

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

30 de Junio de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
	COP Mill	COP Mill	COP Mill
Unidad	21	24	5
N, Número de miembros compensadores			
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2,468	5,123	127
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	84,630	175,680	4,370
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	76,570	161,040	2,622
DF = DFCCP + DFCM	79,038	166,163	2,749
$\Sigma$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	68	0	0
<b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>1</b>	<b>0</b>	<b>0</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%	0.16%	0.16%
<b>K*CM = c1*DF*CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>122.51</b>	<b>257.66</b>	<b>4.20</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.4840	0.3702	0.9788
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5350	1.4038	2.6313
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))<sup>2</sup> K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.222%</b>	<b>0.206%</b>	<b>0.253%</b>
KCMI si DFi = 1.000	2.22	2.06	2.53