBCOLOM
PFCARPAK
PFCEMARGOS
PFCORFICOL
PFDVVNDA
PFE
PFGRUPOARG
PFGRUPSURA
PVILLA051
PVILLA053
PVILLAS
PVILLAS00
PVILLASCA
POPULAR
PROMIGAS
PROTECCION
RIOPAILA
RIOPAILIND
SANFELIPE
TERPEL
TGLSC
TITAN
VALINDUSTR
VALSIMESA
VILLAS
SQM B
ENELAM
CENCOSUD
FALAB
CHILE
BSAN
COPEC



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

Activo
ENELCHIL
CAP
PARAUCO
CSPX
EIMI
JPEA
IBO1
ISAC
IUFS
IUIT
SDHA
SUAS
IDSE

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:

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

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	200,00%
BMC	200,00%
COLTEL	200,00%
CONCIVILES	200,00%



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

Activo	Haircut TTV
CORFERIAS	200,00%
CREDIFAMI	200,00%
EMPAQUES	200,00%
ESTRA	200,00%
FAMILIA	200,00%
FGNTOLIMA	200,00%
GASORIENTE	200,00%
INCASTILLA	200,00%
INESA	200,00%
INVENSA	200,00%
MARLY	200,00%
MAYAGUEZ	200,00%
ORBIS	200,00%
PAZRIO	200,00%
PFBBVACOL	200,00%
PFVILLA051	200,00%
PFVILLA053	200,00%
PFVILLAS	200,00%
PFVILLAS00	200,00%
PFVILLASCA	200,00%
RIOPAILA	200,00%
RIOPAILIND	200,00%
SANFELIPE	200,00%
TGLSC	200,00%
TITAN	200,00%
VALINDUSTR	200,00%
VALSIMESA	200,00%
COLTEJER	200,00%
POPULAR	200,00%
VILLAS	200,00%
PFCARPAK	200,00%
GASNATURAL	200,00%
PROTECCION	194,20%



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

Activo	Haircut TTV
FABRICATO	200,00%
ENKA	200,00%
BBVACOL	159,30%
ELCONDOR	175,10%
GRUBOLIVAR	159,30%
MINEROS	159,30%
OCCIDENTE	159,30%
PFCORFICOL	159,30%
PROMIGAS	159,30%
TERPEL	159,30%
CONCONCRET	183,20%
HCOLSEL	124,50%
CLH	157,30%
ETB	150,00%
CNEC	141,30%
ECOPETROL	140,70%
PFCEMARGOS	139,90%
PFGRUPOARG	151,50%
EXITO	135,20%
BCOLOMBIA	130,80%
PFAVAL	129,60%
PFGRUPSURA	153,60%
CORFICOLCF	126,20%
GRUPOAVAL	131,40%
GRUPOARGOS	141,30%
PFBCOLOM	134,20%
ISA	128,80%
CELSIA	128,20%
PFDVVNDA	123,10%
GRUPOSURA	128,60%
CEMARGOS	127,80%
BVC	125,80%
GEB	123,50%



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

Activo	Haircut TTV
BOGOTA	121,40%
NUTRESA	122,90%
ICOLCAP	118,50%
AAPL	121,20%
AMZN	125,60%
BAC	127,40%
C	126,00%
FB	126,00%
GE	134,20%
JNJ	116,00%
JPM	120,80%
MOAT	122,90%
PFE	115,80%
SQMBCO	150,40%
ENELAMCO	146,80%
CENCOSUDCO	186,80%
FALABELLCO	163,10%
CHILECO	128,80%
BSANTANDCO	135,00%
COPECCO	129,00%
ENELCHILCO	151,90%
CAPCO	200,00%
PARAUCOCO	155,60%
CSPX	114,11%
EIMI	113,55%
JPEA	116,55%
IB01	110,95%
ISAC	113,17%
IUFS	121,69%
IUIT	116,92%
SDHA	111,14%
SUAS	116,17%
IDSE	111,32%



**CÁMARA
DE RIESGO**

CENTRAL DE CONTRAPARTE DE COLOMBIA

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



Boletín informativo

El presente boletín entrará en vigencia a partir del 03/11/2021

Jose Manuel Suarez
Subgerente de Riesgo y Metodologías