

**Requerimientos de capital por las exposiciones frente a CRCC a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva**

31 de julio de 2019

<b>Resumen de estadísticas clave</b>	<b>Derivados Financieros</b>	<b>Renta Fija</b>	<b>Renta Variable</b>	<b>Swaps</b>
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	23	25	12	3
DF <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.399	2.698	586	65
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	109.820	67.350	14.630	1.620
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	100.270	61.962	12.192	540
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	104.669	64.660	12.778	605
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	162	32.224	0	45
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>3</b>	<b>516</b>	<b>0</b>	<b>1</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K<sub>CM</sub></b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0,16%	0,38%	0,16%	0,21%
<b>K<sub>CM</sub> = c1*DF<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>160,43</b>	<b>232,67</b>	<b>19,51</b>	<b>1,14</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,4490	0,6209	0,4405	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>			
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,4918	1,6748	1,5285	4,0000
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K<sub>CM</sub> / DF<sub>CM</sub>, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0,218%</b>	<b>0,579%</b>	<b>0,204%</b>	<b>0,283%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	2,18	5,79	2,04	2,83