

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

30 de Septiembre 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)	2,693	4,813	260
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	108,160	193,320	10,440
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	97,859	177,210	6,264
DF' = DFCCP + DF'CM	100,552	182,023	6,524
$\sum (EBRM_i - IM_i - DF_i)$, Exposición total ECC	58	7,810	4,045
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	1	125	65
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%	0.18%	0.40%
K*CM = c1*DF'CM, . Requerimiento de capital agregado sin ajustar	156.57	318.86	25.11
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5915	0.4837	0.9034
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
$(1 + \text{Beta} * N / (N - 2))$, Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.6537	1.5277	2.5056
C-factor = $(1 + \text{Beta} * N / (N - 2)) * K * CM / DFCM$, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.239%	0.252%	0.603%
KCMi si DFi = 1,000	2.39	2.52	6.03