



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 10 de agosto de 2020

No. 108

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.

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
AGROCHAL
BMC
COLTEL
CONCIVILES
COOMEVAEPS
CORFERIAS
CREDIFAMI
CSACOL
DESCAUCANO
ELECTULUA
EMPAQUES
ESTRA
FAMILIA
FGNTOLIMA
GASORIENTE
INCASTILLA
INESA
INVENSA
MARLY
MAYAGUEZ
ORBIS
PAZRIO
PFBBVACOL
PFVILLA051
PFVILLA053
PFVILLAS
PFVILLAS00
PFVILLASCA
RIOPAILA
RIOPAILIND

Activo
SANFELIPE
TGLSC
TITAN
VALINDUSTR
VALSIMESA
COLTEJER
POPULAR
VILLAS
PFCARPAK
GASNATURAL
CARTON
PROTECCION
FABRICATO
ENKA
BBVACOL
ELCONDOR
GRUBOLIVAR
MINEROS
OCCIDENTE
PFCORFICOL
PROMIGAS
TERPEL
CONCONCRET
HCOLSEL
CLH
PFAVH
ETB
CNEC
ECOPETROL
PFCEMARGOS
PFGRUPOARG
EXITO
BCOLOMBIA
PFAVAL
PFGRUPSURA
CORFICOLCF
GRUPOAVAL
GRUPOARGOS
PFBCOLOM
ISA

Activo
CELSIA
PFDVVVND
GRUPOSURA
CEMARGOS
BVC
GEB
BOGOTA
NUTRESA
ICOLCAP
AAPL
AMZN
BAC
C
FB
GE
JNJ
JPM
MOAT
PFE

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	200,0%
BMC	200,0%
COLTEL	200,0%
CONCIVILES	200,0%
COOMEVAEPS	200,0%
CORFERIAS	200,0%
CREDIFAMI	200,0%
CSACOL	200,0%
DESCAUCANO	200,0%
ELECTULUA	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%
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%

Activo	Haircut TTV
CARTON	200,0%
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%
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%
PFDVVNDA	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%

Activo	Haircut TTV
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 18/08/2020

Jaime Andrés Restrepo
Subgerente de Riesgo y Metodologías