

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

30 de Agosto de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	23	25	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	65
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	109,820	67,350	1,620
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	100,270	61,962	540
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	104,669	64,660	605
$\sum$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	35,821	1,269
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>573</b>	<b>20</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K*<sub>CM</sub></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%	0.39%	0.58%
<b>K*<sub>CM</sub> = c1 * DF<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>160.43</b>	<b>240.18</b>	<b>3.12</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.6539	0.6643	0.9971
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.7162	1.7220	3.9912
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*<sub>CM</sub> / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.251%</b>	<b>0.614%</b>	<b>0.769%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	2.51	6.14	7.69