

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

28 de Febrero 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	5
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,359	4,135	98
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	96,310	118,560	2,820
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	87,555	109,075	1,692
DF [*] = DFCCP + DFCM	90,913	113,210	1,790
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	124	35,452	5,698
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2	567	91
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%	0.33%	0.65%
K*CM = c1*DFCM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	140.09	356.29	11.08
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5549	0.4108	0.9994
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.6104	1.4465	2.6656
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.234%	0.435%	1.047%
KCMI si DFI = 1.000	2.34	4.35	10.47