

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

31 de Agosto de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	21	24	5
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2,287	5,182	278
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	86,000	194,910	10,440
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	77,810	178,668	6,264
DF = DFCCP + DF'CM	80,096	183,850	6,542
\sum (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	61	0	0
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	1	0	0
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%	0.16%	0.16%
K'CM = c1*DF'CM, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	124.50	285.87	10.02
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5735	0.4472	0.9346
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.6339	1.4879	2.5577
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.237%	0.218%	0.246%
KCMi si DFi = 1.000	2.37	2.18	2.46