

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

29 de Noviembre 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	4
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)	3,325	3,794	67
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	80,570	91,950	2,160
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	73,245	84,594	1,080
DF <sup>*</sup> = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	76,570	88,388	1,147
Σ (EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	161	15,778	2,102
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>3</b>	<b>252</b>	<b>34</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%	0.28%	0.56%
<b>K<sub>CM</sub> = c1*DF<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>117.19</b>	<b>233.45</b>	<b>5.99</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.4974	0.5430	0.9920
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5471	1.5902	2.9840
<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>0.225%</b>	<b>0.404%</b>	<b>0.828%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	2.25	4.04	8.28