

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

31 de Enero de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	25	4
DFCCP, 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
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	80,570	91,950	2,160
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	73,245	84,594	1,080
DF' = DFCCP + DF'CM	76,570	88,388	1,147
Σ (EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	184	30,237	3,736
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3	484	60
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%	0.34%	0.66%
K*CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	117.19	283.75	7.12
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.4673	0.4438	0.9948
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5141	1.4824	2.9897
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.220%	0.457%	0.986%
KCMI si DFi = 1.000	2.20	4.57	9.86