

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

30 de Septiembre de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	25	3
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,325	3,794	67
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	80,570	91,950	1,620
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	73,245	84,594	540
DF = DF _{CCP} + DF _{CM}	76,570	88,388	607
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	146	44,639	2,035
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2	714	33
Fórmula seleccionada en el cálculo de K* _{CM}	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.38%	0.67%
K* _{CM} = c1*DF _{CM} , , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	117.19	318.93	3.59
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5142	0.6699	0.9983
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5656	1.7282	3.9950
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K* _{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.228%	0.599%	0.886%
K _{CM} si DFI = 1.000	2.28	5.99	8.86