



# BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., 13 de abril de 2020

No. 051

**ASUNTO:** PUBLICACIÓN DE PARÁMETROS DE RIESGO APLICABLES A LAS PRUEBAS DE MARCHA BLANCA PARA OPERACIONES DE CONTADO Y TTV DE RENTA VARIABLE

Cualquier aclaración que requiera, favor comunicarse con Subgerencia de Riesgos y Operaciones de la CRCC S.A. vía correo electrónico: [josorio@camaraderiesgo.com.co](mailto:josorio@camaraderiesgo.com.co).

## A. PARÁMETROS DE RIESGO

Los parámetros que serán utilizados para el cálculo del Modelo de riesgo de la Cámara para Operaciones de Contado y TTV son los siguientes:

<b>Nemotécnico</b>	<b>Fluctuación</b>	<b>Haircut Op TTV</b>	<b>Fluctuación estrés</b>	<b>Haircut Garantía</b>
AAPL	14,51%	129%	19%	0%
AMZN	20,00%	142%	26%	0%
BBVACOL	30,00%	168%	39%	0%
BCOLOMBIA	19,80%	142%	33%	25%
BOGOTA	10,92%	121%	23%	26%
BVC	12,66%	125%	21%	25%
CARTON	51,56%	200%	67%	0%
CELSIA	14,46%	129%	40%	25%
CEMARGOS	13,46%	127%	38%	25%
CLH	36,64%	188%	36%	37%
CNEC	23,96%	152%	48%	83%
CNEC	23,96%	152%	48%	83%
COLTEJER	93,95%	200%	100%	0%
CONCRET	24,66%	154%	31%	0%
CORFICOLCF	18,54%	138%	35%	41%
ECOPETROL	22,68%	149%	26%	25%
ELCONDOR	30,00%	168%	39%	0%
ENKA	39,78%	197%	52%	0%
ETB	25,73%	157%	33%	0%
EXITO	20,95%	144%	26%	58%
FABRICATO	43,26%	200%	56%	0%
FB	20,00%	142%	26%	0%
GEB	11,15%	122%	23%	30%
GRUBOLIVAR	30,00%	168%	39%	0%
GRUPOARGOS	17,98%	137%	33%	25%
GRUPOAVAL	18,23%	138%	32%	0%
GRUPOSURA	14,19%	128%	38%	25%
HCOLSEL	11,54%	123%	15%	0%
ICOLCAP	8,04%	115%	23%	30%
ISA	15,47%	131%	29%	25%
MCD	20,00%	142%	26%	0%
MINEROS	30,00%	168%	39%	0%
NUTRESA	9,70%	119%	30%	25%
PAZRIO	100,00%	200%	100%	0%
PEI	14,10%	128%	20%	30%
PFAVAL	19,04%	140%	18%	31%
PFAVH	32,00%	174%	50%	66%
PFCOLOM	16,14%	133%	20%	25%
PFCEMARGOS	22,67%	149%	33%	36%
PFCORFICOL	30,00%	168%	39%	0%

<b>Nemotécnico</b>	<b>Fluctuación</b>	<b>Haircut Op TTV</b>	<b>Fluctuación estrés</b>	<b>Haircut Garantía</b>
PFDVVNDA	14,39%	129%	20%	25%
PFGRUPOARG	22,59%	148%	33%	25%
PFGRUPSURA	18,80%	139%	33%	25%
PROMIGAS	30,00%	168%	39%	0%
TERPEL	30,00%	168%	39%	0%