

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

31 de Abril de 2020

<b>Resumen de estadísticas clave</b>	<b>Derivados Financieros</b>	<b>Renta Fija</b>	<b>Swaps</b>
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)	3,504	3,961	116
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	84.610	95.650	2,800
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	76.918	87.998	1,680
DF = DFCCP + DFCM	80,422	91,959	1,796
$\Sigma$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	65	13,450	5,198
<b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>1</b>	<b>215</b>	<b>83</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K*CM</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%	0.26%	0.64%
<b>K*CM = c1*DFCM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>123.07</b>	<b>228.75</b>	<b>10.69</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5276	0.3660	0.9907
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5804	1.3978	2.6511
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.230%</b>	<b>0.334%</b>	<b>1.013%</b>
KCMI si DFI = 1.000	2.30	3.34	10.13